东方量化多策略混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025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: 中国农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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 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2025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 重要提示	
§ :	2	基金简介	5
4	2. 2. 2.	1 基金基本情况	5 5 6
§:	3	主要财务指标和基金净值表现	6
		1 主要会计数据和财务指标 2 基金净值表现	
§ 4	4	管理人报告	8
2	4. 4. 4. 4.	1 基金管理人及基金经理情况 2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 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	11 11 12 12 12
§ !	5	托管人报告	14
į	5.	1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
§ (6	半年度财务会计报告(未经审计)	14
(3. 3.	1 资产负债表	16 17
§′	7	投资组合报告	40
,	7. 7. 7.	1 期末基金资产组合情况	40 41 62 64
	٠.	~ /タッ/トオス苺/ロ/ 匝目全並火/ - 1 匝6/1////11//1 11 11 11 11 火////// 火//////////	JI

	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	64 64 65 65
§	基金份额持有人信息	65
	1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66 66
§	开放式基金份额变动	66
§)重大事件揭示	67
	 0.1 基金份额持有人大会决议 0.2 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 0.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 0.4 基金投资策略的改变 0.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 0.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 0.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 0.8 其他重大事件 	67 67 67 67 68
§	【影响投资者决策的其他重要信息	72
	1.1 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	. 72
§	2 备查文件目录	72
	2.1 备查文件目录 2.2 存放地点	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方量化多策略混合型证券投资基金				
基金简称	东方量化多策略混合				
基金主代码	006785	006785			
前端交易代码	006785				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2019年2月22日				
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	东方基金管理股份有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司				
报告期末基金份	35, 649, 807. 80 份				
额总额					
基金合同存续期 不定期					
下属分级基金的基	左六是 ル 夕笠吸泪入 A	左六是ルタ笠吸泪A C			
金简称	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C			
下属分级基金的交	006795	014794			
易代码	006785 014724				
报告期末下属分级	20 514 087 00 1	6 124 910 00 1/5			
基金的份额总额	29,514,987.90 份 6,134,819.90 份 基金的份额总额 6,134,819.90 份				

2.2 基金产品说明

// HH 60 /4	
投资目标	运用多种量化投资策略持续挖掘具有良好收益特征的投资标的,力
	争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金,其中股票资产占基金资产的比例为60%-95%。
	为更好地实现投资目标,在保持不低于60%的股票资产基础上有35%
	的大类资产配置空间,这部分资产称为"弹性配置资产",其配置的
	主要方向是股票、债券、现金类资产等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金
	和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品
	种。

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	中国农业银行股份有限公司		
信息披露	姓名	李景岩	任航		
日	联系电话	010-66295888	010-66060069		
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com		
客户服务电	1话	010-66578578 或 400-628-5888	95599		
传真		010-66578700	010-68121816		
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4	北京市东城区建国门内大街 69		
		层	号		
办公地址		北京市丰台区金泽路 161 号院 1	北京市西城区复兴门内大街 28		

	号楼远洋锐中心 26 层	号凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码	100073	100031	
法定代表人	崔伟	谷澍	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	http://www.orient-fund.com或
址	http://www.df5888.com
基金中期报告备置地点	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	报告期(2025年1月1日-2025年6月30日)				
据和指标	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C			
本期已实现收益	2, 878, 567. 22	92, 505. 91			
本期利润	2, 577, 371. 31	679, 337. 88			
加权平均基金份	0.0007	0.1100			
额本期利润	0. 0867	0. 1133			
本期加权平均净	11 170	14.700			
值利润率	11. 17%	14. 79%			
本期基金份额净	11 500	11. 57%			
值增长率	11. 58%				
3.1.2 期末数	担失期去 (2025	报告期末(2025年6月30日)			
据和指标	(2025 (2025	9 午 0 月 30 日)			
期末可供分配利 润	-5, 304, 390. 29	-2, 270, 818. 35			
期末可供分配基 金份额利润	-0.1797	-0.3702			
期末基金资产净 值	24, 210, 597. 61	5, 008, 813. 92			
期末基金份额净 值	0. 8203 0. 81				

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	-17. 97%	-17.11%

- 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

东方量化多策略混合	٨
朱 月 里 化 名 束 龄 很 合	Α

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	5. 18%	0.88%	5.20%	0.89%	-0.02%	-0.01%
过去三个月	3. 29%	1.40%	2.03%	1.73%	1. 26%	-0.33%
过去六个月	11. 58%	1. 39%	6. 44%	1. 56%	5. 14%	-0. 17%
过去一年	32. 39%	1. 76%	28.45%	1.87%	3. 94%	-0.11%
过去三年	-15. 86%	1. 37%	-8.95%	1. 44%	-6. 91%	-0.07%
自基金合同生效起 至今	-17. 97%	1. 36%	19. 54%	1. 27%	-37. 51%	0.09%

东方量化多策略混合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	5. 18%	0.88%	5. 20%	0.89%	-0.02%	-0.01%
过去三个月	3. 29%	1.40%	2.03%	1.73%	1. 26%	-0.33%
过去六个月	11. 57%	1. 38%	6. 44%	1.56%	5. 13%	-0.18%
过去一年	32. 42%	1. 76%	28. 45%	1.87%	3. 97%	-0.11%
过去三年	-16. 25%	1. 37%	-8.95%	1.44%	-7. 30%	-0.07%

自基金合同生效起						
至今	-17. 11%	1. 38%	-15.71%	1.44%	-1.40%	-0.06%

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

东方量化多策略混合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



东方量化多策略混合()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



§ 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 2025 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 2025 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、东方欣冉九个月持有期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、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、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)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

4. 1. 2	基金经埋_	(以基金经	<u>埋小狙)</u> が	基金金 25	里助埋简介
姓名	职务		任本基金的基金经理 (助理)期限		说明
		任职日期	离任日期	业年限	
盛泽	本金量部理配经募策委基经化总、置理投委员会部、资员	2019年2 月22日	_	10年	量化投资部总经理,资产配置部总经理、 公募投资决策委员会委员,华威大学经济 与国际金融经济学硕士,10 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,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,现任 东方岳灵活配置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、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方於冉九个月持有期 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 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	2022 年 5 月 17 日	_	10年	中国人民大学金融专业硕士,10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。

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管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方量化多策略混合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中的公平交易程序;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的同向交易价差、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,未直接或通过与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,本基金继续以小市值股票为主要投资方向,以中高频调仓的多因子选股策略为主要投资策略。

今年小市值表现较好,产品收益也受益于基准指数中证 1000 的良好表现。从超额收益来看,产品本期总体超额收益为正,虽然 4 月份市场风格受到外部冲击发生了短暂的反转,但也很快修复,最终对超额收益影响不大。

未来在产品的配置方向上,将延续一直以来的严格纪律,保持在各个行业上的均衡配置,在 风格上也仍将继续保持与指数的低偏离,谨慎暴露风格,控制好跟踪误差。在尽可能减少交易成 本和风险暴露的情况下,最大化利用好模型给出的信号进行选股。但也要警惕市场交易者在某些 风格(尤其是市值风格)上的过度拥挤带来的对风险,紧密跟踪,控制风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日,本基金 A 类净值增长率为 11.58%,业绩比较基准收益率为 6.44%,高于业绩比较基准 5.14%;本基金 C 类净值增长率为 11.57%,业绩比较基准收益率为 6.44%,高于业绩比较基准 5.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年,全球经济在复杂多变的环境中展现出一定的韧性。国内经济运行总体保持在合理区间,结构调整持续深化,新兴产业动能逐步释放。货币政策保持灵活适度,为市场流动性提供了相对充裕的环境。展望下半年,我们对宏观经济走势保持谨慎乐观态度。预期政策面将继续发挥积极作用,经济基本面有望进一步企稳向好。证券市场方面,随着改革红利的逐步显现和投资者信心的温和修复,市场或将呈现结构性机会。

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》、《资产管理产品相关会计处理规

定》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"),成 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,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形,本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。之后,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情形,持续期间为 2025 年 4 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日。

§ 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人一东方基金管理股份有限公司报告期内基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为,东方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:东方量化多策略混合型证券投资基金

报告截止日: 2025年6月30日

		I	单位:人民币元
资 产	 附注号	本期末	上年度末
	****	2025年6月30日	2024年12月31日
资产:			
货币资金	6. 4. 7. 1	755, 240. 50	1, 396, 901. 00
结算备付金		78, 904. 54	73, 681. 68
存出保证金		8, 925. 93	13, 145. 57
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	28, 421, 888. 84	21, 073, 485. 49
其中:股票投资		26, 814, 837. 00	19, 763, 733. 74
基金投资		-	_
债券投资		1, 607, 051. 84	1, 309, 751. 75
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		245, 248. 48	50, 332. 32
应收股利		-	-
应收申购款		1, 009. 71	0.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 6	_	_
资产总计		29, 511, 218. 00	22, 607, 547. 05
A	MINT I	本期末	上年度末
负债和净资产	附注号	2025年6月30日	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		-	600, 213. 50
应付清算款		235, 183. 94	55, 507. 90
应付赎回款		3, 712. 47	108.97
应付管理人报酬		18, 756. 43	15, 570. 06
应付托管费		3, 516. 82	2, 919. 38
应付销售服务费		42. 23	0.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		_	-
<u> </u>	1	1	

应付利润		_	-
递延所得税负债		-	_
其他负债	6. 4. 7. 7	30, 594. 58	74, 801. 83
负债合计		291, 806. 47	749, 121. 95
净资产:			
实收基金	6. 4. 7. 8	35, 649, 807. 80	29, 731, 182. 75
其他综合收益		_	
未分配利润	6. 4. 7. 9	-6, 430, 396. 27	-7, 872, 757. 65
净资产合计		29, 219, 411. 53	21, 858, 425. 10
负债和净资产总计		29, 511, 218. 00	22, 607, 547. 05

注: 报告截止日 2025 年 6 月 30 日,东方量化多策略混合 A 基金份额净值 0.8203 元,基金份额总额 29,514,987.90 份;东方量化多策略混合 C 基金份额净值 0.8165 元,基金份额总额 6,134,819.90 份。东方量化多策略混合份额总额合计 35,649,807.80 份。

