

东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	东方红中证 500 指数增强发起	
基金主代码	021175	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 9 日	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	64,280,875.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
下属分级基金的交 易代码	021175	021176
报告期末下属分级 基金的份额总额	24,549,706.44 份	39,731,169.30 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型基金，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。 本基金以中证 500 指数为标的指数，按照标的指数的成份股及其权重初步构建基金股票投资组合。本基金将综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等因素，对投资组合进行优化。在标的指数成份股及备选成份股的基础上，使用量化投资的方法，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资投资策略、参

	与转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周陶	冯萌
	联系电话	021-53952888	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@dfham.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4009200808	95561
传真		021-63326381	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200010	200120
法定代表人		杨斌	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海东方证券资产管理有限公司	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
本期已实现收益	-210,742.54	-874,312.50
本期利润	939,736.05	1,395,428.62
加权平均基金份	0.0387	0.0386

额本期利润		
本期加权平均净 值利润率	3.42%	3.43%
本期基金份额净 值增长率	2.86%	2.66%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	4,156,699.44	6,546,291.73
期末可供分配基 金份额利润	0.1693	0.1648
期末基金资产净 值	28,706,405.88	46,277,461.03
期末基金份额净 值	1.1693	1.1648
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	16.93%	16.48%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红中证 500 指数增强发起 A

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去一个月	4.64%	0.66%	4.09%	0.75%	0.55%	-0.09%
过去三个月	0.40%	1.46%	0.97%	1.43%	-0.57%	0.03%
过去六个月	2.86%	1.26%	3.21%	1.29%	-0.35%	-0.03%

自基金合同生效 起至今	16.93%	1.34%	22.58%	1.65%	-5.65%	-0.31%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

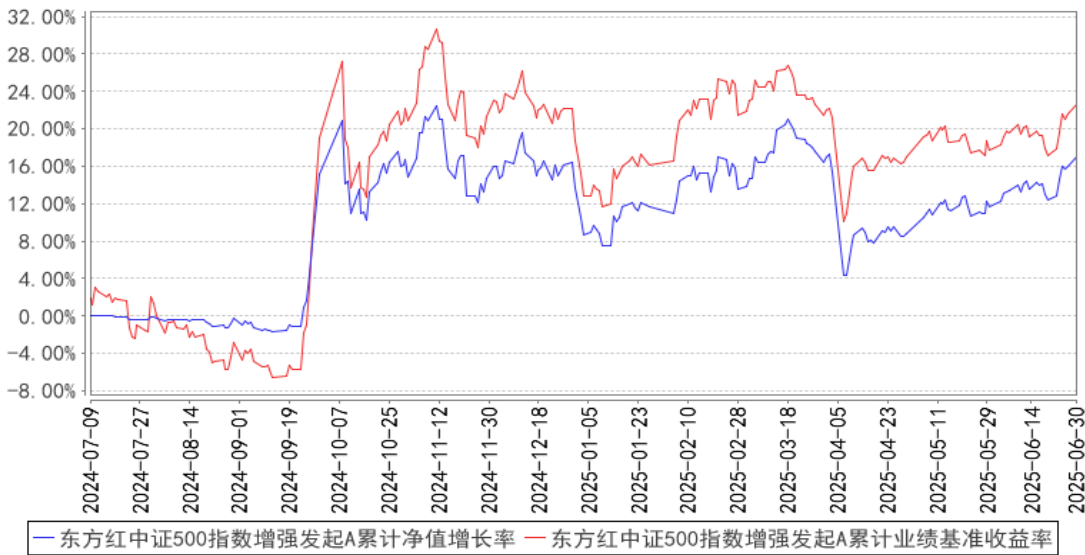
东方红中证 500 指数增强发起 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	4.62%	0.65%	4.09%	0.75%	0.53%	-0.10%
过去三个月	0.30%	1.46%	0.97%	1.43%	-0.67%	0.03%
过去六个月	2.66%	1.26%	3.21%	1.29%	-0.55%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	16.48%	1.34%	22.58%	1.65%	-6.10%	-0.31%

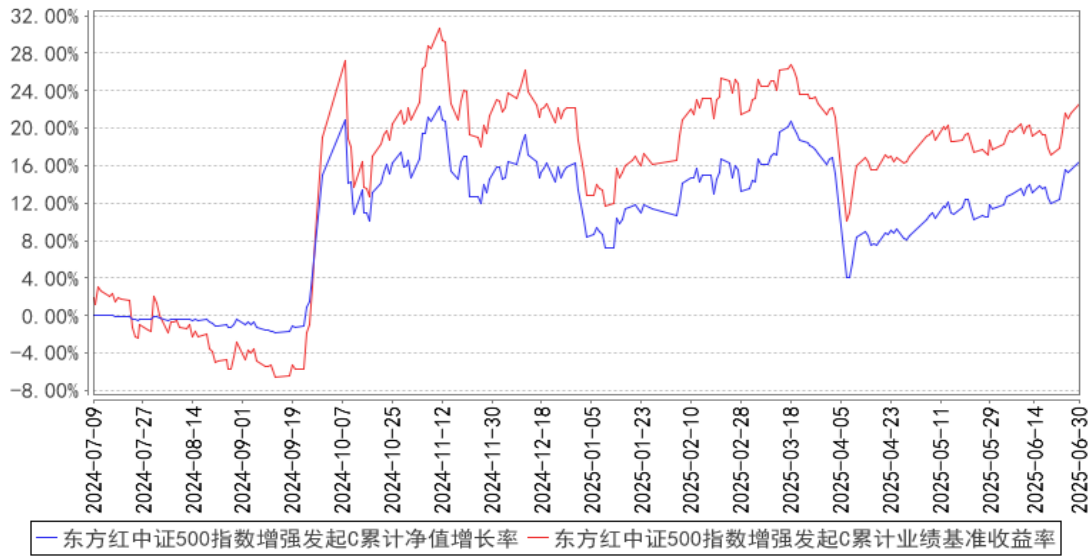
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。本基金每个交易日对业绩比较基准根据设定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红中证500指数增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红中证500指数增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、本基金合同于 2024 年 07 月 09 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。
- 2、本基金建仓期 6 个月，即从 2024 年 07 月 09 日起至 2025 年 01 月 08 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理公募基金 116 只，产品类型涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、指数型基金、货币型基金和 FOF 基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐习佳	上海东方证券资产	2024 年 7 月 9 日	—	24 年	上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部总经理、基金经理，2019 年

