

东方中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 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	5
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	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	57
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	57
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	东方中证 A500 指数增强	
基金主代码	023544	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 4 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
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	1,844,341,444.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023544	023545
报告期末下属分级基金的份额总额	181,270,935.22 份	1,663,070,509.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争在控制本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 7.75%的基础上，力求实现超越标的指数的投资收益。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		东方基金管理股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	冯萌
	联系电话	010-66295888	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95561

传真	010-66578700	021-62159217
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 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	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100073	200120
法定代表人	崔伟	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com
基金中期报告置备地点	本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	22,089,155.56	220,153,045.40
本期利润	42,664,697.79	435,010,939.70
加权平均基金份 额本期利润	0.2497	0.2181
本期加权平均净 值利润率	18.59%	16.42%
本期基金份额净 值增长率	20.57%	20.29%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	37,733,147.27	334,060,877.50
期末可供分配基 金份额利润	0.2082	0.2009
期末基金资产净	271,115,463.23	2,473,928,377.47

值		
期末基金份额净值	1.4956	1.4876
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	49.56%	48.76%

注：①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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

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

东方中证 A500 指数增强 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
过去三个月	20.82%	1.49%	13.54%	1.34%	7.28%	0.15%
过去六个月	20.57%	1.36%	11.34%	1.22%	9.23%	0.14%
过去一年	49.41%	1.18%	34.41%	1.09%	15.00%	0.09%
自基金合同生效起至今	49.56%	1.14%	37.76%	1.06%	11.80%	0.08%

东方中证 A500 指数增强 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
过去三个月	20.67%	1.49%	13.54%	1.34%	7.13%	0.15%
过去六个月	20.29%	1.36%	11.34%	1.22%	8.95%	0.14%
过去一年	48.67%	1.18%	34.41%	1.09%	14.26%	0.09%
自基金合同生效起至今	48.76%	1.14%	37.76%	1.06%	11.00%	0.08%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

东方中证A500指数增强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



东方中证A500指数增强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：本基金基金合同于 2025 年 06 月 04 日生效,建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80 号”批复，于 2004 年 6 月 11 日成立。

截至 2026 年 6 月 30 日，本公司注册资本 3.3333 亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份 19200 万股，持股比例 57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份 8100 万股，持股比例 24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份 2700 万股，持股比例 8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1170 万股，持股比例 3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1123 万股，持股比例 3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1040 万股，持股比例 3.12%。

截止 2026 年 6 月 30 日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债

债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金、东方招益债券型证券投资基金、东方低碳经济混合型证券投资基金、东方养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金、东方和煦 30 天持有期债券型证券投资基金。

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		
盛泽	本基金基金经理、量化投资部总经理	2025 年 6 月 4 日	-	11 年	量化投资部总经理，华威大学经济与国际金融经济学硕士，11 年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018 年 7 月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理、量化投资部副总经理、资产配置部总经理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理，现任东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。
王怀勋	本基金基金经理	2025 年 9 月 16 日	-	11 年	中国人民大学金融专业硕士，11 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾

					任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），制定了公司公平交易管理制度。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。

本报告期内，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

本报告期内，市场整体表现温和，指数层面先上涨、后震荡，但行情分化明显，大盘成长风格突出。具体来说，以沪深 300 为代表的大盘指数上涨 7.5%，以微盘股指数为代表的小微盘下跌 -7.2%，以中证 500 为代表的中盘上涨 21%。相较于大小盘的分化，成长价值风格分化更加显著，科创 50 和创业板指分别上涨 64.3% 和 35.5%，红利指数则下跌 -8.7%。30 个中信一级行业中，仅 5 个行业涨幅超过沪深 300，主要以机构投资者偏好的 TMT、制造为代表的新兴产业为主，因此基金整体表现相对较好，消费、周期、金融等传统板块则持续承压。从 PMI 分项数据来看：新兴赛道与传统周期行业景气分化，龙头企业与小微企业经营分化，与前述行业、大小盘分化亦相互呼应。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 20.57%，业绩比较基准收益率为 11.34%，高于业绩比较基准 9.23%；本基金 C 类净值增长率为 20.29%，业绩比较基准收益率为 11.34%，高于业绩比较基准 8.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面来看，PMI 整体处于扩张区间。本轮景气回暖主要依赖外需出口、基建投资、高端制造三大主线，居民消费和民间制造企业投资等内生增长动能修复偏慢，地产投资仍处负增长区间，

中小企业盈利改善空间有限。受油价和有色价格影响，PPI 上行较多。PMI 和 PPI 共同印证本轮结构性行情以基本面驱动为主，二季度经济数据较一季度虽有走弱，但 6 月数据仍然偏强，显示经济仍然处于企稳状态。

海外方面，美国 5 月 CPI 录得 4.2%，虽然创下近三年新高点，但是去除能源食品后核心 CPI 同比 2.9% 仍然较为温和，且伴随油价迅速下跌，抗通胀难度短期下行，然而通胀中长期矛盾从能源中枢上移转变成 AI 推动消费电子成本上升。美国通胀高企的背景成为近期有色板块压制的核心因素，美联储新主席决心抗通胀的态度，导致“美元强、加息上”的反转情形。科技方面，AIDC 的快速发展仍未见顶，中美大厂均在资本开支上持续投入当中，上游基础化工以及工业金属等需求仍在扩张区间内。当下关注美联储新主席的抗通胀节奏，预计除油价外，受 AI 推动成本上升等影响大概会有进一步上升的趋势。因此，若美联储年内加息一次或更多，对当前估值较高板块会带来较大承压，对于科技、有色、黄金等均会产生不同程度的影响，不确定性会有所上升。假如流动性充裕，叠加云厂商的资本开支力度依然较大，AI 产业链自上而下利润水平可能会进一步抬升，盈利增速的预期下对于科技板块的表现或有所支撑。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），估值委员会委员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责召集估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由指定的副主任代理其行使召集职责。