6.2 利润表

会计主体:东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期: 2025年1月1日至2025年6月30日

		本期	上年度可比期间
1番 日	7.4.沙 口.		
项 目	附注号	2025年1月1日至2025	2024年1月1日至2024年
		年 6 月 30 日	6月30日
一、营业总收入		3, 394, 608. 91	-4, 344, 095. 71
1. 利息收入		6, 343. 18	4, 619. 85
其中: 存款利息收入	6. 4. 7. 10	6, 343. 18	4, 619. 85
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"-"		9 076 924 90	2 115 022 27
填列)		2, 976, 234. 29	-3, 115, 033. 37
其中: 股票投资收益	6. 4. 7. 11	2, 735, 585. 28	-3, 346, 470. 57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 12	9, 411. 81	13, 504. 59
资产支持证券投	C 4 7 10		
资收益	6. 4. 7. 13	_	_
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	231, 237. 20	217, 932. 61
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	285, 636. 06	-1, 235, 466. 60
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	126, 395. 38	1, 784. 41
减:二、营业总支出		137, 899. 72	141, 274. 87
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	108, 836. 03	80, 524. 39
其中: 暂估管理人报酬		_	_
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	20, 406. 72	15, 098. 33
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	220. 39	2.77
4. 投资顾问费		-	_
5. 利息支出		1, 662. 38	_
其中: 卖出回购金融资产 支出		1, 662. 38	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	6, 774. 20	45, 649. 38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3, 256, 709. 19	-4, 485, 370. 58
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-" 号填列)		3, 256, 709. 19	-4, 485, 370. 58
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		3, 256, 709. 19	-4, 485, 370. 58

6.3 净资产变动表

会计主体:东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期: 2025年1月1日至2025年6月30日

单位: 人民币元

				平區: 八风中儿		
项目		2025年1月1日至	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	29, 731, 182. 75	-	-7, 872, 757. 65	21, 858, 425. 10		
加:会计政策变 更	_	_	_	_		
前期差错更 正	ı	-	-	-		
其他	_	_	_	_		

二、本期期初净 资产	29, 731, 182. 75	-	-7, 872, 757. 65	21, 858, 425. 10
三、本期增减变 动额(减少以"-" 号填列)	5, 918, 625. 05	_	1, 442, 361. 38	7, 360, 986. 43
(一)、综合收益 总额	-	-	3, 256, 709. 19	3, 256, 709. 19
(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)	5, 918, 625. 05	-	-1, 814, 347. 81	4, 104, 277. 24
其中: 1.基金申购款	45, 414, 537. 58	-	-11, 264, 447. 72	34, 150, 089. 86
2. 基金赎回款	-39, 495, 912. 53	-	9, 450, 099. 91	-30, 045, 812. 62
(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	35, 649, 807. 80	-	-6, 430, 396. 27	29, 219, 411. 53
		上年度	可比期间	
项目		2024年1月1日至	至2024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	30, 198, 046. 83	-	-7, 018, 305. 06	23, 179, 741. 77
加:会计政策变 更	-	_	_	_
前期差错更正	-	-	_	_
其他	-	-	_	_
二、本期期初净资产	30, 198, 046. 83	_	-7, 018, 305. 06	23, 179, 741. 77
三、本期增减变 动额(减少以"-" 号填列)	-65, 259. 55	_	-4, 445, 363. 92	-4, 510, 623. 47
(一)、综合收益 总额	-	-	-4, 485, 370. 58	-4, 485, 370. 58

(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)	-65 , 259 . 55	_	40, 006. 66	-25, 252. 89
其中: 1. 基金申 购款	668, 218. 84	_	-220, 052. 35	448, 166. 49
2. 基金赎回款	-733, 478. 39	-	260, 059. 01	-473, 419. 38
(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)	1	I	-	
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	_	_
四、本期期末净 资产	30, 132, 787. 28	-	-11, 463, 668. 98	18, 669, 118. 30

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>

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

东方量化多策略混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据 2018 年 7 月 10 日中国证监会《关于准予东方量化多策略混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1093 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《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 1 月 7 日至 2019 年 2 月 15 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 329,903,665.65 元人民币,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)"瑞华验字[2019]第 01210017 号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 2 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,005,184.34 份基金单位,其中认购资金利息折合101,518.69 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农

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《东方量化多策略混合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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、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、分离交易的可转换债券)、银行存款、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、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)。

本基金可投资于股票和权证,可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证 及因投资可分离债券而产生的权证等。

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。

本基金自 2022 年 1 月 6 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额,并自 2022 年 1 月 6 日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。详情可参阅本公司于 2022 年 1 月 5 日发布的《关于东方量化多策略混合型证券投资基金修改〈基金合同〉等法律文件的公告》。

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,同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"基金业协会")颁布的《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的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 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[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》、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》、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》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) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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,暂不征收企业所得税。 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、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。

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

- d)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。
- e) 对基金运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资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

番口	本期末
项目	2025年6月30日
活期存款	755, 240. 50
等于: 本金	755, 147. 08
加:应计利息	93. 42
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	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减:坏账准备	
合计	755, 240. 50

6.4.7.2 交易性金融资产

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		26, 820, 194. 03	_	26, 814, 837. 00	-5, 357. 03
贵金属	投资-金交所		_	_	_
黄金合约					
	交易所市场	1, 596, 876. 00	8, 491. 84	1, 607, 051. 84	1,684.00
债券	银行间市场	_	_	_	_
	合计	1, 596, 876. 00	8, 491. 84	1, 607, 051. 84	1,684.00
资产支持证券		_	_	_	-
基金		_	_	_	_
其他		_	-	-	_
合计		28, 417, 070. 03	8, 491. 84	28, 421, 888. 84	-3, 673. 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

	1 = 7 (7 (7) 7)
项目	本期末
- 次日	2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	_
应付赎回费	3. 26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26, 427. 28
其中:交易所市场	26, 427. 28
银行间市场	_
应付利息	_

预提费用	4, 164. 04
合计	30, 594. 58

6.4.7.8 实收基金

金额单位:人民币元

东方量化多策略混合 A

	本期]	
项目	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	29, 691, 168. 91	29, 691, 168. 91	
本期申购	1, 682, 806. 44	1, 682, 806. 44	
本期赎回(以"-"号填列)	-1, 858, 987. 45	-1, 858, 987. 45	
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	29, 514, 987. 90	29, 514, 987. 90	

东方量化多策略混合C

49, 2, 2, 3, 4, 6, 7			
	本期		
项目	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	40, 013. 84	40, 013. 84	
本期申购	43, 731, 731. 14	43, 731, 731. 14	
本期赎回(以"-"号填列)	-37, 636, 925. 08	-37, 636, 925. 08	
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	6, 134, 819. 90	6, 134, 819. 90	

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

东方量化多策略混合 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, 233, 789. 99	-3, 628, 235. 75	-7, 862, 025. 74
加:会计政策变更	-	_	_
前期差错更正	-	-	_
其他	-	-	_
本期期初	-4, 233, 789. 99	-3, 628, 235. 75	-7, 862, 025. 74
本期利润	2, 878, 567. 22	-301, 195. 91	2, 577, 371. 31
本期基金份额交易产	26, 477. 79	46 912 65	-19, 735. 86
生的变动数	20, 411. 19	-46, 213. 65	-19, 755. 66
其中:基金申购款	-112, 521. 24	-312, 850. 54	-425, 371. 78

基金赎回款	138, 999. 03	266, 636. 89	405, 635. 92
本期已分配利润	1	-	_
本期末	-1, 328, 744. 98	-3, 975, 645. 31	-5, 304, 390. 29

东方量化多策略混合C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18, 696. 62	7, 964. 71	-10, 731. 91
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正		-	-
其他		-	-
本期期初	-18, 696. 62	7, 964. 71	-10, 731. 91
本期利润	92, 505. 91	586, 831. 97	679, 337. 88
本期基金份额交易产 生的变动数	-2, 344, 627. 64	550, 015. 69	-1, 794, 611. 95
其中:基金申购款	-16, 890, 317. 29	6, 051, 241. 35	-10, 839, 075. 94
基金赎回款	14, 545, 689. 65	-5, 501, 225. 66	9, 044, 463. 99
本期已分配利润	_	_	_
本期末	-2, 270, 818. 35	1, 144, 812. 37	-1, 126, 005. 98

6.4.7.10 存款利息收入

单位: 人民币元

項目	本期
项目	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	5, 887. 06
定期存款利息收入	_
其他存款利息收入	_
结算备付金利息收入	194. 18
其他	261. 94
合计	6, 343. 18

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
771	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	2, 735, 585. 28
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	2, 735, 585. 28

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

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	75, 654, 746. 49
减: 卖出股票成本总额	72, 802, 163. 80
减:交易费用	116, 997. 41
买卖股票差价收入	2, 735, 585. 28

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
债券投资收益——利息收入	9, 908. 41	
债券投资收益——买卖债券(债转股及债	-496. 60	
券到期兑付)差价收入 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	9, 411. 81	

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总 额	1,614,802.80
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	1,600,148.60
减: 应计利息总额	15, 150. 80
减:交易费用	_
买卖债券差价收入	-496.60

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 2025年1月1日至2025年6月30日		
股票投资产生的股利收益		231, 237. 20	
其中:证券出借权益补偿收			
λ			
基金投资产生的股利收益		_	
合计		231, 237. 20	

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
次日石你	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	285, 636. 06
股票投资	285, 870. 46
债券投资	-234.40
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	285, 636. 06

6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

福日	本期	
项目	2025年1月1日至2025年6月30日	
基金赎回费收入	126, 356. 14	
基金转换费收入	39.	
合计	126, 395. 38	

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

	1 = 7 11 1 7 2	
项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
审计费用	4, 164. 04	
信息披露费	-	

证券出借违约金	_
银行费用	2, 610. 16
合计	6, 774. 20

注: 自 2025年1月1日起至 2025年4月15日,本基金审计费用由本基金管理人承担。

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	
中国农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