	管理有限公司公募指数与多策略部总经理、基金经理				07 月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理、2021 年 12 月至今任东方红中证东方红利低波动指数证券投资基金基金经理、2023 年 09 月至今任东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金基金经理、2024 年 05 月至今任东方红量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 07 月至今任东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 08 月至今任东方红红利量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。天普大学金融学博士。曾任联合证券投资银行部投行经理，美国 Towers Watson 资深分析师，兴业全球基金金融工程与专题研究部副总监、基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司研究部副总监、量化投资部总经理、投资主办人、公募指数与多策略部副总经理（主持工作）。具备证券投资基金从业资格。
--	-------------------------	--	--	--	--

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日（转型基金为初始基金合同生效日），“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
徐习佳	公募基金	6	7,544,891,975.85	2019 年 7 月 31 日
	私募资产管理计划	1	11,123,472.85	2024 年 5 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	7,556,015,448.70	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，4月初的贸易政策变化导致市场情绪波动，大盘大幅下跌，但其后稳步回升，截至6月底创出新高。今年以来，DeepSeek、Labubu 的出圈点燃了投资者对于科技股和新消费的热情，港股互联网科技股、创新药、新消费品种快速上涨，形成接力，进而拓展到对于中国资产的整体重估思考。总体而言，年初以来部分股票涨幅巨大，后继问题越来越聚焦到产业盈利能否兑现、市场流动性的延续力度和整体宏观经济与宏观总量政策的情况。二季度经济数据延续一季度走势，有待进一步观察。5月新增社融 2.29 万亿主要靠政府债贡献，市场融资需求不高。新增人民币贷款 6200 亿低于预期（去年同期 9500 亿），地产影响信贷增长（5月百强房企销售额同比-17%）。5月税收同比 0.6%（前值 1.9%），非税同比-2.2%，增速降低，土地出让收入同比-14.6%。5月 CPI 同比-0.1%（前值-0.1%）；PPI 同比-3.3%（前值-2.7%），前 5 月规模以上工业企业利润同比-1.1%，其中 5 月同比大跌（-9.1%），结构上，中游设备制造行业利润占比继续上升。目前看，今年以来国内政策、美联储的态度均为“应对”，宏观叙事的出现与动态发展似乎更加重要。

东方红中证 500 指数增强发起基金投资于一篮子盈利能力稳定、持有期利润增长概率高、价格合理的股票组合。我们注意到一季度中 500 成份股中涨幅超过指数涨幅的个股只有约 1/3，且根据涨幅分组后，涨幅与估值高度正相关的现象一直延续到 4 月底后才有所改变。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.1693 元，份额累计净值为 1.1693 元；C 类份额净值为 1.1648 元，份额累计净值为 1.1648 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 2.86%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%；C 类份额净值增长率为 2.66%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，外部环境上特朗普对华关税政策大概率仍有反复，美联储降息姗姗来迟；国内政策上，更多以应对为主，不宜期待过高。2024 年 9 月份市场情绪改善后，市场风格不再简单偏好红利和估值类因子，成长因子关注度大幅提高。站在目前位置，有利因素仍在集聚，但部分缺乏业绩支撑的个股涨幅较大，需要注意涨幅巨大个股的业绩兑现风险也逐步加大。我们通过对全市场公司的业绩变化追踪，注意到存在相当一部分来自不同行业的公司都或将实现显著高于市场平均水平的增长预期。中证 500 指数包涵了市场相当部分既具有足够市值容量，又具有增长潜力的行业与公司，是在当下时点实现权益资产进攻性但同时又有一定防御性的有效手段。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,261,060.74	5,262,961.82
结算备付金		855,785.39	38,273.11
存出保证金		305,104.80	148,709.60
交易性金融资产	6.4.7.2	68,108,786.42	57,776,651.00
其中：股票投资		68,108,786.42	57,776,651.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		1,544,030.43	446,034.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		79,074,767.78	63,672,630.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,972,433.56	1,350,643.87
应付管理人报酬		46,678.04	43,329.96
应付托管费		5,834.74	5,416.24
应付销售服务费		14,307.94	12,060.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,058.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	49,588.57	56,000.00
负债合计		4,090,900.87	1,467,450.28
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	64,280,875.74	54,780,478.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,702,991.17	7,424,701.93
净资产合计		74,983,866.91	62,205,180.08
负债和净资产总计		79,074,767.78	63,672,630.36