2. 运营部

① 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

② 征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

③ 根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后，对相应产品进行估值。

④负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告，协调相关部门对外发布公告，并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

⑤负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

4. 合规法务部、风险管理部

在日常合规监控及风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会召集估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依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本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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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：东方中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	63,159,001.48	28,904,201.33
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,686,223,531.29	775,723,352.16
其中：股票投资		2,538,840,474.50	732,866,468.32
基金投资		-	-
债券投资		147,383,056.79	42,856,883.84
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		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		42,583,165.55	14,505,190.61

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,791,965,698.32	819,132,744.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		43,712,323.92	32,542,432.43
应付管理人报酬		1,782,708.68	599,133.15
应付托管费		334,257.88	112,337.48
应付销售服务费		1,003,374.91	342,570.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,025.98	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	84,166.25	105,618.65
负债合计		46,921,857.62	33,702,091.79
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	1,844,341,444.47	634,921,151.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	900,702,396.23	150,509,500.59
净资产合计		2,745,043,840.70	785,430,652.31
负债和净资产总计		2,791,965,698.32	819,132,744.10

注：①报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,844,341,444.47 份，其中东方中证 A500 指数增强型 A 基金份额净值 1.4956 元，份额总额 181,270,935.22 份；其中东方中证 A500 指数增强型 C 基金份额净值 1.4876 元，份额总额 1,663,070,509.25 份。

②本基金基金合同于 2025 年 6 月 4 日生效，上年度可比期间为 2025 年 6 月 4 日至 2025 年 6 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：东方中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 4 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
-----	-----	--	--

一、营业总收入		497,845,849.77	769,922.09
1. 利息收入		136,834.27	184,028.42
其中：存款利息收入	6.4.7.10	136,834.27	58,530.48
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		-	125,497.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		260,156,868.24	139,605.43
其中：股票投资收益	6.4.7.11	239,585,237.77	-10,049.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,037,078.45	58,182.29
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	19,534,552.02	91,473.10
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）	6.4.7.17	235,433,436.53	446,288.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,118,710.73	-
减：二、营业总支出		20,170,212.28	473,961.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,394,210.24	257,899.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,136,414.41	48,356.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,558,995.02	153,870.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		555.67	-
其中：卖出回购金融资产支出		555.67	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		2,746.13	-
8. 其他费用	6.4.7.20	77,290.81	13,836.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		477,675,637.49	295,960.46
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		477,675,637.49	295,960.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		477,675,637.49	295,960.46

6.3 净资产变动表

会计主体：东方中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	634,921,151.72	-	150,509,500.59	785,430,652.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	634,921,151.72	-	150,509,500.59	785,430,652.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,209,420,292.75	-	750,192,895.64	1,959,613,188.39
(一)、综合收益总额	-	-	477,675,637.49	477,675,637.49
(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)	1,209,420,292.75	-	272,517,258.15	1,481,937,550.90
其中：1. 基金申购款	5,371,014,062.12	-	1,741,632,191.30	7,112,646,253.42
2. 基金赎回款	-4,161,593,769.37	-	-1,469,114,933.15	-5,630,708,702.52
(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)	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,844,341,444.47	-	900,702,396.23	2,745,043,840.70
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	452,647,351.60	-	-	452,647,351.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	295,960.46	295,960.46
(一)、综合收益总额	-	-	295,960.46	295,960.46
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	452,647,351.60	-	295,960.46	452,943,312.06

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：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>王丹丹</u>
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

东方中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2025 年 2 月 10 日中国证监会《关于准予东方中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2025]266 号）和《关于东方中证 A500 指数增强型证券投资基金备案确认的函》（基金成立备案函[2025]522 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》自 2025 年 5 月 19 日至 2025 年 5 月 30 日公开募集设立。本基金为股票型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 452,531,180.94 元人民币，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)“毕马威华振验字第 2500441 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 452,647,351.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 116,170.66 份基金份额。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同）、其他非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、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相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金

基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、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[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有

关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司

提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	34,660,876.59
等于：本金	34,648,706.44
加：应计利息	12,170.15
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	28,498,124.89
等于：本金	28,496,967.98
加：应计利息	1,156.91
减：坏账准备	—
合计	63,159,001.48

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2, 257, 517, 480. 54	-	2, 538, 840, 474. 50	281, 322, 993. 96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	146, 246, 016. 93	1, 179, 772. 79	147, 383, 056. 79	-42, 732. 93
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	146, 246, 016. 93	1, 179, 772. 79	147, 383, 056. 79	-42, 732. 93
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2, 403, 763, 497. 47	1, 179, 772. 79	2, 686, 223, 531. 29	281, 280, 261. 03

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

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

本基金本报告期末未持有通过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

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,041.34
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	76,863.46
其他应付款	261.45
合计	84,166.25

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方中证 A500 指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,380,563.59	57,380,563.59
本期申购	321,572,975.80	321,572,975.80
本期赎回（以“-”号填列）	-197,682,604.17	-197,682,604.17
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	181,270,935.22	181,270,935.22

东方中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	577,540,588.13	577,540,588.13
本期申购	5,049,441,086.32	5,049,441,086.32
本期赎回（以“-”号填列）	-3,963,911,165.20	-3,963,911,165.20
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	1,663,070,509.25	1,663,070,509.25

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,077,873.77	8,715,091.53	13,792,965.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,077,873.77	8,715,091.53	13,792,965.30
本期利润	22,089,155.56	20,575,542.23	42,664,697.79