	本期	上年度可比期间	
项目	2025年1月1日至2025年6	2024年1月1日至2024年	
	月 30 日	6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	108, 836. 03	80, 524. 39	
其中: 应支付销售机构的客户维护 费	15, 047. 61	6, 101. 10	
应支付基金管理人的净管理费	93, 788. 42	74, 423. 29	

注:①计提标准:本基金的管理费每日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×0.80%÷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计提方式与支付方式:基金管理费每日计提,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

	本期	上年度可比期间	
项目	2025年1月1日至2025年6	2024年1月1日至2024年	
	月 30 日	6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	20, 406. 72	15, 098. 33	

注: ①计提标准: 本基金的托管费每日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×0.15%÷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计提方式与支付方式:基金托管费每日计提,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

#/D W & DD & # 4. 6 \ Y #/	本期	
获得销售服务费的各关联	2025年1月1日至2025年6月30日	
方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费	

	东方量化多策略混合	东方量化多策略混合	合计	
	A	С		
东方基金管理股份有限公	_	3.85	3. 85	
司		J . 00	3.00	
合计	ı	3.85	3. 85	
	上年度可比期间			
获得销售服务费的各关联	2024年1月1日至2024年6月30日			
方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计	
东方基金管理股份有限公	_	_	_	
司				
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每日按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.01%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.01%÷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计提方式与支付方式: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。
- ③自 2022 年 8 月 16 日起 C 类基金实行销售服务费率优惠调整, 费率由 0.40%调整至 0.01%, 截止本报告期末优惠方案未结束。
- 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 2025年1月1日至2025年6月30日				
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合C			
基金合同生效日 (2019 年 2 月 22 日) 持有的基金份额	_	_			
报告期初持有的基金份额	24, 732, 161. 50	_			
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	24, 732, 161. 50	ı			
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	83.80%	-			
项目	上年度可比 2024年1月1日至 20				
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C			
基金合同生效日 (2019 年 2 月 22 日) 持有的基金份额	_	_			
报告期初持有的基金份额	24, 732, 161. 50	-			
te at tre >= 1, et : == 5, >=					
报告期间申购/买入总份额					
报告期间申购/买入总份额 报告期间因拆分变动份额					
	-	-			
报告期间因拆分变动份额 减:报告期间赎回/卖出总份	24, 732, 161. 50	- - -			

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第 31页 共 72页

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 2025年1月1日至2025年6月30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国农业银行股 份有限公司	755, 240. 50	5, 887. 06	1, 278, 120. 03	3, 116. 34

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 (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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

- 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

截至本报告期末 2025 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 2025 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	上年度末	
应 划 信用计级	2025年6月30日	2024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	上年度末	
应 粉信用	2025年6月30日	2024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

短期信用评级	本期末	上年度末	
应 别信用 广级	2025年6月30日	2024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

	, i = , , , , , , , , , , , , , , , , ,			
长期信用评级	本期末	上年度末		
区别信用 厅级	2025年6月30日	2024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

	本期末	上年度末	
下 别 信用 广级	2025年6月30日	2024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	上年度末	
区 州 旧 川	2025年6月30日	2024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 2025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	755, 240. 50	-	-	_	755, 240. 50
结算备付金	78, 904. 54	_	_	_	78, 904. 54
存出保证金	8, 925. 93	-	-	_	8, 925. 93
交易性金融资产-股	_	_	_	26, 814, 837. 00	26, 814, 837. 00
票投资				, ,	, ,
交易性金融资产-基					
金投资			_		
交易性金融资产-债	1,607,051.84	_	_	_	1, 607, 051. 84

券投资					
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	_			245, 248. 48	245, 248. 48
应收股利	_		-	_	_
应收申购款	_	-	-	1,009.71	1,009.71
递延所得税资产	_	-	-	_	_
其他资产	_	_	-	_	_
资产总计	2, 450, 122. 81	_	-	27, 061, 095. 19	29, 511, 218. 00
 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	-	_	-	235, 183. 94	235, 183. 94
应付赎回款	-	_	-	3,712.47	3, 712. 47
应付管理人报酬	_	_	-	18, 756. 43	18, 756. 43
应付托管费	-	_	-	3, 516. 82	3, 516. 82
应付销售服务费	-	_	-	42. 23	42. 23
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	-	_	-	30, 594. 58	30, 594. 58
负债总计	-	-	-	291, 806. 47	291, 806. 47
利率敏感度缺口	2, 450, 122. 81	-	-	26, 769, 288. 72	29, 219, 411. 53
上年度末	1年11日	1-5 年	- 年N L	不让自	∆;;
2024年12月31日	1年以内	1-9 平	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,396,901.00	-	-	-	1, 396, 901. 00
结算备付金	73, 681. 68	_	-	_	73, 681. 68
存出保证金	13, 145. 57	_	-	-	13, 145. 57
交易性金融资产-股				19, 763, 733. 74	19, 763, 733. 74
票投资				19, 703, 733. 74	19, 703, 733. 74
交易性金融资产-基		_			_
金投资					
交易性金融资产-债	1, 309, 751. 75	_	_		1, 309, 751. 75
券投资	1,000,101.10				1, 000, 101. 10
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	_	_	- 50, 332. 32	50, 332. 32
	-	-		_
应收申购款	-	-	- 0.99	0.99
递延所得税资产	-	-		_
其他资产	_	-		_
资产总计	2, 793, 480. 00	-	- 19, 814, 067. 05	22, 607, 547. 05
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	600, 213. 50	_		600, 213. 50
应付清算款	_	_	- 55, 507. 90	55, 507. 90
应付赎回款	-	_	- 108.97	108. 97
应付管理人报酬	_	_	- 15 , 570 . 06	15, 570. 06
应付托管费	-	_	- 2, 919. 38	2, 919. 38
应付销售服务费	-	_	- 0.31	0. 31
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	-	_	- 74, 801. 83	74, 801. 83
负债总计	600, 213. 50	_	- 148, 908. 45	749, 121. 95
利率敏感度缺口	2, 193, 266. 50	-	- 19, 665, 158. 60	21, 858, 425. 10

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

0.4.13.4.1.2 小平/心区的致态压力 们						
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			
1反 仅	允价值的变动对基金	利润总额和净值产生的影响				
		对资产负债表日基金资产净值的				
	相关风险变量的变	影响金额(单位	2: 人民甲元)			
	动	本期末 (2025年6月30日)	上年度末 (2024年12月			
		本例水(2023年 0 月 30 日)	31 日)			
分析	市场利率上调	-2, 174. 74	-1, 900. 93			
	0. 25%	2, 174. 74	1, 900. 93			
	市场利率下调	0 174 74	1 000 02			
	0. 25%	2, 174. 74	1, 900. 93			

6.4.13.4.2 外汇风险

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。

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

		明末	上年度末 2024年12月31日		
项目	2025年6	月 30 日	2024年12	2月31日	
71	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	26, 814, 837. 00	91.77	19, 763, 733. 74	90. 42	
交易性金融资 产-基金投资		1	_	_	
交易性金融资 产-债券投资	1, 607, 051. 84	5. 50	1, 309, 751. 75	5. 99	
交易性金融资 产一贵金属投 资	-	-	-	_	
衍生金融资产 一权证投资	1	ı	_	_	
其他	_	-	_	_	
合计	28, 421, 888. 84	97. 27	21, 073, 485. 49	96. 41	

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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				
/HI 27L	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		
假设	股票交易不足 100 个	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				
		对资产负债表日	基金资产净值的		
	相关风险变量的变 影响金额(单位:人民币元)				
分析	动	大 期十 (2005 年 6 日 20 日)	上年度末 (2024年12月		
		本期末 (2025年6月30日)	31 日)		

沪深 300 指数上涨 5%	1, 923, 427. 94	1, 205, 109. 60
沪深 300 指数下跌 5%	-1, 923, 427. 94	-1, 205, 109. 60

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	26, 814, 837. 00	19, 742, 719. 34	
第二层次	1,607,051.84	1, 330, 766. 15	
第三层次	_	_	
合计	28, 421, 888. 84	21, 073, 485. 49	

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	26, 814, 837. 00	90.86
	其中: 股票	26, 814, 837. 00	90.86
2	基金投资	-	_
3	固定收益投资	1, 607, 051. 84	5. 45
	其中:债券	1, 607, 051. 84	5. 45
	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	834, 145. 04	2.83
8	其他各项资产	255, 184. 12	0.86
9	合计	29, 511, 218. 00	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	68, 911. 00	0.24
В	采矿业	251, 794. 00	0.86
С	制造业	18, 589, 270. 09	63.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供		
	应业	909, 190. 00	3.11
Е	建筑业	404, 181. 00	1.38
F	批发和零售业	603, 259. 50	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	604, 779. 00	2.07
Н	住宿和餐饮业	20, 196. 00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务		
	<u>llk</u>	2, 968, 240. 41	10. 16

J	金融业	395, 344. 00	1.35
K	房地产业	433, 307. 00	1.48
L	租赁和商务服务业	302, 159. 00	1.03
M	科学研究和技术服务业	507, 978. 00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	92, 554. 00	0.32
0	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作	62, 607. 00	0. 21
R	文化、体育和娱乐业	566, 177. 00	1.94
S	综合	34, 890. 00	0.12
	合计	26, 814, 837. 00	91.77