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 64,280,875.74 份，其中东方红中证 500 指数增强发起 A 基金份额总额 24,549,706.44 份，基金份额净值 1.1693 元；东方红中证 500 指数增强发起 C 基金份额总额 39,731,169.30 份，基金份额净值 1.1648 元。

6.2 利润表

会计主体：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,778,179.46
1. 利息收入		9,571.35

其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,571.35
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-692,125.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,448,579.98
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	85,906.33
股利收益	6.4.7.19	670,547.70
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,420,219.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	40,514.35
减：二、营业总支出		443,014.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	275,332.47
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,416.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	83,190.40
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		311.80
8. 其他费用	6.4.7.23	49,763.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,335,164.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,335,164.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,335,164.67

注：本基金合同生效日为 2024 年 07 月 09 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报表无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,780,478.15	7,424,701.93	62,205,180.08
二、本期期初净资产	54,780,478.15	7,424,701.93	62,205,180.08
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	9,500,397.59	3,278,289.24	12,778,686.83
(一)、综合收益总额	-	2,335,164.67	2,335,164.67
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	9,500,397.59	943,124.57	10,443,522.16
其中：1. 基金申购款	118,694,533.73	15,032,553.44	133,727,087.17
2. 基金赎回款	-109,194,136.14	-14,089,428.87	-123,283,565.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	64,280,875.74	10,702,991.17	74,983,866.91

注：本基金合同生效日为 2024 年 07 月 09 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报表无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

成飞

汤琳

陈培

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2024]474 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 156,119,295.66 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(24)第 00094 号验资报告。基金合同于 2024 年 7 月 9 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,003,600.36 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司发行的短期债券等)、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定,参与融资融券业务中的融资业务及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例不低于基金资产的 80%;投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%;每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、中基协发[2013]13 号《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政

策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,317,190.58
等于：本金	1,316,863.14
加：应计利息	327.44
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	6,943,870.16
等于：本金	6,943,594.45
加：应计利息	275.71
减：坏账准备	-
合计	8,261,060.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		65,469,144.22	-	68,108,786.42	2,639,642.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		65,469,144.22	-	68,108,786.42	2,639,642.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,255,888.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,255,888.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	2,255,888.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	2.00	2,346,960.00	91,072.00
合计				91,072.00
减：可抵销期货暂收款				91,072.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
合计	49,588.57

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红中证 500 指数增强发起 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,193,639.27	24,193,639.27
本期申购	6,202,690.87	6,202,690.87
本期赎回（以“-”号填列）	-5,846,623.70	-5,846,623.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	24,549,706.44	24,549,706.44

东方红中证 500 指数增强发起 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,586,838.88	30,586,838.88
本期申购	112,491,842.86	112,491,842.86
本期赎回（以“-”号填列）	-103,347,512.44	-103,347,512.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	39,731,169.30	39,731,169.30

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红中证 500 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,474,963.16	-1,165,753.88	3,309,209.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,474,963.16	-1,165,753.88	3,309,209.28
本期利润	-210,742.54	1,150,478.59	939,736.05
本期基金份额交易产生的变动数	101,844.10	-194,089.99	-92,245.89
其中：基金申购款	1,139,645.82	-381,914.29	757,731.53
基金赎回款	-1,037,801.72	187,824.30	-849,977.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,366,064.72	-209,365.28	4,156,699.44

东方红中证 500 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,585,865.64	-1,470,372.99	4,115,492.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,585,865.64	-1,470,372.99	4,115,492.65
本期利润	-874,312.50	2,269,741.12	1,395,428.62
本期基金份额交易产生的变动数	2,175,400.47	-1,140,030.01	1,035,370.46
其中：基金申购款	19,794,611.24	-5,519,789.33	14,274,821.91
基金赎回款	-17,619,210.77	4,379,759.32	-13,239,451.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,886,953.61	-340,661.88	6,546,291.73

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,111.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,391.41
结算备付金利息收入	1,050.86
其他	17.70
合计	9,571.35

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,448,579.98
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,448,579.98

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	281,077,375.27
减：卖出股票成本总额	282,239,822.16
减：交易费用	286,133.09
买卖股票差价收入	-1,448,579.98

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	85,906.33

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	670,547.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	670,547.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,275,867.71
股票投资	3,275,867.71

债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	144,352.00
权证投资	-
期货投资	144,352.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	3,420,219.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,514.35
合计	40,514.35

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	175.00
合计	49,763.57

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	275,332.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	102,535.72
应支付基金管理人的净管理费	172,796.75

注：(1) 支付基金管理人东证资管的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

(2) 实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,416.55

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.10\%$ 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值 $\times 0.10\% \div$ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红中证 500 指数 增强发起 A	东方红中证 500 指数 增强发起 C	合计
东方证券	—	0.74	0.74
东证资管	—	3,455.06	3,455.06
兴业银行	—	20,750.63	20,750.63
合计	—	24,206.43	24,206.43

注：根据基金合同的规定，东方红中证 500 指数增强发起 A 不收取销售服务费，东方红中证 500 指数增强发起 C 的销售服务费按基金前一日的基金资产净值 $\times 0.40\%$ 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：东方红中证 500 指数增强发起 C 的日销售服务费=前一日东方红中证 500 指数增强发起 C 基金资产净值 $\times 0.40\% \div$ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2024 年 7 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,600.36	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,003,600.36	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.7484%	-