本期基金份额交易产生的变动数	10,566,117.94	22,820,746.98	33,386,864.92
其中：基金申购款	37,704,216.71	69,897,886.37	107,602,103.08
基金赎回款	-27,138,098.77	-47,077,139.39	-74,215,238.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,733,147.27	52,111,380.74	89,844,528.01

东方中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,118,783.99	87,597,751.30	136,716,535.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	49,118,783.99	87,597,751.30	136,716,535.29
本期利润	220,153,045.40	214,857,894.30	435,010,939.70
本期基金份额交易产生的变动数	64,789,048.11	174,341,345.12	239,130,393.23
其中：基金申购款	539,863,320.58	1,094,166,767.64	1,634,030,088.22
基金赎回款	-475,074,272.47	-919,825,422.52	-1,394,899,694.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	334,060,877.50	476,796,990.72	810,857,868.22

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	125,035.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,798.49
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	136,834.27

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	239,585,237.77
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	239,585,237.77

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,874,121,905.96
减：卖出股票成本总额	2,630,906,888.42
减：交易费用	3,629,779.77
买卖股票差价收入	239,585,237.77

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,024,175.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,902.82
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,037,078.45

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	99,719,734.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	98,850,102.50
减：应计利息总额	853,699.22
减：交易费用	3,029.68
买卖债券差价收入	12,902.82

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,534,552.02
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	19,534,552.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	235,433,436.53
股票投资	235,496,484.03
债券投资	-63,047.50
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	235,433,436.53

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,112,788.42
基金转换费收入	5,922.31
合计	2,118,710.73

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	427.35
合计	77,290.81

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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内不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。

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
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
兴业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，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

本基金本报告期及上年度可比期间，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

本基金本报告期及上年度可比期间，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

本基金本报告期及上年度可比期间，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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,394,210.24	257,899.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,671,057.41	127,364.81
应支付基金管理人的净管理费	5,723,152.83	130,534.62

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,136,414.41	48,356.14

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C	合计
兴业银行股份有限公司	-	6,435,395.04	6,435,395.04
东方基金管理股份有限公司	-	66.60	66.60
合计	-	6,435,461.64	6,435,461.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C	合计
合计	-	-	-

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

②本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 6 月 4 日）持有的基金份额	0.00	—
报告期初持有的基金份额	9,571,423.59	—
报告期间申购/买入总份额	0.00	—
报告期间因拆分变动份额	0.00	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额	9,571,423.59	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.28%	—
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 6 月 4 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
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	—	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—

注：①基金管理人投资本基金时按照基金合同、招募说明书及相关公告约定的费率标准支付相应的手续费。

②报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总

额计算。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年6月4日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	34,660,876.59	125,035.78	132,701,414.39	54,462.79

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.77	57	1,596.00	1,582.89	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华	2026	1 个月	新	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-

	润 新 能 源	年 6 月 24 日	内(含)	股 流 通 受 限						
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.82	25.28	1,743	13,630.26	44,063.04	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	18.38	18.20	134	2,462.92	2,438.80	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	27.19	36.79	719	19,549.61	26,452.01	-
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.38	48.48	387	11,757.06	18,761.76	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.12	35.24	6,488	65,658.56	228,637.12	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	63.44	138	3,679.08	8,754.72	-
301531	春 光 集	2026 年 4 月 28	6 个月	新 股 流	13.30	66.90	290	3,857.00	19,401.00	-

	团	日		通 受 限						
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	13.91	40.66	433	6,023.03	17,605.78	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	37.52	546	3,865.68	20,485.92	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.13	117	6,786.00	13,119.21	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	69.66	159.94	714	49,737.24	114,197.16	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	78.38	129.27	96	7,524.48	12,409.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	21.93	76.74	195	4,276.35	14,964.30	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受	24.68	104.80	216	5,330.88	22,636.80	-

				限						
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.57	775	8,664.50	13,616.75	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	38.45	72	2,411.28	2,768.40	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.50	112	2,450.56	2,856.00	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	99.76	330	5,841.00	32,920.80	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.90	234	4,099.68	8,400.60	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.60	217	4,921.56	10,329.20	-
688797	臻	2026	6 个月	新	44.56	642.06	207	9,223.92	132,906.42	-

	宝科技	年 6 月 16 日		股流通受限						
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	2,086.66	163	13,346.44	340,125.58	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	27.75	834	5,345.94	23,143.50	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	182.77	234	6,149.52	42,768.18	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.08	177	9,903.15	10,103.16	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.09	1,717	16,259.99	120,344.53	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	170.81	2,391	47,054.88	408,406.71	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代	股	停牌	停	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备
-----	---	----	---	----	----	----	----	----	----	---

码	票 名 称	日期	牌 原 因	估值单 价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值总额	注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	45,565	15,303,093.71	40,075,784.45	-

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风控部门组成的风险管理组织体系，对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人严密监控基金申购赎回情况，预留充足可用现金头寸与之相匹配。本基金所持资产大部分可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本报告（期末本基金持有的流通受限证券）的列示。此外，本基金亦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。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求、计算并预留最优现金头寸；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市

场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	63,159,001.48	-	-	-	63,159,001.48
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-2,538,840,474.50	2,538,840,474.50
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	147,383,056.79	-	-	-	147,383,056.79
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	42,583,165.55	42,583,165.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	210,542,058.27	-	-	-2,581,423,640.05	2,791,965,698.32
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	43,712,323.92	43,712,323.92
应付管理人报酬	-	-	-	1,782,708.68	1,782,708.68
应付托管费	-	-	-	334,257.88	334,257.88
应付销售服务费	-	-	-	1,003,374.91	1,003,374.91
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,025.98	5,025.98