7.2.2 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

					亚极干压, 八八市儿
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	300346	南大光电	8,040	254, 385. 60	0.87
2	000629	钒钛股份	68, 700	175, 872. 00	0.60
3	000021	深科技	9,000	168, 660. 00	0.58
4	300012	华测检测	12, 700	148, 463. 00	0.51
5	603005	晶方科技	5, 100	144, 789. 00	0.50
6	603605	珀莱雅	1,700	140, 743. 00	0.48
7	601012	隆基绿能	8,800	132, 176. 00	0.45
8	300406	九强生物	9, 100	128, 765. 00	0.44
9	688352	颀中科技	11, 314	127, 056. 22	0.43
10	000766	通化金马	5,000	126, 850. 00	0.43
11	300666	江丰电子	1,700	125, 970. 00	0.43
12	600862	中航高科	4,800	125, 184. 00	0.43
13	002204	大连重工	20, 400	121, 788. 00	0.42
14	603456	九洲药业	7,900	120, 159. 00	0.41
15	002174	游族网络	9,900	120, 087. 00	0.41
16	002465	海格通信	8,600	119, 884. 00	0.41
17	688037	芯源微	1, 100	117, 920. 00	0.40
18	000933	神火股份	7,000	116, 480. 00	0.40
19	601236	红塔证券	13, 500	114, 345. 00	0.39
20	002815	崇达技术	10,000	113, 300. 00	0.39
21	002215	诺 普 信	10,900	112, 597. 00	0.39
22	601949	中国出版	16, 800	111, 552. 00	0.38
23	300298	三诺生物	4,900	110, 691. 00	0.38
24	002074	国轩高科	3, 400	110, 364. 00	0.38
25	002389	航天彩虹	4, 300	110, 080. 00	0.38

26	603466	风语筑	10,600	106, 954. 00	0. 37
27	300708	聚灿光电	8,900	106, 800. 00	0. 37
28	600329	达仁堂	3, 200	106, 752. 00	0. 37
29	600171	上海贝岭	3,000	102, 750. 00	0. 35
30	002222	福晶科技	3,000	102, 600. 00	0.35
31	300576	容大感光	2,760	102, 534. 00	0.35
32	000528	柳工	10,600	101, 866. 00	0.35
33	301069	凯盛新材	6, 200	99, 882. 00	0. 34
34	600021	上海电力	10,800	94, 932. 00	0.32
35	688432	有研硅	8, 485	93, 674. 40	0.32
36	600055	万东医疗	5, 300	91, 584. 00	0.31
37	002532	天山铝业	11,000	91, 410. 00	0.31
38	603855	华荣股份	4, 100	90, 733. 00	0.31
39	601016	节能风电	31, 100	89, 879. 00	0.31
40	300779	惠城环保	500	89, 245. 00	0.31
41	688582	芯动联科	1,300	87, 360. 00	0.30
42	301339	通行宝	5,040	86, 335. 20	0.30
43	300857	协创数据	1,000	86, 060. 00	0. 29
44	300296	利亚德	14, 100	86, 010. 00	0. 29
45	300130	新国都	2,400	85, 272. 00	0. 29
46	002747	埃斯顿	4, 200	85, 008. 00	0. 29
47	688598	金博股份	3,300	83, 886. 00	0. 29
48	300315	掌趣科技	13,800	83, 766. 00	0. 29
49	688508	芯朋微	1,500	83, 730. 00	0. 29
50	600020	中原高速	17,500	83, 650. 00	0. 29
51	300181	佐力药业	4,800	83, 184. 00	0. 28
52	301311	昆船智能	4,000	81, 720. 00	0. 28
53	688596	正帆科技	2,400	81, 408. 00	0.28
54	300226	上海钢联	3,500	79, 940. 00	0. 27
55	600259	广晟有色	1,500	79, 680. 00	0. 27
56	300674	宇信科技	2,600	78, 754. 00	0. 27
57	002125	湘潭电化	5, 400	78, 462. 00	0. 27
58	002378	章源钨业	9,900	78, 309. 00	0. 27
59	002245	蔚蓝锂芯	6, 100	78, 263. 00	0. 27
60	000581	威孚高科	4,100	77, 654. 00	0. 27
61	300035	中科电气	4,600	77, 648. 00	0. 27
62	603236	移远通信	900	77, 220. 00	0.26
63	688347	华虹公司	1,400	76, 874. 00	0. 26
64	002075	沙钢股份	13, 200	76, 824. 00	0. 26
65	002516	旷达科技	14, 900	76, 735. 00	0. 26
66	002493	荣盛石化	9, 200	76, 176. 00	0.26
67	002079	苏州固锝	7,800	76, 050. 00	0. 26
68	300685	艾德生物	3,500	75, 355. 00	0.26

69	300655	晶瑞电材	7, 500	75, 075. 00	0.26
69	300726	宏达电子	2, 100	75, 075. 00	0.26
70	300075	数字政通	4, 200	74, 844. 00	0.26
71	002373	千方科技	8,000	74, 400. 00	0.25
72	300458	全志科技	1,870	74, 220. 30	0.25
73	300170	汉得信息	4, 300	74, 003. 00	0.25
74	002597	金禾实业	3, 100	73, 005. 00	0.25
75	002077	大港股份	5,000	71, 700. 00	0.25
76	300457	赢合科技	3, 100	71, 300. 00	0.24
77	688608	恒玄科技	200	69, 596. 00	0.24
78	300450	先导智能	2,800	69, 580. 00	0.24
79	603659	璞泰来	3,700	69, 486. 00	0.24
80	001208	华菱线缆	6,500	69, 225. 00	0.24
81	688318	财富趋势	600	68, 952. 00	0.24
82	688798	艾为电子	1,000	68, 200. 00	0.23
83	300049	福瑞股份	2, 100	68, 103. 00	0.23
84	002428	云南锗业	3,400	67, 660. 00	0.23
85	300872	天阳科技	2,900	66, 874. 00	0.23
86	000555	神州信息	4,700	66, 834. 00	0.23
87	601919	中远海控	4, 400	66, 176. 00	0.23
88	688401	路维光电	1,900	65, 930. 00	0.23
89	002777	久远银海	3,600	65, 736. 00	0.22
90	002626	金达威	3, 200	65, 472. 00	0.22
91	002967	广电计量	3,700	65, 083. 00	0.22
92	688612	威迈斯	2,400	64, 176. 00	0.22
93	688439	振华风光	1,100	64, 075. 00	0.22
94	002768	国恩股份	2,400	63, 384. 00	0.22
95	000026	飞亚达	4,000	63, 280. 00	0.22
96	688629	华丰科技	1,100	62, 920. 00	0.22
97	001696	宗申动力	2,800	62, 860. 00	0.22
98	002226	江南化工	10,800	62, 640. 00	0.21
99	601137	博威合金	3,500	62, 265. 00	0.21
100	002488	金固股份	4,500	62, 100. 00	0.21
101	002609	捷顺科技	5, 300	61, 904. 00	0.21
102	600063	皖维高新	13,500	61, 830. 00	0.21
103	301285	鸿日达	1,900	61, 655. 00	0.21
104	000997	新大陆	1,900	61, 522. 00	0.21
105	001289	龙源电力	3,800	61, 484. 00	0.21
106	601698	中国卫通	3,000	61, 410. 00	0.21
107	603766	隆鑫通用	4,800	61, 248. 00	0.21
108	002439	启明星辰	3,800	60, 762. 00	0. 21
109	688337	普源精电	1,700	60, 639. 00	0.21
110	002396	星网锐捷	2,700	60, 615. 00	0.21

111	002985	北摩高科	2,000	60, 500. 00	0.21
112	002402	和而泰	2,600	60, 242. 00	0.21
113	688484	南芯科技	1,500	59, 325. 00	0.20
114	300747	锐科激光	2,500	59, 200. 00	0.20
115	600120	浙江东方	9,700	58, 685. 00	0.20
116	002745	木林森	7, 400	58, 312. 00	0.20
117	600641	万业企业	4, 200	58, 296. 00	0.20
118	688249	晶合集成	2, 865	58, 073. 55	0.20
119	600452	涪陵电力	6, 300	57, 960. 00	0.20
120	688315	诺禾致源	4, 100	57, 892. 00	0.20
121	600763	通策医疗	1,400	57, 792. 00	0.20
122	688522	纳睿雷达	1, 120	57, 366. 40	0.20
123	688122	西部超导	1,100	57, 068. 00	0.20
124	601869	长飞光纤	1,400	57, 008. 00	0.20
125	601019	山东出版	6,000	56, 820. 00	0.19
126	300661	圣邦股份	780	56, 760. 60	0.19
127	600059	古越龙山	5, 200	56, 732. 00	0.19
128	600635	大众公用	14, 500	56, 550. 00	0.19
129	300738	奥飞数据	2,700	56, 511. 00	0.19
130	600602	云赛智联	2,800	56, 476. 00	0.19
131	600477	杭萧钢构	21, 300	56, 445. 00	0.19
132	603218	日月股份	4, 400	55, 836. 00	0.19
133	000848	承德露露	6, 100	55, 693. 00	0.19
134	600480	凌云股份	4,550	55, 373. 50	0.19
135	002773	康弘药业	1,900	55, 043. 00	0.19
136	688012	中微公司	300	54, 690. 00	0.19
137	300284	苏交科	6,000	54, 600. 00	0.19
138	300679	电连技术	1,200	54, 456. 00	0.19
139	002376	新北洋	7,000	54, 390. 00	0.19
140	688150	莱特光电	2, 200	54, 384. 00	0.19
141	300236	上海新阳	1,400	54, 320. 00	0.19
142	301345	涛涛车业	500	54, 050. 00	0.18
143	688029	南微医学	800	54, 040. 00	0.18
144	300003	乐普医疗	3,900	53, 742. 00	0.18
145	300088	长信科技	9,000	53, 640. 00	0.18
146	300408	三环集团	1,600	53, 440. 00	0.18
147	600645	中源协和	2,300	53, 360. 00	0.18
148	300129	泰胜风能	7,500	53, 325. 00	0.18
149	300034	钢研高纳	3, 200	53, 216. 00	0.18
150	600499	科达制造	5, 400	52, 920. 00	0.18
151	002254	泰和新材	4,900	52, 822. 00	0.18
152	000951	中国重汽	3,000	52, 740. 00	0.18
153	603348	文灿股份	2,500	52, 200. 00	0.18