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

2、分类基金持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,317,190.58	3,111.38

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2025 年 06 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额(2024 年 12 月 31 日：同)。于 2025 年上半年，本基金当期交易手续费支

出 703.38 元(2024 年同期: 0 元)。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中, 结算备付金按协议利率计息, 存出保证金不计息。于 2025 年 06 月 30 日, 本基金存放于东证期货的结算备付金余额(不含应计利息)为 855,671.63 元, 存出保证金余额为 305,104.80 元(2024 年 12 月 31 日: 结算备付金余额 38,244.45 元, 存出保证金余额 148,709.60 元)。于报告期内, 本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为 1,050.86 元(2024 年同期: 0 元)。

6.4.11 利润分配情况

注: 1、本基金本报告期内未进行利润分配。

2、本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

6.4.12 期末(2025 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: 本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注: 本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括: 信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 在董事会下设立合规与风险管理委员会, 负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见; 对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见; 对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见; 对需董事会审议的合规报告和风险评估

报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放日内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持证券主要在证券交易所或银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 06 月 30 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放日内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2025 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,261,060.74	-	-	-	-	-	8,261,060.74
结算备付金	855,785.39	-	-	-	-	-	855,785.39
存出保证金	-	-	-	-	-	305,104.80	305,104.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	68,108,786.42	68,108,786.42
应收申购款	0.12	-	-	-	-	1,544,030.31	1,544,030.43
资产总计	9,116,846.25	-	-	-	-	69,957,921.53	79,074,767.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,972,433.56	3,972,433.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	46,678.04	46,678.04

应付托管费	-	-	-	-	-	5,834.74	5,834.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,307.94	14,307.94
应交税费	-	-	-	-	-	2,058.02	2,058.02
其他负债	-	-	-	-	-	49,588.57	49,588.57
负债总计	-	-	-	-	-	4,090,900.87	4,090,900.87
利率敏感度缺口	9,116,846.25	-	-	-	-	-65,867,020.66	74,983,866.91
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,262,961.82	-	-	-	-	-	5,262,961.82
结算备付金	38,273.11	-	-	-	-	-	38,273.11
存出保证金	-	-	-	-	-	148,709.60	148,709.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	57,776,651.00	57,776,651.00
应收申购款	2,250.01	-	-	-	-	443,784.82	446,034.83
资产总计	5,303,484.94	-	-	-	-	-58,369,145.42	63,672,630.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,350,643.87	1,350,643.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,329.96	43,329.96
应付托管费	-	-	-	-	-	5,416.24	5,416.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,060.21	12,060.21
其他负债	-	-	-	-	-	56,000.00	56,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,467,450.28	1,467,450.28
利率敏感度缺口	5,303,484.94	-	-	-	-	-56,901,695.14	62,205,180.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有

的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	68,108,786.42	90.83	57,776,651.00	92.88
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	68,108,786.42	90.83	57,776,651.00	92.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	4,426,047.43	2,904,968.93
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-4,426,047.43	-2,904,968.93

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
--

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	68,108,786.42	57,776,651.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	68,108,786.42	57,776,651.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	68,108,786.42	86.13
	其中：股票	68,108,786.42	86.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,116,846.13	11.53
8	其他各项资产	1,849,135.23	2.34
9	合计	79,074,767.78	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	73,542.00	0.10
B	采矿业	2,967,979.00	3.96
C	制造业	34,338,424.60	45.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,931,898.00	2.58
E	建筑业	481,189.00	0.64
F	批发和零售业	2,176,263.00	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,102,558.00	1.47
H	住宿和餐饮业	84,780.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,273,453.80	3.03
J	金融业	6,485,892.10	8.65
K	房地产业	792,390.00	1.06

L	租赁和商务服务业	69,540.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	120,407.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	84,392.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,649,485.00	2.20
S	综合	148,864.00	0.20
	合计	54,781,057.50	73.06

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	120,020.00	0.16
C	制造业	10,010,950.92	13.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,970.00	0.23
E	建筑业	29,766.00	0.04
F	批发和零售业	103,609.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,372,608.20	1.83
J	金融业	642,205.00	0.86
K	房地产业	94,563.00	0.13
L	租赁和商务服务业	167,183.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	67,319.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	30,652.80	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	278,733.00	0.37
Q	卫生和社会工作	—	—

R	文化、体育和娱乐业	238,149.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	13,327,728.92	17.77