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	84,166.25	84,166.25
负债总计	-	-	-	46,921,857.62	46,921,857.62
利率敏感度缺口	210,542,058.27	-	-	-2,534,501,782.43	2,745,043,840.70
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,904,201.33	-	-	-	28,904,201.33
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	732,866,468.32	732,866,468.32
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	42,856,883.84	-	-	-	42,856,883.84
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,505,190.61	14,505,190.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	71,761,085.17	-	-	747,371,658.93	819,132,744.10
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	32,542,432.43	32,542,432.43
应付管理人报酬	-	-	-	599,133.15	599,133.15
应付托管费	-	-	-	112,337.48	112,337.48
应付销售服务费	-	-	-	342,570.08	342,570.08
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,618.65	105,618.65
负债总计	-	-	-	33,702,091.79	33,702,091.79
利率敏感度缺口	71,761,085.17	-	-	713,669,567.14	785,430,652.31

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

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-147,130.86	-60,610.35
	市场利率下调 0.25%	147,130.86	60,610.35

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。本基金可投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00
资产合计	0.00	0.00	0.00	0.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	0.00	0.00	0.00	0.00

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00
资产合计	0.00	0.00	0.00	0.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	0.00	0.00	0.00	0.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	0.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	0.00

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格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。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025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	2,538,840,474.50	92.49	732,866,468.32	93.31
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	147,383,056.79	5.37	42,856,883.84	5.46
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	2,686,223,531.29	97.86	775,723,352.16	98.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到,对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票,默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%,其他市场变量均不发生变化,计算本基金资产净值变动		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	165,236,772.99	46,933,405.04
	沪深 300 指数下跌 5%	-165,236,772.99	-46,933,405.04

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,496,198,594.79	732,333,466.20
第二层次	188,309,132.68	42,856,883.84
第三层次	1,715,803.82	533,002.12
合计	2,686,223,531.29	775,723,352.16

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证券，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证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，确定相关证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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至中期报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	2,538,840,474.50	90.93
	其中：股票	2,538,840,474.50	90.93

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	147,383,056.79	5.28
	其中：债券	147,383,056.79	5.28
	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	63,159,001.48	2.26
8	其他各项资产	42,583,165.55	1.53
9	合计	2,791,965,698.32	100.00

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	-	-
B	采矿业	101,035,247.00	3.68
C	制造业	1,624,482,984.22	59.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,734,134.00	0.94
E	建筑业	7,945,378.00	0.29
F	批发和零售业	82,399,651.00	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	47,480,905.00	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,228,459.02	3.36
J	金融业	216,182,920.00	7.88
K	房地产业	3,312,080.00	0.12
L	租赁和商务服务业	3,763,264.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	82,956,574.00	3.02
N	水利、环境和公共设施管理业	14,808,628.80	0.54
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	-	-
S	综合	-	-

	合计	2,302,330,225.04	83.87
--	----	------------------	-------

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	8,902,158.04	0.32
C	制造业	130,238,822.45	4.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	22,183,980.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,582.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,176,610.46	1.39
J	金融业	21,870,754.20	0.80
K	房地产业	9,727,536.00	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,558,513.98	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	236,510,249.46	8.62

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	300308	中际旭创	112,900	143,383,000.00	5.22
2	300750	宁德时代	241,900	95,069,119.00	3.46
3	300502	新易盛	136,780	83,025,460.00	3.02

4	603986	兆易创新	98,100	79,951,500.00	2.91
5	603259	药明康德	498,600	62,080,686.00	2.26
6	300604	长川科技	173,200	59,133,944.00	2.15
7	601211	国泰海通	2,935,100	53,418,820.00	1.95
8	600519	贵州茅台	41,500	49,197,835.00	1.79
9	688256	寒武纪	29,129	46,476,775.95	1.69
10	000792	盐湖股份	1,471,300	44,418,547.00	1.62
11	688578	艾力斯	391,817	42,786,416.40	1.56
12	688072	拓荆科技	45,565	40,075,784.45	1.46
13	300475	香农芯创	128,000	38,400,000.00	1.40
14	002414	高德红外	2,863,800	37,973,988.00	1.38
15	688002	睿创微纳	244,455	37,814,743.95	1.38
16	300033	同花顺	140,720	33,913,520.00	1.24
17	601899	紫金矿业	1,320,800	33,204,912.00	1.21
18	601225	陕西煤业	1,620,000	32,967,000.00	1.20
19	301358	湖南裕能	431,700	32,753,079.00	1.19
20	300394	天孚通信	107,780	32,622,850.40	1.19
21	000519	中兵红箭	1,510,500	31,826,235.00	1.16
22	688525	佰维存储	60,640	30,000,427.20	1.09
23	300857	协创数据	88,000	29,911,200.00	1.09
24	300972	万辰集团	170,200	29,514,382.00	1.08
25	002709	天赐材料	570,900	29,361,387.00	1.07
26	300438	鹏辉能源	350,329	29,024,757.65	1.06
27	600150	中国船舶	853,700	28,846,523.00	1.05
28	002463	沪电股份	188,400	28,787,520.00	1.05
29	002384	东山精密	108,370	28,430,869.50	1.04
30	688041	海光信息	72,933	27,007,089.90	0.98
31	600036	招商银行	755,800	26,830,900.00	0.98
32	301308	江波龙	38,000	26,744,400.00	0.97
33	002001	新 和 成	935,000	26,572,700.00	0.97
34	002460	赣锋锂业	405,700	26,532,780.00	0.97
35	002475	立讯精密	368,700	25,956,480.00	0.95
36	600900	长江电力	972,200	25,734,134.00	0.94
37	002466	天齐锂业	410,100	25,147,332.00	0.92
38	601233	桐昆股份	1,028,100	22,258,365.00	0.81
39	601328	交通银行	3,447,100	22,164,853.00	0.81
40	002028	思源电气	125,700	21,746,100.00	0.79
41	601919	中远海控	1,634,500	21,673,470.00	0.79
42	600522	中天科技	354,600	21,517,128.00	0.78
43	300759	康龙化成	721,600	20,875,888.00	0.76
44	688266	泽璟制药	171,750	20,036,355.00	0.73
45	000938	紫光股份	693,200	20,005,752.00	0.73
46	002202	金风科技	817,000	19,526,300.00	0.71