154	600851	海欣股份	7,800	52, 182. 00	0.18
155	600487	亨通光电	3, 400	52, 020. 00	0.18
156	300286	安科瑞	2, 300	51, 911. 00	0.18
157	000531	穗恒运 A	8, 400	51, 660. 00	0.18
158	600657	信达地产	13, 200	51, 348. 00	0.18
159	688005	容百科技	2,300	51, 336. 00	0.18
160	300814	中富电路	1,500	51, 240. 00	0.18
161	000628	高新发展	1,200	51, 036. 00	0.17
162	600835	上海机电	2, 400	51,000.00	0.17
163	003040	楚天龙	2, 100	50, 925. 00	0.17
164	600562	国睿科技	1,600	50, 384. 00	0.17
165	688778	厦钨新能	900	50, 328. 00	0.17
166	688097	博众精工	1,800	50, 238. 00	0.17
167	688319	欧林生物	3, 200	50, 112. 00	0.17
168	601677	明泰铝业	4,000	49, 680. 00	0.17
169	600782	新钢股份	14,000	49, 560. 00	0.17
170	300231	银信科技	4,000	49, 240. 00	0.17
171	300115	长盈精密	2,300	49, 220. 00	0.17
172	688568	中科星图	1, 341	48, 289. 41	0.17
173	000560	我爱我家	16, 200	48, 114. 00	0.16
174	301510	固高科技	1,600	48, 080. 00	0.16
175	002860	星帅尔	3,600	48, 024. 00	0.16
176	300347	泰格医药	900	47, 988. 00	0.16
177	003031	中瓷电子	900	47, 889. 00	0.16
178	301219	腾远钴业	900	47, 808. 00	0.16
179	603583	捷昌驱动	1,300	47, 476. 00	0.16
180	300133	华策影视	6, 300	47, 313. 00	0.16
181	002001	新 和 成	2, 200	46, 794. 00	0.16
182	002648	卫星化学	2,700	46, 791. 00	0.16
183	000559	万向钱潮	6, 100	46, 665. 00	0.16
184	603103	横店影视	2,900	46, 545. 00	0.16
185	000768	中航西飞	1,700	46, 478. 00	0.16
186	600556	天下秀	9, 100	46, 410. 00	0.16
187	300185	通裕重工	16, 200	46, 332. 00	0.16
188	688388	嘉元科技	2,300	46, 184. 00	0.16
189	002957	科瑞技术	2,800	46, 032. 00	0.16
190	002006	精工科技	2,800	46, 004. 00	0.16
191	002273	水晶光电	2,300	45, 931. 00	0.16
192	300496	中科创达	800	45, 776. 00	0.16
193	688690	纳微科技	2,000	45, 660. 00	0.16
194	603267	鸿远电子	900	45, 243. 00	0.15
195	688321	微芯生物	1,900	45, 182. 00	0.15
196	300676	华大基因	900	44, 793. 00	0.15

197	000550	江铃汽车	2, 200	44, 726. 00	0.15
198	600550	保变电气	5, 200	44, 720.00	0.15
199	300660	江苏雷利	1,000	44, 240. 00	0.15
200	300045	华力创通	2,300	43, 907. 00	0.15
201	300523	辰安科技	1,900	43, 795. 00	0.15
202	600409	三友化工	9,000	43, 740. 00	0.15
203	600017	日照港	14, 100	43, 710. 00	0.15
204	603135	中重科技	4, 400	43, 648. 00	0.15
205	600756	浪潮软件	2,900	43, 558. 00	0.15
206	600143	金发科技	4, 200	43, 302. 00	0.15
207	002458	益生股份	5, 300	43, 301. 00	0.15
208	301316	慧博云通	1,000	43, 080. 00	0.15
209	600894	广日股份	4, 100	43, 009. 00	0.15
210	002824	和胜股份	2,500	43, 000. 00	0.15
211	600422	昆药集团	3,000	42, 930. 00	0.15
212	002171	楚江新材	4,400	42, 812. 00	0.15
213	300643	万通智控	2,000	42, 760. 00	0.15
214	300919	中伟股份	1,300	42, 744. 00	0.15
215	603083	剑桥科技	900	42, 570. 00	0.15
216	603061	金海通	500	42, 275. 00	0.14
217	002368	太极股份	1,800	42, 156. 00	0.14
218	300079	数码视讯	7, 200	42, 120. 00	0.14
219	605016	百龙创园	2,040	42, 085. 20	0.14
220	601390	中国中铁	7,500	42, 075. 00	0.14
221	601339	百隆东方	8,900	42, 008. 00	0.14
222	300702	天宇股份	1,800	41, 868. 00	0.14
223	300976	达瑞电子	840	41, 823. 60	0.14
224	600821	金开新能	7,700	41, 811. 00	0.14
225	600577	精达股份	5,600	41, 664. 00	0.14
226	301221	光庭信息	800	41, 576. 00	0.14
227	600461	洪城环境	4,300	41, 452. 00	0.14
228	000543	皖能电力	5,900	41, 300. 00	0.14
229	600895	张江高科	1,600	41, 120. 00	0.14
230	600195	中牧股份	5,600	41, 048. 00	0.14
231	688018	乐鑫科技	280	40, 908. 00	0.14
232	600986	浙文互联	5,000	40, 850. 00	0.14
233	688588	凌志软件	2,800	40, 796. 00	0.14
234	600320	振华重工	9,300	40, 641. 00	0.14
235	000958	电投产融	5,900	40, 356. 00	0.14
236	605198	安德利	1,000	40, 310. 00	0.14
237	603040	新坐标	1,000	40, 170. 00	0.14
238	301421	波长光电	500	39, 995. 00	0.14
239	600094	大名城	12,900	39, 990. 00	0.14

240	000498	山东路桥	6,800	39, 984. 00	0.14
241	688276	百克生物	1,900	39, 900. 00	0.14
242	601702	华峰铝业	2,500	39, 725. 00	0.14
243	688559	海目星	1,200	39, 480. 00	0.14
244	301095	广立微	700	39, 368. 00	0.13
245	002324	普利特	3,700	39, 331. 00	0.13
246	002421	达实智能	11,700	39, 312. 00	0.13
247	300451	创业慧康	6,900	38, 985. 00	0.13
248	000088	盐田港	8,600	38, 958. 00	0.13
249	300119	瑞普生物	2,000	38, 840. 00	0.13
250	301277	新天地	2,700	38, 799. 00	0.13
251	601069	西部黄金	1,900	38, 665. 00	0.13
252	002233	塔牌集团	5, 200	38, 480. 00	0.13
253	600827	百联股份	4, 200	38, 388. 00	0.13
254	600675	中华企业	13, 300	38, 304. 00	0.13
255	688336	三生国健	700	37, 968. 00	0.13
256	000928	中钢国际	6,000	37, 680. 00	0.13
257	603060	国检集团	5, 700	37, 563. 00	0.13
258	301260	格力博	1,900	37, 468. 00	0.13
259	300860	锋尚文化	1,400	37, 352. 00	0.13
260	600595	中孚实业	8, 500	37, 230. 00	0.13
261	603027	千禾味业	3, 200	37, 152. 00	0.13
262	002155	湖南黄金	2,080	37, 128. 00	0.13
263	000099	中信海直	1,700	37, 026. 00	0.13
264	688209	英集芯	2,000	36, 940. 00	0.13
265	603615	茶花股份	1,600	36, 752. 00	0.13
266	603008	喜临门	2, 100	36, 708. 00	0.13
267	300827	上能电气	1,200	36, 660. 00	0.13
268	300007	汉威科技	900	36, 540. 00	0.13
269	002284	亚太股份	3, 300	36, 465. 00	0.12
270	600826	兰生股份	4, 400	36, 080. 00	0.12
271	000969	安泰科技	2,800	36, 064. 00	0.12
272	688375	国博电子	600	36, 006. 00	0.12
273	002003	伟星股份	3, 300	36, 003. 00	0.12
274	301606	绿联科技	700	36,001.00	0.12
275	000719	中原传媒	2,900	35, 989. 00	0.12
276	300136	信维通信	1,600	35, 840. 00	0.12
277	301195	北路智控	1,000	35, 800. 00	0.12
278	002643	万润股份	3, 100	35, 681. 00	0.12
279	300468	四方精创	700	35, 343. 00	0.12
280	603698	航天工程	2,000	35, 240. 00	0.12
281	002053	云南能投	3, 200	35, 232. 00	0.12
282	600648	外高桥	3, 200	34, 976. 00	0.12

283	000058	深赛格	4, 200	34, 902. 00	0.12
284	600673	东阳光	3,000	34, 890. 00	0.12
285	301179	泽宇智能	2, 280	34, 792. 80	0.12
286	600694	大商股份	1,870	34, 688. 50	0.12
287	300910	瑞丰新材	600	34, 650. 00	0.12
288	600456	宝钛股份	1, 100	34, 573. 00	0.12
289	300140	节能环境	5,600	34, 552. 00	0.12
290	002727	一心堂	2, 100	34, 314. 00	0.12
291	603703	盛洋科技	3, 300	34, 221. 00	0.12
292	688392	骄成超声	500	34, 065. 00	0.12
293	002977	天箭科技	800	33, 976. 00	0.12
294	002283	天润工业	5, 700	33, 972. 00	0.12
295	000869	张裕 A	1,600	33, 968. 00	0.12
296	300113	顺网科技	1,700	33, 592. 00	0.11
297	603565	中谷物流	3,500	33, 425. 00	0.11
298	605305	中际联合	1,200	33, 336. 00	0.11
299	300677	英科医疗	1,400	33, 152. 00	0.11
300	003000	劲仔食品	2,500	33, 075. 00	0.11
301	600604	市北高新	6, 400	33, 024. 00	0.11
302	300841	康华生物	500	32, 985. 00	0.11
303	688091	上海谊众	700	32, 746. 00	0.11
304	601975	招商南油	11, 200	32, 704. 00	0.11
305	300031	宝通科技	1,300	32, 539. 00	0.11
306	600206	有研新材	1,700	32, 487. 00	0.11
307	003021	兆威机电	300	32, 445. 00	0.11
308	603866	桃李面包	6,000	32, 400. 00	0.11
309	605118	力鼎光电	1,300	32, 279. 00	0.11
310	603025	大豪科技	2,300	32, 246. 00	0.11
311	002649	博彦科技	2, 200	31, 966. 00	0.11
312	002859	洁美科技	1,600	31, 856. 00	0.11
313	301263	泰恩康	900	31, 851. 00	0.11
314	300979	华利集团	600	31, 542. 00	0.11
315	002145	中核钛白	7,600	31, 540. 00	0.11
316	002673	西部证券	4,000	31, 520. 00	0.11
317	600502	安徽建工	6, 700	31, 490. 00	0.11
318	002299	圣农发展	2, 200	31, 438. 00	0.11
319	603355	莱克电气	1,400	31, 388. 00	0.11
320	002127	南极电商	7,900	31, 363. 00	0.11
321	300229	拓尔思	1,700	31, 348. 00	0.11
322	603197	保隆科技	800	31, 256. 00	0.11
323	301325	曼恩斯特	500	31, 150. 00	0.11
324	300848	美瑞新材	1,800	30, 924. 00	0.11
325	603858	步长制药	1,900	30, 856. 00	0.11