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000783	长江证券	295,400	2,047,122.00	2.73
2	300395	菲利华	35,900	1,834,490.00	2.45
3	000050	深天马 A	192,000	1,635,840.00	2.18
4	600998	九州通	311,800	1,602,652.00	2.14
5	300373	扬杰科技	26,500	1,375,350.00	1.83
6	600707	彩虹股份	207,600	1,341,096.00	1.79
7	600578	京能电力	287,100	1,289,079.00	1.72
8	603087	甘李药业	22,000	1,205,160.00	1.61
9	603379	三美股份	22,900	1,101,948.00	1.47
10	002532	天山铝业	131,300	1,091,103.00	1.46
11	600348	华阳股份	151,300	1,007,658.00	1.34
12	688297	中无人机	17,800	950,520.00	1.27
13	002603	以岭药业	64,700	912,270.00	1.22
14	003022	联泓新科	54,800	867,484.00	1.16
15	002595	豪迈科技	14,400	852,768.00	1.14
16	600499	科达制造	84,400	827,120.00	1.10
17	688002	睿创微纳	10,900	759,948.00	1.01
18	688278	特宝生物	10,400	749,944.00	1.00
19	600901	江苏金租	121,200	734,472.00	0.98
20	300803	指南针	9,000	725,940.00	0.97
21	600563	法拉电子	6,400	698,176.00	0.93
22	300073	当升科技	15,900	697,533.00	0.93
23	601555	东吴证券	78,900	690,375.00	0.92
24	600166	福田汽车	253,400	686,714.00	0.92
25	600109	国金证券	78,200	685,814.00	0.91
26	000636	风华高科	49,900	685,626.00	0.91
27	002202	金风科技	66,200	678,550.00	0.90
28	002130	沃尔核材	28,300	674,106.00	0.90
29	002340	格林美	105,800	671,830.00	0.90
30	600873	梅花生物	61,300	655,297.00	0.87

31	002223	鱼跃医疗	18,200	647,920.00	0.86
32	000426	兴业银锡	40,900	646,220.00	0.86
33	688188	柏楚电子	4,880	642,500.80	0.86
34	601928	凤凰传媒	57,200	638,924.00	0.85
35	601577	长沙银行	63,800	634,172.00	0.85
36	000739	普洛药业	43,800	613,200.00	0.82
37	600885	宏发股份	26,560	592,553.60	0.79
38	600282	南钢股份	138,300	580,860.00	0.77
39	300017	网宿科技	53,900	577,808.00	0.77
40	300454	深信服	6,100	574,498.00	0.77
41	300037	新宙邦	16,000	563,200.00	0.75
42	601333	广深铁路	193,200	558,348.00	0.74
43	688475	萤石网络	17,400	548,448.00	0.73
44	603979	金诚信	11,100	515,484.00	0.69
45	600582	天地科技	83,000	497,170.00	0.66
46	601966	玲珑轮胎	32,600	478,242.00	0.64
47	300573	兴齐眼药	9,100	471,289.00	0.63
48	000709	河钢股份	210,200	454,032.00	0.61
49	601216	君正集团	81,300	448,776.00	0.60
50	002353	杰瑞股份	12,800	448,000.00	0.60
51	000893	亚钾国际	14,600	440,044.00	0.59
52	600007	中国国贸	20,500	421,890.00	0.56
53	300627	华测导航	11,920	417,200.00	0.56
54	002138	顺络电子	14,800	416,176.00	0.56
55	000598	兴蓉环境	55,100	397,271.00	0.53
56	603816	顾家家居	15,400	393,008.00	0.52
57	002244	滨江集团	38,000	370,500.00	0.49
58	600968	海油发展	90,500	369,240.00	0.49
59	601019	山东出版	38,100	360,807.00	0.48
60	603565	中谷物流	37,400	357,170.00	0.48
61	300251	光线传媒	16,200	328,374.00	0.44
62	600820	隧道股份	53,700	327,570.00	0.44
63	000887	中鼎股份	17,900	314,861.00	0.42
64	002461	珠江啤酒	27,300	308,217.00	0.41
65	600312	平高电气	20,000	307,800.00	0.41
66	002624	完美世界	19,600	297,332.00	0.40
67	603529	爱玛科技	8,600	295,840.00	0.39
68	601665	齐鲁银行	44,600	281,872.00	0.38
69	601061	中信金属	35,600	281,596.00	0.38
70	600801	华新水泥	21,600	255,744.00	0.34
71	000878	云南铜业	20,100	255,672.00	0.34
72	000960	锡业股份	16,600	253,980.00	0.34
73	600517	国网英大	49,200	250,920.00	0.33

74	600398	海澜之家	36,000	250,560.00	0.33
75	601098	中南传媒	18,500	242,720.00	0.32
76	001696	宗申动力	10,800	242,460.00	0.32
77	003031	中瓷电子	3,800	202,198.00	0.27
78	002966	苏州银行	22,000	193,160.00	0.26
79	600704	物产中大	36,500	192,355.00	0.26
80	600487	亨通光电	11,800	180,540.00	0.24
81	002517	恺英网络	8,600	166,066.00	0.22
82	002472	双环传动	4,900	164,101.00	0.22
83	300476	胜宏科技	1,200	161,256.00	0.22
84	600483	福能股份	16,700	160,988.00	0.21
85	300888	稳健医疗	3,800	156,180.00	0.21
86	002085	万丰奥威	9,500	150,955.00	0.20
87	600673	东阳光	12,800	148,864.00	0.20
88	601168	西部矿业	8,600	143,018.00	0.19
89	603486	科沃斯	2,300	133,929.00	0.18
90	002500	山西证券	20,900	122,056.00	0.16
91	601717	郑煤机	7,300	121,326.00	0.16
92	300012	华测检测	10,300	120,407.00	0.16
93	603868	飞科电器	3,300	118,371.00	0.16
94	000729	燕京啤酒	8,900	115,077.00	0.15
95	000921	海信家电	4,400	113,080.00	0.15
96	603345	安井食品	1,300	104,546.00	0.14
97	601918	新集能源	15,900	102,714.00	0.14
98	002507	涪陵榨菜	7,800	99,762.00	0.13
99	600298	安琪酵母	2,800	98,476.00	0.13
100	601615	明阳智能	8,500	97,665.00	0.13
101	600004	白云机场	10,300	93,730.00	0.13
102	000429	粤高速 A	7,000	93,310.00	0.12
103	601233	桐昆股份	8,300	87,980.00	0.12
104	601128	常熟银行	11,930	87,924.10	0.12
105	600583	海油工程	16,100	87,906.00	0.12
106	600258	首旅酒店	6,000	84,780.00	0.11
107	600008	首创环保	28,000	84,560.00	0.11
108	002266	浙富控股	27,400	84,392.00	0.11
109	300144	宋城演艺	9,200	78,660.00	0.10
110	601611	中国核建	8,500	78,115.00	0.10
111	002831	裕同科技	3,300	77,286.00	0.10
112	002078	太阳纸业	5,700	76,722.00	0.10
113	603589	口子窖	2,200	76,560.00	0.10
114	600970	中材国际	8,800	75,504.00	0.10
115	002385	大北农	18,300	73,932.00	0.10
116	600598	北大荒	5,100	73,542.00	0.10