47	000408	藏格矿业	281,600	19,520,512.00	0.71
48	002595	豪迈科技	412,615	19,227,859.00	0.70
49	002558	巨人网络	665,600	18,343,936.00	0.67
50	600000	浦发银行	2,081,800	17,924,298.00	0.65
51	600166	福田汽车	5,977,600	17,394,816.00	0.63
52	600030	中信证券	604,200	17,358,666.00	0.63
53	002821	凯莱英	100,600	16,297,200.00	0.59
54	600499	科达制造	1,102,100	15,208,980.00	0.55
55	000657	中钨高新	156,200	14,951,464.00	0.54
56	600323	瀚蓝环境	539,280	14,808,628.80	0.54
57	600183	生益科技	85,100	14,756,340.00	0.54
58	601872	招商轮船	822,300	14,447,811.00	0.53
59	688213	思特威	131,301	14,058,398.07	0.51
60	600741	华域汽车	898,700	13,947,824.00	0.51
61	300432	富临精工	690,400	13,870,136.00	0.51
62	300442	润泽科技	160,700	13,349,349.00	0.49
63	002812	恩捷股份	196,000	13,114,360.00	0.48
64	605117	德业股份	118,760	12,609,936.80	0.46
65	300408	三环集团	73,900	12,333,910.00	0.45
66	002091	江苏国泰	1,690,300	12,220,869.00	0.45
67	000338	潍柴动力	443,700	12,090,825.00	0.44
68	000333	美的集团	155,300	11,729,809.00	0.43
69	601398	工商银行	1,629,500	11,520,565.00	0.42
70	600018	上港集团	2,406,700	11,359,624.00	0.41
71	002916	深南电路	24,800	11,355,920.00	0.41
72	300223	北京君正	45,300	11,275,170.00	0.41
73	000975	山金国际	627,188	10,662,196.00	0.39
74	601601	中国太保	336,000	9,582,720.00	0.35
75	000651	格力电器	253,300	9,498,750.00	0.35
76	601288	农业银行	1,513,700	9,188,159.00	0.33
77	603659	璞泰来	311,900	9,023,267.00	0.33
78	002493	荣盛石化	778,600	8,369,950.00	0.30
79	688390	固德威	67,038	7,274,293.38	0.26
80	601318	中国平安	149,600	7,141,904.00	0.26
81	000001	平安银行	710,300	7,138,515.00	0.26
82	000426	兴业银锡	201,400	6,638,144.00	0.24
83	300476	胜宏科技	18,900	6,547,527.00	0.24
84	600487	亨通光电	56,600	6,188,644.00	0.23
85	605499	东鹏饮料	47,330	5,841,941.90	0.21
86	600176	中国巨石	74,500	5,429,560.00	0.20
87	601117	中国化学	731,600	5,377,260.00	0.20
88	688498	源杰科技	2,700	5,092,200.00	0.19
89	600489	中金黄金	271,700	4,904,185.00	0.18

90	000301	东方盛虹	418,300	4,789,535.00	0.17
91	600089	特变电工	210,300	4,731,750.00	0.17
92	002155	湖南黄金	195,800	4,673,746.00	0.17
93	300073	当升科技	84,800	4,073,792.00	0.15
94	601088	中国神华	103,300	4,032,832.00	0.15
95	600415	小商品城	370,400	3,763,264.00	0.14
96	002074	国轩高科	130,900	3,601,059.00	0.13
97	688063	派能科技	66,597	3,547,622.19	0.13
98	002244	滨江集团	435,800	3,312,080.00	0.12
99	002008	大族激光	20,200	3,032,222.00	0.11
100	600988	赤峰黄金	109,100	2,871,512.00	0.10
101	300014	亿纬锂能	34,900	2,269,547.00	0.08
102	000034	神州数码	81,600	2,264,400.00	0.08
103	002185	华天科技	100,400	2,239,924.00	0.08
104	002353	杰瑞股份	12,800	1,952,000.00	0.07
105	601668	中国建筑	370,700	1,608,838.00	0.06
106	600887	伊利股份	53,400	1,279,464.00	0.05
107	002078	太阳纸业	92,300	1,152,827.00	0.04
108	601800	中国交建	168,000	959,280.00	0.03
109	600938	中国海油	29,600	803,640.00	0.03
110	600362	江西铜业	15,300	662,490.00	0.02
111	688012	中微公司	961	450,228.50	0.02
112	002130	沃尔核材	16,000	303,360.00	0.01
113	600547	山东黄金	12,000	277,080.00	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	603444	吉比特	91,079	32,644,535.18	1.19
2	001309	德明利	25,100	23,666,790.00	0.86
3	600710	苏美达	2,320,500	22,183,980.00	0.81
4	688127	蓝特光学	180,262	17,593,571.20	0.64
5	300681	英搏尔	546,200	15,632,244.00	0.57
6	601963	重庆银行	1,466,000	14,777,280.00	0.54
7	688535	华海诚科	70,283	13,142,921.00	0.48
8	603061	金海通	24,900	12,505,278.00	0.46
9	688183	生益电子	90,978	12,045,487.20	0.44
10	688519	南亚新材	30,543	11,607,561.72	0.42
11	001914	招商积余	1,192,100	9,727,536.00	0.35
12	002653	海思科	128,800	8,544,592.00	0.31
13	601128	常熟银行	1,218,810	7,093,474.20	0.26
14	301606	绿联科技	92,000	5,613,840.00	0.20
15	600546	山煤国际	486,100	5,313,073.00	0.19
16	001389	广合科技	19,500	4,626,375.00	0.17