326	688072	拓荆科技	200	30, 742. 00	0.11
327	605111	新洁能	1,000	30, 740. 00	0.11
328	300073	当升科技	700	30, 709. 00	0.11
329	300395	菲利华	600	30, 660. 00	0.10
330	001322	箭牌家居	3,600	30, 420. 00	0.10
331	300183	东软载波	1,800	30, 258. 00	0.10
332	300723	一品红	600	30, 072. 00	0.10
333	601333	广深铁路	10, 400	30, 056. 00	0.10
334	300278	华昌达	5, 500	30, 030. 00	0.10
335	002539	云图控股	3, 200	30, 016. 00	0.10
336	002062	宏润建设	6, 200	30, 008. 00	0.10
337	300353	东土科技	1,400	29, 890. 00	0.10
338	603383	顶点软件	700	29, 680. 00	0.10
339	300695	兆丰股份	380	29, 636. 20	0.10
340	600551	时代出版	3, 300	29, 436. 00	0.10
341	600305	恒顺醋业	3,800	29, 374. 00	0.10
342	688472	阿特斯	3, 200	29, 280. 00	0.10
343	605056	咸亨国际	1,900	29, 260. 00	0.10
344	300768	迪普科技	1,700	29, 155. 00	0.10
345	002385	大北农	7, 200	29, 088. 00	0.10
346	600780	通宝能源	4,900	29, 057. 00	0.10
347	002139	拓邦股份	2, 100	29, 001. 00	0.10
348	002651	利君股份	2,400	28, 848. 00	0.10
349	688200	华峰测控	200	28, 840. 00	0.10
350	000987	越秀资本	4, 200	28, 812. 00	0.10
351	300416	苏试试验	2,000	28, 660. 00	0.10
352	300638	广和通	1,000	28, 630. 00	0.10
353	600208	衢州发展	9,600	28, 416. 00	0.10
354	600970	中材国际	3, 300	28, 314. 00	0.10
355	300821	东岳硅材	3,600	28, 296. 00	0.10
356	603929	亚翔集成	800	28, 080. 00	0.10
357	001286	陕西能源	3, 200	27, 840. 00	0.10
358	000617	中油资本	3,800	27, 740. 00	0.09
359	300925	法本信息	1, 100	27, 698. 00	0.09
360	600420	国药现代	2,600	27, 690. 00	0.09
361	300232	洲明科技	3,800	27, 512. 00	0.09
362	000652	泰达股份	6,600	27, 390. 00	0.09
363	688208	道通科技	894	27, 356. 40	0.09
364	300727	润禾材料	1,040	27, 341. 60	0.09
365	002782	可立克	2, 100	27, 258. 00	0.09
366	601618	中国中冶	9, 100	27, 118. 00	0.09
367	603325	博隆技术	300	27, 087. 00	0.09
368	601228	广州港	8, 300	26, 809. 00	0.09

369	601908	京运通	8,000	26, 800. 00	0.09
370	000899	赣能股份	3, 100	26, 753. 00	0.09
371	300633	开立医疗	900	26, 748. 00	0.09
372	301177	迪阿股份	900	26, 640. 00	0.09
373	300733	西菱动力	1,500	26, 595. 00	0.09
374	603596	伯特利	500	26, 345. 00	0.09
375	002487	大金重工	800	26, 320. 00	0.09
376	688562	航天软件	1,400	26, 236. 00	0.09
377	603297	永新光学	300	26, 205. 00	0.09
378	000657	中钨高新	2, 200	26, 092. 00	0.09
379	000959	首钢股份	7,600	25, 840. 00	0.09
380	300601	康泰生物	1,700	25, 823. 00	0.09
381	603737	三棵树	700	25, 795. 00	0.09
382	001287	中电港	1,400	25, 634. 00	0.09
383	000998	隆平高科	2,600	25, 610. 00	0.09
384	603317	天味食品	2,300	25, 576. 00	0.09
385	603662	柯力传感	400	25, 572. 00	0.09
386	688411	海博思创	300	25, 569. 00	0.09
387	002292	奥飞娱乐	2,600	25, 272. 00	0.09
388	600399	抚顺特钢	4,800	25, 056. 00	0.09
389	002140	东华科技	2,700	24, 840. 00	0.09
389	301511	德福科技	1,200	24, 840. 00	0.09
390	002506	协鑫集成	9,300	24, 831. 00	0.08
391	300393	中来股份	4, 300	24, 768. 00	0.08
392	002891	中宠股份	400	24, 748. 00	0.08
393	000927	中国铁物	9,600	24, 672. 00	0.08
394	688371	菲沃泰	1, 482	24, 541. 92	0.08
395	603881	数据港	960	24, 528. 00	0.08
396	600339	中油工程	7,500	24, 525. 00	0.08
397	600266	城建发展	5, 400	24, 516. 00	0.08
398	300627	华测导航	700	24, 500. 00	0.08
399	300613	富瀚微	500	24, 440. 00	0.08
400	300973	立高食品	500	24, 385. 00	0.08
401	600869	远东股份	4,800	24, 384. 00	0.08
402	301558	三态股份	2,700	24, 327. 00	0.08
403	002126	银轮股份	1,000	24, 280. 00	0.08
404	600757	长江传媒	2,600	24, 128. 00	0.08
405	300532	今天国际	2,000	24, 120. 00	0.08
406	600483	福能股份	2,500	24, 100. 00	0.08
407	300206	理邦仪器	2,000	24, 040. 00	0.08
408	002317	众生药业	1,600	24, 016. 00	0.08
408	603636	南威软件	1,900	24, 016. 00	0.08
409	300171	东富龙	1,800	23, 922. 00	0.08

410	300941	创识科技	800	23, 864. 00	0.08
410	600729	重庆百货	800	23, 864. 00	0.08
411	600783	鲁信创投	1,900	23, 750. 00	0.08
412	300019	硅宝科技	1,200	23, 688. 00	0.08
413	002929	润建股份	500	23, 630. 00	0.08
414	002303	美盈森	6,600	23, 496. 00	0.08
415	000420	吉林化纤	6,000	23, 400. 00	0.08
416	002437	誉衡药业	8, 200	23, 370. 00	0.08
417	002833	弘亚数控	1,400	22, 904. 00	0.08
418	688116	天奈科技	500	22, 885. 00	0.08
419	000738	航发控制	1,100	22, 825. 00	0.08
420	002880	卫光生物	800	22, 808. 00	0.08
421	002988	豪美新材	600	22, 800. 00	0.08
422	300541	先进数通	1,400	22, 750.00	0.08
423	301217	铜冠铜箔	1,800	22, 518. 00	0.08
424	002095	生 意 宝	1,100	22, 308. 00	0.08
425	688233	神工股份	700	22, 239. 00	0.08
426	600633	浙数文化	1,600	22, 144. 00	0.08
427	300438	鹏辉能源	800	22, 088. 00	0.08
428	688475	萤石网络	700	22, 064. 00	0.08
429	300118	东方日升	2,300	22, 034. 00	0.08
430	002252	上海莱士	3, 200	21, 984. 00	0.08
431	600628	新世界	3,000	21, 960. 00	0.08
432	600750	江中药业	1,000	21, 830.00	0.07
433	300975	商络电子	1,800	21, 744. 00	0.07
434	002194	武汉凡谷	1,500	21, 690. 00	0.07
435	002907	华森制药	1,300	21, 645. 00	0.07
436	000155	川能动力	2, 200	21, 604. 00	0.07
437	603988	中电电机	800	21, 496. 00	0.07
438	600283	钱江水利	2, 100	21, 462. 00	0.07
439	300618	寒锐钴业	600	21, 432. 00	0.07
440	600352	浙江龙盛	2, 100	21, 336.00	0.07
441	000885	城发环境	1,600	21, 312.00	0.07
442	300776	帝尔激光	400	21, 284. 00	0.07
443	301488	豪恩汽电	300	21, 240. 00	0.07
444	301216	万凯新材	1,700	21, 199. 00	0.07
445	002030	达安基因	3,500	21, 175. 00	0.07
446	301662	宏工科技	200	21, 164. 00	0.07
447	300917	特发服务	500	21, 145. 00	0.07
448	301328	维峰电子	500	21, 075. 00	0.07
449	688002	睿创微纳	300	20, 916. 00	0.07
450	300432	富临精工	1,600	20, 912. 00	0.07
451	688050	爱博医疗	300	20, 655. 00	0.07