117	002299	圣农发展	5,000	71,450.00	0.10
118	000785	居然智家	22,800	69,540.00	0.09
119	002080	中材科技	3,400	66,300.00	0.09
120	600655	豫园股份	11,700	64,935.00	0.09
121	600177	雅戈尔	7,600	55,480.00	0.07
122	002563	森马服饰	10,500	55,230.00	0.07
123	601636	旗滨集团	10,600	53,106.00	0.07
124	600988	赤峰黄金	2,100	52,248.00	0.07
125	603605	珀莱雅	600	49,674.00	0.07
126	000988	华工科技	1,000	47,010.00	0.06
127	600339	中油工程	13,300	43,491.00	0.06
128	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.05
129	600720	中交设计	4,900	37,877.00	0.05
130	600859	王府井	2,500	34,725.00	0.05
131	600909	华安证券	5,500	32,065.00	0.04
132	300339	润和软件	300	15,249.00	0.02
133	002056	横店东磁	400	5,660.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603386	骏亚科技	60,400	764,060.00	1.02
2	300389	艾比森	59,400	687,852.00	0.92
3	002380	科远智慧	23,600	577,020.00	0.77
4	300812	易天股份	24,200	559,262.00	0.75
5	688272	富吉瑞	20,300	549,115.00	0.73
6	002913	奥士康	17,900	526,439.00	0.70
7	300615	欣天科技	37,500	501,375.00	0.67
8	301045	天禄科技	19,500	446,550.00	0.60
9	300951	博硕科技	12,500	428,750.00	0.57
10	600918	中泰证券	65,700	422,451.00	0.56
11	688328	深科达	18,200	412,230.00	0.55
12	603551	奥普科技	36,400	400,036.00	0.53
13	688718	唯赛勃	30,634	379,248.92	0.51
14	002817	黄山胶囊	51,100	377,118.00	0.50
15	605499	东鹏饮料	1,200	376,860.00	0.50
16	002728	特一药业	42,500	357,425.00	0.48
17	603527	众源新材	31,300	340,231.00	0.45
18	603151	邦基科技	16,200	327,240.00	0.44
19	002322	理工能科	26,800	324,280.00	0.43
20	601218	吉鑫科技	70,700	290,577.00	0.39
21	300850	新强联	7,600	272,232.00	0.36
22	300231	银信科技	19,100	235,121.00	0.31

23	600219	南山铝业	59,600	228,268.00	0.30
24	002511	中顺洁柔	32,000	215,040.00	0.29
25	300717	华信新材	10,100	183,113.00	0.24
26	000970	中科三环	15,400	181,258.00	0.24
27	600780	通宝能源	29,000	171,970.00	0.23
28	603639	海利尔	11,900	167,195.00	0.22
29	600661	昂立教育	13,300	141,645.00	0.19
30	002659	凯文教育	27,200	137,088.00	0.18
31	000651	格力电器	2,800	125,776.00	0.17
32	002454	松芝股份	16,000	123,520.00	0.16
33	300133	华策影视	16,300	122,413.00	0.16
34	301020	密封科技	5,600	122,248.00	0.16
35	000655	金岭矿业	17,000	120,020.00	0.16
36	301396	宏景科技	1,920	119,251.20	0.16
37	301248	杰创智能	4,700	116,936.00	0.16
38	601900	南方传媒	7,400	115,736.00	0.15
39	000042	中洲控股	13,300	94,563.00	0.13
40	002769	普路通	9,300	90,024.00	0.12
41	601211	国泰海通	4,200	80,472.00	0.11
42	001228	永泰运	3,100	77,159.00	0.10
43	000586	汇源通信	6,600	73,392.00	0.10
44	002936	郑州银行	34,400	70,864.00	0.09
45	601963	重庆银行	6,300	68,418.00	0.09
46	600105	永鼎股份	8,300	67,147.00	0.09
47	000869	张裕 A	2,800	59,444.00	0.08
48	300160	秀强股份	8,800	49,456.00	0.07
49	002695	煌上煌	4,300	40,420.00	0.05
50	002661	克明食品	4,000	40,040.00	0.05
51	002476	宝莫股份	7,600	37,012.00	0.05
52	688101	三达膜	2,600	36,244.00	0.05
53	688334	西高院	2,000	34,360.00	0.05
54	300416	苏试试验	2,300	32,959.00	0.04
55	001211	双枪科技	1,400	31,934.00	0.04
56	001316	润贝航科	700	31,857.00	0.04
57	603617	君禾股份	4,400	31,548.00	0.04
58	600496	精工钢构	9,700	31,040.00	0.04
59	301109	军信股份	2,060	30,652.80	0.04
60	605080	浙江自然	1,100	30,580.00	0.04
61	688098	申联生物	4,900	29,939.00	0.04
62	301098	金埔园林	3,300	29,766.00	0.04
63	002286	保龄宝	2,600	29,458.00	0.04
64	600058	五矿发展	3,600	27,828.00	0.04
65	002091	江苏国泰	3,600	26,172.00	0.03