17	688372	伟测科技	24,495	4,556,070.00	0.17
18	001337	四川黄金	96,700	3,545,022.00	0.13
19	002701	奥瑞金	802,000	3,416,520.00	0.12
20	600728	佳都科技	799,800	3,407,148.00	0.12
21	688368	晶丰明源	9,814	2,124,927.28	0.08
22	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
23	688820	盛合晶微	2,391	408,406.71	0.01
24	688808	联讯仪器	163	340,125.58	0.01
25	001399	惠科股份	6,488	228,637.12	0.01
26	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
27	688797	臻宝科技	207	132,906.42	0.00
28	688818	电科蓝天	1,717	120,344.53	0.00
29	301682	宏明电子	714	114,197.16	0.00
30	001257	盛龙股份	1,743	44,063.04	0.00
31	688813	泰金新能	234	42,768.18	0.00
32	603459	红板科技	330	32,920.80	0.00
33	001365	天海电子	719	26,452.01	0.00
34	688811	有研复材	834	23,143.50	0.00
35	301696	三瑞智能	216	22,636.80	0.00
36	301669	高特电子	546	20,485.92	0.00
37	301531	春光集团	290	19,401.00	0.00
38	001393	维通利	387	18,761.76	0.00
39	301599	理奇智能	433	17,605.78	0.00
40	301687	新广益	195	14,964.30	0.00
41	601112	振石股份	775	13,616.75	0.00
42	301680	固德电材	117	13,119.21	0.00
43	301683	慧谷新材	96	12,409.92	0.00
44	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
45	688781	视涯科技	217	10,329.20	0.00
46	688816	易思维	177	10,103.16	0.00
47	301513	尚水智能	138	8,754.72	0.00
48	688712	北芯生命	234	8,400.60	0.00
49	603352	至信股份	112	2,856.00	0.00
50	603293	埃泰克	72	2,768.40	0.00
51	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
52	001312	福恩股份	134	2,438.80	0.00
53	603284	林平发展	46	1,603.56	0.00
54	001220	世盟股份	57	1,582.89	0.00

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	300308	中际旭创	131,558,401.00	16.75
2	300750	宁德时代	93,584,056.60	11.91
3	300502	新易盛	72,348,971.00	9.21
4	688411	海博思创	69,908,169.51	8.90
5	600519	贵州茅台	66,751,667.92	8.50
6	301308	江波龙	65,411,647.78	8.33
7	603259	药明康德	64,529,799.85	8.22
8	601628	中国人寿	61,615,847.84	7.84
9	601899	紫金矿业	61,179,124.00	7.79
10	300604	长川科技	60,097,618.36	7.65
11	601211	国泰海通	60,003,246.78	7.64
12	300394	天孚通信	58,916,372.99	7.50
13	603444	吉比特	58,100,551.10	7.40
14	300476	胜宏科技	57,195,277.00	7.28
15	000792	盐湖股份	54,999,454.55	7.00
16	002709	天赐材料	53,925,334.00	6.87
17	002414	高德红外	46,977,673.80	5.98
18	002028	思源电气	46,643,324.00	5.94
19	300972	万辰集团	46,240,813.87	5.89
20	601100	恒立液压	46,199,237.71	5.88
21	002463	沪电股份	45,914,100.56	5.85
22	603379	三美股份	45,416,477.00	5.78
23	601233	桐昆股份	44,074,779.00	5.61
24	603986	兆易创新	43,680,686.00	5.56
25	002371	北方华创	43,656,468.70	5.56
26	600150	中国船舶	43,514,114.64	5.54
27	601225	陕西煤业	42,743,446.00	5.44
28	300438	鹏辉能源	41,271,355.77	5.25
29	601336	新华保险	40,929,375.85	5.21
30	603993	洛阳钼业	40,695,740.91	5.18
31	688256	寒武纪	39,358,174.25	5.01
32	600089	特变电工	39,290,216.00	5.00
33	002353	杰瑞股份	38,892,796.00	4.95
34	688183	生益电子	38,824,702.04	4.94
35	300274	阳光电源	38,007,727.00	4.84
36	301358	湖南裕能	37,890,943.37	4.82
37	688578	艾力斯	37,657,542.05	4.79
38	601319	中国人保	37,483,304.00	4.77
39	688072	拓荆科技	37,206,613.84	4.74
40	002074	国轩高科	35,879,115.00	4.57
41	601021	春秋航空	35,728,864.25	4.55
42	300033	同花顺	35,505,305.00	4.52
43	688002	睿创微纳	34,926,162.76	4.45