452	300711	广哈通信	900	20, 592. 00	0.07
452	603496	恒为科技	800	20, 592. 00	0.07
453	002429	兆驰股份	4, 700	20, 586. 00	0.07
454	002739	万达电影	1,800	20, 574. 00	0.07
455	688198	佰仁医疗	200	20, 538. 00	0.07
456	002134	天津普林	900	20, 520. 00	0.07
457	600867	通化东宝	2,500	20, 500. 00	0.07
458	002484	江海股份	1,000	20, 490. 00	0.07
459	688183	生益电子	400	20, 480. 00	0.07
460	000623	吉林敖东	1,200	20, 340. 00	0.07
461	603063	禾望电气	600	20, 316. 00	0.07
462	688526	科前生物	1,300	20, 254. 00	0.07
463	600754	锦江酒店	900	20, 196. 00	0.07
464	002332	仙琚制药	2, 200	20, 174. 00	0.07
465	600179	安通控股	7, 200	19, 872. 00	0.07
466	605055	迎丰股份	2,700	19, 683. 00	0.07
467	301175	中科环保	3,800	19, 646. 00	0.07
468	002190	成飞集成	500	19, 530. 00	0.07
469	300755	华致酒行	1,000	19, 300. 00	0.07
470	000828	东莞控股	1,800	19, 242. 00	0.07
471	002038	双鹭药业	2,700	19, 143. 00	0.07
471	688722	同益中	900	19, 143. 00	0.07
472	601528	瑞丰银行	3, 300	19, 107. 00	0.07
473	603033	三维股份	1,700	19, 057. 00	0.07
474	002334	英威腾	2,400	19, 032. 00	0.07
475	300568	星源材质	1,500	19, 020. 00	0.07
476	300634	彩讯股份	700	18, 970. 00	0.06
477	300680	隆盛科技	500	18, 955. 00	0.06
478	600316	洪都航空	500	18, 850. 00	0.06
479	002617	露笑科技	2,500	18, 825. 00	0.06
480	301039	中集车辆	2,300	18, 699. 00	0.06
481	600637	东方明珠	2,500	18, 675. 00	0.06
482	000600	建投能源	2,700	18, 657. 00	0.06
483	002698	博实股份	1,200	18, 648. 00	0.06
484	301368	丰立智能	300	18, 549. 00	0.06
485	002678	珠江钢琴	3,600	18, 504. 00	0.06
486	600662	外服控股	3,600	18, 396. 00	0.06
487	002315	焦点科技	400	18, 276. 00	0.06
488	688239	航宇科技	520	18, 189. 60	0.06
489	600708	光明地产	5, 300	18, 179. 00	0.06
490	688049	炬芯科技	300	18, 150. 00	0.06
491	000507	珠海港	3, 300	18, 117. 00	0.06
492	002392	北京利尔	2,900	18, 096. 00	0.06

	ı		1		
493	688389	普门科技	1,400	18, 088. 00	0.06
494	688543	国科军工	300	18, 057. 00	0.06
495	600113	浙江东日	700	18, 046. 00	0.06
496	000060	中金岭南	3, 900	17, 862. 00	0.06
497	600018	上港集团	3, 100	17, 701. 00	0.06
498	002840	华统股份	1,700	17, 697. 00	0.06
499	002821	凯莱英	200	17, 650. 00	0.06
500	003039	顺控发展	1,300	17, 628. 00	0.06
501	688707	振华新材	1,300	17, 615. 00	0.06
502	600933	爱柯迪	1,100	17, 611. 00	0.06
503	688627	精智达	200	17, 602. 00	0.06
504	002990	盛视科技	600	17, 586. 00	0.06
505	002246	北化股份	1,200	17, 544. 00	0.06
506	003038	鑫铂股份	900	17, 541. 00	0.06
507	688102	斯瑞新材	1,300	17, 524. 00	0.06
508	300593	新雷能	1,300	17, 420. 00	0.06
509	603306	华懋科技	400	17, 400. 00	0.06
510	601963	重庆银行	1,600	17, 376. 00	0.06
511	600618	氯碱化工	1,800	17, 334. 00	0.06
512	300918	南山智尚	900	17, 307. 00	0.06
513	300678	中科信息	500	17, 290. 00	0.06
514	000801	四川九洲	1,100	17, 182. 00	0.06
515	688128	中国电研	700	17, 150. 00	0.06
516	600118	中国卫星	600	17, 142. 00	0.06
517	002243	力合科创	2, 100	17, 136. 00	0.06
518	600880	博瑞传播	3, 200	17, 120. 00	0.06
519	601801	皖新传媒	2,500	17, 075. 00	0.06
520	688548	广钢气体	1,700	17, 034. 00	0.06
521	301078	孩子王	1,300	16, 991. 00	0.06
522	301207	华兰疫苗	1,000	16, 860. 00	0.06
523	600621	华鑫股份	1,100	16, 841. 00	0.06
524	688361	中科飞测	200	16, 838. 00	0.06
525	301367	瑞迈特	200	16, 820. 00	0.06
526	600559	老白干酒	1,000	16, 750. 00	0.06
527	002605	姚记科技	600	16, 740. 00	0.06
528	603100	川仪股份	800	16, 504. 00	0.06
529	000636	风华高科	1,200	16, 488. 00	0.06
530	600583	海油工程	3,000	16, 380. 00	0.06
531	000539	粤电力 A	3,600	16, 344. 00	0.06
532	601126	四方股份	1,000	16, 270. 00	0.06
533	601330	绿色动力	2,100	16, 044. 00	0.05
534	603931	格林达	600	15, 972. 00	0.05
535	000685	中山公用	1,800	15, 804. 00	0.05

536	002469	三维化学	1,900	15, 789. 00	0.05
537	301366	一博科技	400	15, 672. 00	0.05
538	002020	京新药业	1, 200	15, 660. 00	0.05
539	688006	杭可科技	800	15, 600. 00	0.05
540	603699	纽威股份	500	15, 585. 00	0.05
541	300377	赢时胜	600	15, 570. 00	0.05
542	688155	先惠技术	300	15, 486. 00	0.05
543	002400	省广集团	2,000	15, 280. 00	0.05
544	601515	东峰集团	3,900	14, 898. 00	0.05
545	603693	江苏新能	1,100	14, 828. 00	0.05
546	300580	贝斯特	600	14, 742. 00	0.05
547	605168	三人行	500	14, 715. 00	0.05
548	002668	TCL 智家	1,500	14, 655. 00	0.05
549	605060	联德股份	700	14, 581. 00	0.05
550	300095	华伍股份	1,400	14, 504. 00	0.05
551	688088	虹软科技	300	14, 475. 00	0.05
552	301301	川宁生物	1,200	14, 448. 00	0.05
553	688196	卓越新能	300	14, 421. 00	0.05
554	300047	天源迪科	900	14, 355. 00	0.05
555	300684	中石科技	600	14, 328. 00	0.05
556	300142	沃森生物	1,300	14, 300. 00	0.05
557	002489	浙江永强	3,900	14, 274. 00	0.05
558	301128	强瑞技术	280	14, 229. 60	0.05
559	300963	中洲特材	620	14, 198. 00	0.05
560	688648	中邮科技	300	14, 151. 00	0.05
561	000700	模塑科技	1,800	14, 130. 00	0.05
562	603108	润达医疗	800	14, 128. 00	0.05
563	600184	光电股份	800	14, 048. 00	0.05
564	601369	陕鼓动力	1,600	14, 032. 00	0.05
565	688408	中信博	300	14, 004. 00	0.05
566	002632	道明光学	1,500	13, 950. 00	0.05
567	002608	江苏国信	1,900	13, 927. 00	0.05
568	300687	赛意信息	500	13, 890. 00	0.05
569	300681	英搏尔	500	13, 830. 00	0.05
570	300258	精锻科技	1,000	13, 820. 00	0.05
571	300579	数字认证	400	13, 804. 00	0.05
572	688351	微电生理	700	13, 790. 00	0.05
573	000631	顺发恒业	4,600	13, 708. 00	0.05
574	301196	唯科科技	200	13, 534. 00	0.05
575	600765	中航重机	800	13, 504. 00	0.05
576	301238	瑞泰新材	700	13, 454. 00	0.05
577	002941	新疆交建	1,200	13, 368. 00	0.05
578	601086	国芳集团	1,100	13, 365. 00	0.05

579	301180	万祥科技	900	13, 257. 00	0.05
580	300465	高伟达	800	13, 224. 00	0.05
581	601966	玲珑轮胎	900	13, 203. 00	0.05
582	600667	太极实业	2,000	13, 160. 00	0.05
583	002212	天融信	1,700	13, 090. 00	0.04
584	300590	移为通信	1,000	13, 010. 00	0.04
585	600888	新疆众和	1,900	12, 958. 00	0.04
586	300383	光环新网	900	12, 870. 00	0.04
587	301559	中集环科	800	12, 816. 00	0.04
588	002206	海利得	2,500	12, 775. 00	0.04
589	301141	中科磁业	200	12, 760. 00	0.04
590	603056	德邦股份	800	12, 736. 00	0.04
591	002550	千红制药	1,500	12, 600. 00	0.04
592	301220	亚香股份	280	12, 572. 00	0.04
593	000521	长虹美菱	1,800	12, 492. 00	0.04
594	603043	广州酒家	800	12, 464. 00	0.04
595	000009	中国宝安	1,400	12, 432. 00	0.04
596	688153	唯捷创芯	400	12, 404. 00	0.04
597	301526	国际复材	3,400	12, 376. 00	0.04
598	002192	融捷股份	400	12, 256. 00	0.04
599	300595	欧普康视	800	12, 216. 00	0.04
600	301016	雷尔伟	700	12, 187. 00	0.04
601	301116	益客食品	1,100	12, 155. 00	0.04
602	300337	银邦股份	1,100	12, 100. 00	0.04
603	600372	中航机载	1,000	12, 060. 00	0.04
604	301307	美利信	500	12, 050. 00	0.04
605	301501	恒鑫生活	245	12, 044. 20	0.04
606	000862	银星能源	2,200	12, 034. 00	0.04
607	688232	新点软件	400	12, 016. 00	0.04
608	601136	首创证券	600	11, 928. 00	0.04
608	603010	万盛股份	1,200	11, 928. 00	0.04
609	301071	力量钻石	400	11, 924. 00	0.04
610	300709	精研科技	300	11, 715. 00	0.04
611	300722	新余国科	300	11, 610. 00	0.04
612	688007	光峰科技	800	11, 568. 00	0.04
613	600717	天津港	2,500	11, 400. 00	0.04
614	300641	正丹股份	500	11, 395. 00	0.04
615	600446	金证股份	600	11, 382. 00	0.04
616	601326	秦港股份	3,500	11, 305. 00	0.04
617	600794	保税科技	2, 100	11, 193. 00	0.04
618	688236	春立医疗	600	11, 154. 00	0.04
619	300480	光力科技	700	11, 130. 00	0.04
620	601900	南方传媒	700	10, 948. 00	0.04