66	002687	乔治白	4,800	22,272.00	0.03
67	300234	开尔新材	4,400	21,868.00	0.03
68	300945	曼卡龙	800	17,752.00	0.02
69	600682	南京新百	2,200	14,784.00	0.02
70	300196	长海股份	900	10,980.00	0.01
71	002398	垒知集团	2,100	10,374.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002185	华天科技	6,364,329.00	10.23
2	600563	法拉电子	5,641,383.00	9.07
3	000623	吉林敖东	4,923,671.00	7.92
4	000783	长江证券	4,261,413.00	6.85
5	600143	金发科技	3,763,854.00	6.05
6	300699	光威复材	3,726,479.00	5.99
7	601555	东吴证券	3,576,461.00	5.75
8	601696	中银证券	3,421,944.00	5.50
9	300803	指南针	3,393,553.00	5.46
10	002202	金风科技	3,191,670.00	5.13
11	603338	浙江鼎力	3,002,289.00	4.83
12	002500	山西证券	2,839,574.00	4.56
13	002384	东山精密	2,810,453.00	4.52
14	002432	九安医疗	2,768,407.00	4.45
15	601198	东兴证券	2,662,820.00	4.28
16	300373	扬杰科技	2,539,062.00	4.08
17	603087	甘李药业	2,503,011.00	4.02
18	600998	九州通	2,449,508.00	3.94
19	300002	神州泰岳	2,322,291.00	3.73
20	688122	西部超导	2,268,969.50	3.65
21	688002	睿创微纳	2,246,878.71	3.61
22	600885	宏发股份	2,181,597.00	3.51
23	600316	洪都航空	2,145,530.00	3.45
24	300724	捷佳伟创	2,062,884.00	3.32
25	600928	西安银行	2,028,677.00	3.26
26	600707	彩虹股份	1,899,408.00	3.05
27	688093	世华科技	1,891,850.05	3.04
28	300677	英科医疗	1,885,920.00	3.03
29	000960	锡业股份	1,877,609.00	3.02
30	603707	健友股份	1,870,418.00	3.01
31	002532	天山铝业	1,815,831.00	2.92
32	600578	京能电力	1,801,229.00	2.90

33	600968	海油发展	1,758,424.00	2.83
34	300395	菲利华	1,757,970.00	2.83
35	000729	燕京啤酒	1,756,646.00	2.82
36	002409	雅克科技	1,737,236.00	2.79
37	600764	中国海防	1,699,999.00	2.73
38	000050	深天马 A	1,689,079.00	2.72
39	603979	金诚信	1,680,535.00	2.70
40	000039	中集集团	1,634,411.00	2.63
41	600295	鄂尔多斯	1,627,623.63	2.62
42	601399	国机重装	1,611,463.00	2.59
43	688772	珠海冠宇	1,603,907.92	2.58
44	603811	诚意药业	1,581,140.00	2.54
45	300037	新宙邦	1,546,384.00	2.49
46	688553	汇宇制药	1,514,872.35	2.44
47	688606	奥泰生物	1,407,452.32	2.26
48	002368	太极股份	1,398,286.00	2.25
49	300017	网宿科技	1,396,101.00	2.24
50	601156	东航物流	1,369,048.00	2.20
51	300476	胜宏科技	1,363,191.00	2.19
52	600348	华阳股份	1,317,074.00	2.12
53	601179	中国西电	1,269,186.00	2.04
54	000883	湖北能源	1,266,419.00	2.04
55	002373	千方科技	1,260,672.00	2.03

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002432	九安医疗	6,943,724.83	11.16
2	601696	中银证券	6,644,204.00	10.68
3	002185	华天科技	6,280,197.00	10.10
4	002273	水晶光电	5,083,229.00	8.17
5	300699	光威复材	4,802,850.60	7.72
6	000623	吉林敖东	4,727,184.00	7.60
7	600563	法拉电子	4,564,702.00	7.34
8	600143	金发科技	3,985,286.00	6.41
9	002202	金风科技	3,732,037.99	6.00
10	600299	安迪苏	3,493,493.00	5.62
11	300724	捷佳伟创	3,249,064.00	5.22
12	603338	浙江鼎力	3,127,313.00	5.03
13	688002	睿创微纳	2,947,294.75	4.74