44	002001	新 和 成	33,991,013.40	4.33
45	600030	中信证券	33,815,508.75	4.31
46	300759	康龙化成	33,587,966.26	4.28
47	605499	东鹏饮料	33,106,756.80	4.22
48	002595	豪迈科技	31,296,302.58	3.98
49	300475	香农芯创	30,789,998.00	3.92
50	002460	赣锋锂业	30,270,957.00	3.85
51	600036	招商银行	29,798,128.75	3.79
52	600710	苏美达	29,628,263.00	3.77
53	000519	中兵红箭	29,563,746.00	3.76
54	003816	中国广核	29,414,152.00	3.74
55	000960	锡业股份	29,377,864.29	3.74
56	000975	山金国际	29,196,619.56	3.72
57	688012	中微公司	29,175,216.73	3.71
58	002466	天齐锂业	29,021,348.64	3.69
59	600988	赤峰黄金	28,993,237.00	3.69
60	600900	长江电力	28,563,497.00	3.64
61	000157	中联重科	28,542,907.00	3.63
62	600487	亨通光电	26,761,476.60	3.41
63	688008	澜起科技	26,688,026.37	3.40
64	300857	协创数据	26,293,978.55	3.35
65	002384	东山精密	25,964,217.92	3.31
66	000426	兴业银锡	24,310,716.00	3.10
67	600183	生益科技	23,559,662.12	3.00
68	600499	科达制造	23,477,286.00	2.99
69	688506	百利天恒	23,435,773.53	2.98
70	300223	北京君正	23,261,576.00	2.96
71	002558	巨人网络	23,190,610.00	2.95
72	688525	佰维存储	22,791,601.64	2.90
73	601919	中远海控	22,764,264.00	2.90
74	601318	中国平安	22,192,849.00	2.83
75	002624	完美世界	21,838,481.00	2.78
76	603799	华友钴业	21,612,988.00	2.75
77	601963	重庆银行	21,280,071.09	2.71
78	601877	正泰电器	21,066,647.14	2.68
79	688708	佳驰科技	21,061,554.90	2.68
80	002821	凯莱英	20,951,538.80	2.67
81	000938	紫光股份	20,305,656.10	2.59
82	600050	中国联通	20,298,914.00	2.58
83	300620	光库科技	20,045,099.00	2.55
84	300681	英搏尔	19,370,656.00	2.47
85	002475	立讯精密	19,325,678.00	2.46
86	600352	浙江龙盛	19,246,171.00	2.45

87	688266	泽璟制药	18,606,074.48	2.37
88	600522	中天科技	18,316,642.00	2.33
89	600584	长电科技	17,620,141.00	2.24
90	600276	恒瑞医药	17,545,367.87	2.23
91	688127	蓝特光学	17,281,093.70	2.20
92	601328	交通银行	16,934,537.00	2.16
93	001309	德明利	16,925,483.00	2.15
94	600000	浦发银行	16,497,716.72	2.10

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300308	中际旭创	114,340,340.00	14.56
2	301308	江波龙	75,071,562.20	9.56
3	688411	海博思创	71,308,758.32	9.08
4	300476	胜宏科技	63,391,726.44	8.07
5	300502	新易盛	63,226,723.05	8.05
6	002463	沪电股份	53,654,907.00	6.83
7	600183	生益科技	51,305,961.93	6.53
8	600487	亨通光电	51,126,623.00	6.51
9	601628	中国人寿	50,020,297.75	6.37
10	603379	三美股份	49,234,793.00	6.27
11	300604	长川科技	49,094,400.32	6.25
12	002371	北方华创	45,740,799.00	5.82
13	300750	宁德时代	42,201,018.94	5.37
14	601100	恒立液压	41,681,045.80	5.31
15	688072	拓荆科技	41,311,510.89	5.26
16	300394	天孚通信	40,848,719.00	5.20
17	601336	新华保险	39,929,782.00	5.08
18	300274	阳光电源	38,657,158.04	4.92
19	688183	生益电子	38,359,639.95	4.88
20	300438	鹏辉能源	37,528,308.11	4.78
21	601319	中国人保	37,062,194.00	4.72
22	002709	天赐材料	35,911,544.79	4.57
23	603993	洛阳钼业	34,790,900.00	4.43
24	600089	特变电工	34,346,786.50	4.37
25	603256	宏和科技	34,087,135.00	4.34
26	688008	澜起科技	33,855,421.48	4.31
27	002353	杰瑞股份	33,673,177.00	4.29
28	601233	桐昆股份	32,219,916.00	4.10

29	002074	国轩高科	31,215,042.00	3.97
30	003816	中国广核	31,071,327.00	3.96
31	600988	赤峰黄金	30,372,755.00	3.87
32	002624	完美世界	30,017,964.00	3.82
33	601021	春秋航空	28,943,034.42	3.68
34	000878	云南铜业	28,712,476.71	3.66
35	002028	思源电气	28,410,339.00	3.62
36	600030	中信证券	28,082,504.65	3.58
37	605499	东鹏饮料	27,264,251.10	3.47
38	603986	兆易创新	27,234,719.77	3.47
39	000960	锡业股份	27,171,696.00	3.46
40	601318	中国平安	26,768,895.00	3.41
41	688012	中微公司	25,868,406.07	3.29
42	300567	精测电子	25,611,150.00	3.26
43	600460	士兰微	24,846,343.00	3.16
44	603259	药明康德	24,595,286.60	3.13
45	300620	光库科技	24,273,178.00	3.09
46	688256	寒武纪	23,428,048.52	2.98
47	000157	中联重科	23,227,431.50	2.96
48	000975	山金国际	23,087,348.00	2.94
49	688506	百利天恒	22,130,832.13	2.82
50	600276	恒瑞医药	21,302,863.83	2.71
51	603799	华友钴业	20,932,463.77	2.67
52	300972	万辰集团	20,871,607.00	2.66
53	002001	新 和 成	20,858,381.80	2.66
54	601899	紫金矿业	20,590,775.90	2.62
55	600011	华能国际	20,357,739.00	2.59
56	600519	贵州茅台	20,093,759.00	2.56
57	601168	西部矿业	19,550,056.00	2.49
58	300433	蓝思科技	19,187,430.00	2.44
59	601877	正泰电器	18,970,230.53	2.42
60	600584	长电科技	18,227,477.00	2.32
61	600036	招商银行	18,222,650.80	2.32
62	688981	中芯国际	17,901,425.65	2.28
63	300223	君正股份	17,593,089.00	2.24
64	603444	吉比特	16,995,646.00	2.16
65	002821	凯莱英	16,848,906.40	2.15
66	688708	佳驰科技	16,781,260.70	2.14
67	300251	光线传媒	16,760,252.00	2.13
68	600050	中国联通	16,687,683.00	2.12
69	600482	中国动力	16,613,049.00	2.12
70	002938	鹏鼎控股	16,416,021.00	2.09
71	603129	春风动力	15,936,889.00	2.03