14	601555	东吴证券	2,933,050.00	4.72
15	300803	指南针	2,812,427.15	4.52
16	601198	东兴证券	2,676,103.00	4.30
17	002500	山西证券	2,658,316.00	4.27
18	002384	东山精密	2,648,810.00	4.26
19	000997	新大陆	2,506,323.00	4.03
20	000039	中集集团	2,438,881.00	3.92
21	601179	中国西电	2,355,044.00	3.79
22	688122	西部超导	2,315,372.83	3.72
23	600316	洪都航空	2,232,417.00	3.59
24	600764	中国海防	2,226,426.00	3.58
25	000783	长江证券	2,226,153.00	3.58
26	688093	世华科技	2,218,160.27	3.57
27	300002	神州泰岳	2,120,380.00	3.41
28	603707	健友股份	2,119,239.00	3.41
29	603979	金诚信	2,049,794.00	3.30
30	002128	电投能源	1,999,520.01	3.21
31	002368	太极股份	1,986,996.00	3.19
32	300677	英科医疗	1,986,958.00	3.19
33	600928	西安银行	1,982,627.00	3.19
34	000729	燕京啤酒	1,810,166.00	2.91
35	300476	胜宏科技	1,791,637.00	2.88
36	600487	亨通光电	1,756,311.00	2.82
37	000686	东北证券	1,725,441.00	2.77
38	688553	汇宇制药	1,721,451.31	2.77
39	600517	国网英大	1,682,974.00	2.71
40	601399	国机重装	1,674,910.00	2.69
41	603811	诚意药业	1,616,860.00	2.60
42	002409	雅克科技	1,612,328.00	2.59
43	600295	鄂尔多斯	1,605,957.00	2.58
44	000960	锡业股份	1,577,633.00	2.54
45	603087	甘李药业	1,565,538.00	2.52
46	600959	江苏有线	1,564,941.68	2.52
47	601156	东航物流	1,509,698.00	2.43
48	688772	珠海冠宇	1,442,415.13	2.32
49	000883	湖北能源	1,440,064.00	2.32
50	600282	南钢股份	1,439,152.00	2.31
51	600885	宏发股份	1,432,705.00	2.30
52	601168	西部矿业	1,398,974.00	2.25
53	002532	天山铝业	1,380,062.00	2.22
54	600968	海油发展	1,342,308.00	2.16
55	002984	森麒麟	1,328,092.00	2.14
56	600583	海油工程	1,314,473.00	2.11

57	300373	扬杰科技	1,309,132.00	2.10
----	--------	------	--------------	------

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	289,296,089.87
卖出股票收入（成交）总额	281,077,375.27

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并通过对证券市场和期货市场运行趋势的研判，结合对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，以对冲系统性风险和流动性风险。本基金还将利用股指期货，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，在风险可控的前提下，参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	305,104.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,544,030.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,849,135.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
东方红中 证 500 指 数增强发 起 A	400	61,374.27	10,047,442.29	40.93	14,502,264.15	59.07
东方红中 证 500 指 数增强发 起 C	1,261	31,507.67	80,000.00	0.20	39,651,169.30	99.80
合计	1,661	38,700.11	10,127,442.29	15.75	54,153,433.45	84.25

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	东方红中证 500 指数增强发 起 A	494,817.35	2.02
	东方红中证 500 指数增强发 起 C	1,158,573.99	2.92
	合计	1,653,391.34	2.57

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	东方红中证 500 指数增强 发起 A	10~50
	东方红中证 500 指数增强 发起 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	东方红中证 500 指数增强 发起 A	0

	东方红中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,600.36	15.56	10,000,000.00	15.56	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,003,600.36	15.56	10,000,000.00	15.56	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2024 年 7 月 9 日）基金份额总额	44,603,210.79	111,516,084.87
本报告期期初基金份额总额	24,193,639.27	30,586,838.88
本报告期基金总申购份额	6,202,690.87	112,491,842.86
减：本报告期基金总赎回份额	5,846,623.70	103,347,512.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	24,549,706.44	39,731,169.30

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未发生基金份额持有人大会决议事项。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，管理人的重大人事变动情况如下：

自 2025 年 4 月 3 日起，王峰同志、张云同志担任公司董事职务，蒋鹤磊同志、张锋同志不再担任公司董事职务，杨洁琼同志不再担任公司监事职务，刘枫同志不再担任公司职工监事职务，杨斌同志代行公司总经理职务，张锋同志不再担任公司总经理职务。自 2025 年 5 月 9 日起，成飞同志担任公司董事职务、总经理职务，杨斌同志不再代行公司总经理职务。自 2025 年 6 月 25 日起，周代希同志担任公司职工董事职务。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产的诉讼。

报告期内无涉及本基金本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华福证券	2	570,373,465.14	100.00	109,020.62	100.00	-

注：1、本基金采用委托证券公司办理交易模式，不适用单个证券公司交易佣金的比例限制，上

述数据为本基金通过相应证券公司办理交易的相关数据。

2、证券公司的选择标准和程序

(1) 选择标准

证券公司财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力和交易服务能力；针对除被动股票型基金外的其余基金将研究服务能力纳入考量。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同证券公司进行综合评价和选择，与其签订经纪服务协议。

3、本基金本报告期内委托办理交易的证券公司无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华福证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 1 月 22 日
2	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 3 月 31 日
3	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 4 月 22 日
4	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025 年 6 月 3 日
5	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025 年 6 月 3 日
6	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025 年 6 月 3 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2025 年 8 月 29 日