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	4,201,384,410.57
卖出股票收入（成交）总额	2,874,121,905.96

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	147,383,056.79	5.37
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	147,383,056.79	5.37

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	955,200	96,522,227.25	3.52
2	019827	26 国债 01	240,000	24,155,566.03	0.88
3	019835	26 国债 09	210,000	21,034,560.82	0.77
4	019785	25 国债 13	56,000	5,670,702.69	0.21

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金所持有的国泰海通(601211.SH)总部、部分分支机构与高管近一年内被中国证券监督管理委员会地方监管分局与深圳证券交易所多次处罚，主要违法违规事实涉及经纪业务违规、合规管理不到位等。

本基金所持有的贵州茅台(600519.SH)高管近一年内被遵义市监察委员会实施留置，主要违法违规事实涉及未依法履行其他职责。

以上事项不会对该公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告或者量化投资策略，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、合规法务部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资上述公司主要基于以下原因：本基金基于基本面进行选股，选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,583,165.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,583,165.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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（%）
东方中证 A500 指数增强 A	2,787	65,041.60	9,571,423.59	5.28	171,699,511.63	94.72

东方中证 A500 指数增强 C	16,826	98,839.33	12,380,493.84	0.74	1,650,690,015.41	99.26
合计	19,613	94,036.68	21,951,917.43	1.19	1,822,389,527.04	98.81

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	东方中证 A500 指数增强 A	68,714.48	0.04
	东方中证 A500 指数增强 C	63,192.39	0.00
	合计	131,906.87	0.01

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	东方中证 A500 指数增强 A	0~10
	东方中证 A500 指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东方中证 A500 指数增强 A	0
	东方中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方中证 A500 指数增强 A	东方中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 6 月 4 日） 基金份额总额	20,544,598.43	432,102,753.17
本报告期期初基金份额总额	57,380,563.59	577,540,588.13
本报告期基金总申购份额	321,572,975.80	5,049,441,086.32
减：本报告期基金总赎回份额	197,682,604.17	3,963,911,165.20
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	181,270,935.22	1,663,070,509.25

注：基金总申购份额包含红利再投资、基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2026 年 3 月 20 日，基金管理人发布了《东方基金管理股份有限公司关于董事长离任及代行董事长职务的公告》，自 2026 年 3 月 18 日起崔伟先生不再担任公司董事长，刘鸿鹏先生代任董事长。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

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

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	东方基金管理股份有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 16 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金运作管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并将相关落实情况报送北京证监局。
其他	—

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中泰证券股份有限公司	3	7,072,418,719.73	100.00	-	-	-

注：（1）本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

（2）本基金选择的证券经纪商为中泰证券股份有限公司，本基金管理人与其不存在关联方关系。

（3）证券经营机构的佣金费率如下：

中泰证券上海证券交易所 A 股股票、股票基金交易佣金率为 0.03%（包含经手费、证管费），可转换债券交易佣金率为 0.001%，其他债券交易佣金率为 0.001%；深圳交易所 A 股股票、股票基金交易佣金率为 0.03%（包含经手费、证管费、过户费），可转换债券交易佣金率为 0.005%，其他债券交易佣金率为 0.001%。港股通股票交易佣金率为 0.03%。

（4）证券经营机构的选择标准和程序

券商选择标准：①资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定合作对象：根据以上评价

结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
中泰证券股份有限公司	301,373,949.00	100.00	5,000,000.00	100.00	-	-

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	关于增加平安证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 13 日
2	关于增加平安证券股份有限公司等三家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 15 日
3	关于增加上海利得基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 16 日
4	东方中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
5	关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告	基金管理人网站	2026 年 1 月 23 日
6	关于增加东北证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 29 日
7	东方基金管理股份有限公司关于基金经理王芳玲休假期间由他人代为履职	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2026 年 2 月 25 日

	的公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 9 日
9	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 17 日
10	关于增加东莞证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 19 日
11	东方基金管理股份有限公司关于董事长离任及代行董事长职务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 20 日
12	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 21 日
13	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 21 日
14	关于增加招商银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 26 日
15	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 27 日
16	东方中证 A500 指数增强型证券投资	基金管理人网站及中国	2026 年 3 月 31 日

	基金 2025 年年度报告	证监会基金电子披露网站	
17	东方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
18	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 3 日
19	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下公募基金风险等级评估方式相关事项的公告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 17 日
20	关于增加华创证券有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 20 日
21	关于增加诺亚正行基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 20 日
22	2025 年度东方基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026 年 4 月 20 日
23	东方中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
24	关于增加招商证券股份有限公司等六家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 23 日
25	关于增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 27 日
26	东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 12 日

27	关于增加福克斯（北京）基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 21 日
28	东方基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 29 日
29	关于增加京东肯特瑞基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 22 日
30	关于增加上海陆享基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 25 日
31	东方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日
32	关于增加申万宏源证券有限公司等三家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 29 日
33	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 30 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2026 年 8 月 31 日