621	002344	海宁皮城	2,500	10, 850. 00	0.04
622	601598	中国外运	2, 200	10, 846. 00	0.04
623	601311	骆驼股份	1,200	10, 836. 00	0.04
624	600131	国网信通	600	10, 620. 00	0.04
625	300602	飞荣达	500	10, 605. 00	0.04
626	300253	卫宁健康	1,000	10, 600. 00	0.04
627	301211	亨迪药业	600	10, 536. 00	0.04
628	002670	国盛金控	700	10, 535. 00	0.04
629	003019	宸展光电	300	10, 509. 00	0.04
630	300352	北信源	1,900	10, 507. 00	0.04
631	300739	明阳电路	700	10, 388. 00	0.04
632	301209	联合化学	100	10, 374. 00	0.04
633	002655	共达电声	800	10, 368. 00	0.04
634	002446	盛路通信	1,400	10, 332. 00	0.04
634	600528	中铁工业	1,400	10, 332. 00	0.04
635	300357	我武生物	500	10, 320. 00	0.04
636	000791	甘肃能源	1,600	10, 208. 00	0.03
637	002419	天虹股份	1,900	10, 184. 00	0.03
638	603569	长久物流	1,300	10, 140. 00	0.03
639	002101	广东鸿图	800	10, 008. 00	0.03
640	688621	阳光诺和	200	9, 978. 00	0.03
641	301381	赛维时代	500	9, 975. 00	0.03
642	002302	西部建设	1,700	9, 860. 00	0.03
643	600217	中再资环	2,200	9, 856. 00	0.03
644	002523	天桥起重	2,700	9, 855. 00	0.03
645	600433	冠豪高新	3, 200	9, 824. 00	0.03
646	001301	尚太科技	200	9, 752. 00	0.03
646	688252	天德钰	400	9, 752. 00	0.03
647	300017	网宿科技	900	9, 648. 00	0.03
648	300570	太辰光	100	9, 638. 00	0.03
649	000762	西藏矿业	500	9, 590. 00	0.03
650	300905	宝丽迪	300	9, 585. 00	0.03
651	001258	立新能源	1,300	9, 555. 00	0.03
652	600919	江苏银行	800	9, 552. 00	0.03
653	688320	禾川科技	200	9, 458. 00	0.03
654	600121	郑州煤电	2,400	9, 456. 00	0.03
655	600475	华光环能	900	9, 378. 00	0.03
656	600508	上海能源	800	9, 360.00	0.03
657	600330	天通股份	1,300	9, 321.00	0.03
658	301268	铭利达	500	9, 275. 00	0.03
659	601096	宏盛华源	2, 200	9, 108. 00	0.03
660	688777	中控技术	200	8, 982. 00	0.03
661	603533	掌阅科技	400	8, 924. 00	0.03

662	002216	三全食品	800	8, 856. 00	0.03
662	600529	山东药玻	400	8, 856. 00	0.03
663	002250	联化科技	800	8, 800. 00	0.03
664	002434	万里扬	1, 200	8, 796. 00	0.03
665	601200	上海环境	1, 100	8, 734. 00	0.03
666	605188	国光连锁	800	8, 720. 00	0.03
667	002060	广东建工	2,500	8, 700. 00	0.03
667	603877	太平鸟	600	8, 700. 00	0.03
668	600571	信雅达	500	8, 630. 00	0.03
669	002423	中粮资本	700	8, 561. 00	0.03
670	603368	柳药集团	500	8, 455. 00	0.03
671	002004	华邦健康	2,000	8, 340. 00	0.03
672	688400	凌云光	300	8, 271. 00	0.03
673	688261	东微半导	200	8, 250. 00	0.03
674	002746	仙坛股份	1,400	8, 148. 00	0.03
675	300213	佳讯飞鸿	900	8, 145. 00	0.03
676	688035	德邦科技	200	8, 124. 00	0.03
677	301160	翔楼新材	100	8,008.00	0.03
678	688601	力芯微	200	7, 990. 00	0.03
679	605086	龙高股份	300	7, 986. 00	0.03
680	601579	会稽山	400	7, 964. 00	0.03
681	300926	博俊科技	300	7, 941. 00	0.03
682	000156	华数传媒	1,000	7, 940. 00	0.03
683	600039	四川路桥	800	7, 920. 00	0.03
683	600284	浦东建设	1,200	7, 920. 00	0.03
683	688739	成大生物	300	7, 920. 00	0.03
684	003022	联泓新科	500	7, 915. 00	0.03
685	001979	招商蛇口	900	7, 893. 00	0.03
686	600995	南网储能	800	7, 824. 00	0.03
687	300354	东华测试	200	7, 776. 00	0.03
688	600038	中直股份	200	7, 762. 00	0.03
689	600861	北京人力	400	7, 720. 00	0.03
690	688009	中国通号	1,500	7, 710. 00	0.03
691	300131	英唐智控	1,000	7, 680. 00	0.03
692	603082	北自科技	200	7, 650. 00	0.03
693	688678	福立旺	400	7, 616. 00	0.03
694	000726	鲁泰 A	1,200	7, 608. 00	0.03
695	301090	华润材料	1,000	7, 530. 00	0.03
696	002271	东方雨虹	700	7, 511. 00	0.03
697	603960	克来机电	400	7, 508. 00	0.03
698	603429	集友股份	800	7, 496. 00	0.03
699	000534	万泽股份	500	7, 460. 00	0.03
700	688100	威胜信息	200	7, 410. 00	0.03

	ı		1		
701	601518	吉林高速	2,700	7, 398. 00	0.03
702	688112	鼎阳科技	200	7, 394. 00	0.03
703	600876	凯盛新能	700	7, 385. 00	0.03
704	002997	瑞鹄模具	200	7, 370. 00	0.03
705	300327	中颖电子	300	7, 266. 00	0.02
706	601607	上海医药	400	7, 152. 00	0.02
707	002531	天顺风能	1,000	7, 140. 00	0.02
708	603160	汇顶科技	100	7, 103. 00	0.02
709	600269	赣粤高速	1,400	7, 084. 00	0.02
710	600668	尖峰集团	500	7, 075. 00	0.02
711	301119	正强股份	200	7, 072. 00	0.02
711	600966	博汇纸业	1,600	7,072.00	0.02
712	603019	中科曙光	100	7, 040. 00	0.02
713	002544	普天科技	300	7, 035. 00	0.02
714	002401	中远海科	400	6, 944. 00	0.02
715	000925	众合科技	900	6, 912. 00	0.02
715	605020	永和股份	300	6, 912. 00	0.02
716	601000	唐山港	1,700	6, 902. 00	0.02
717	600138	中青旅	700	6, 895. 00	0.02
718	600251	冠农股份	900	6, 867. 00	0.02
719	301029	怡合达	300	6, 858. 00	0.02
720	600032	浙江新能	900	6, 804. 00	0.02
721	603283	赛腾股份	200	6, 788. 00	0.02
722	002518	科士达	300	6, 777. 00	0.02
723	002635	安洁科技	500	6, 770. 00	0.02
724	600570	恒生电子	200	6, 708. 00	0.02
725	002472	双环传动	200	6, 698. 00	0.02
726	605228	神通科技	600	6, 594. 00	0.02
727	600335	国机汽车	1,000	6, 450. 00	0.02
728	002553	南方精工	300	6, 444. 00	0.02
729	002791	坚朗五金	300	6, 420. 00	0.02
730	002466	天齐锂业	200	6, 408. 00	0.02
731	603977	国泰集团	500	6, 275. 00	0.02
732	300705	九典制药	400	6, 228. 00	0.02
733	000089	深圳机场	900	6, 210. 00	0.02
734	688139	海尔生物	200	6, 178. 00	0.02
735	301246	宏源药业	400	6, 040. 00	0.02
736	002950	奥美医疗	700	6,020.00	0.02
737	301015	百洋医药	300	6,018.00	0.02
738	002399	海普瑞	500	5, 955. 00	0.02
739	605368	蓝天燃气	600	5, 904. 00	0.02
740	600824	益民集团	1,400	5, 838. 00	0.02
741	600586	金晶科技	1,200	5, 796. 00	0.02

742	002242	九阳股份	600	5, 700. 00	0.02
743	600033	福建高速	1,600	5, 664. 00	0.02
744	300946	恒而达	120	5, 647. 20	0.02
745	000905	厦门港务	700	5, 635. 00	0.02
746	000888	峨眉山 A	400	5, 624. 00	0.02
747	300388	节能国祯	800	5, 568. 00	0.02
748	688819	天能股份	200	5, 552. 00	0.02
749	603087	甘李药业	100	5, 478. 00	0.02
750	600746	江苏索普	700	5, 467. 00	0.02
751	300263	隆华科技	700	5, 425. 00	0.02
752	002973	侨银股份	400	5, 408. 00	0.02
753	600956	新天绿能	700	5, 404. 00	0.02
754	300847	中船汉光	300	5, 343. 00	0.02
755	688334	西高院	300	5, 154. 00	0.02
756	002025	航天电器	100	5, 141. 00	0.02
757	000921	海信家电	200	5, 140. 00	0.02
758	600510	黑牡丹	1,000	5, 090. 00	0.02
759	600212	绿能慧充	600	5, 064. 00	0.02
760	300740	水羊股份	300	5, 025. 00	0.02
761	002270	华明装备	300	5, 022. 00	0.02
762	603162	海通发展	600	5, 010. 00	0.02
763	600428	中远海特	800	5, 000. 00	0.02
764	000028	国药一致	200	4, 986. 00	0.02
765	600611	大众交通	800	4, 976. 00	0.02
766	603609	禾丰股份	600	4, 956. 00	0.02
767	605339	南侨食品	300	4, 953. 00	0.02
768	600987	航民股份	700	4, 949. 00	0.02
769	603275	众辰科技	100	4, 939. 00	0.02
770	301389	隆扬电子	200	4, 924. 00	0.02
771	301101	明月镜片	100	4, 895. 00	0.02
772	600850	电科数字	200	4, 838. 00	0.02
773	300143	盈康生命	500	4, 815. 00	0.02
774	603327	福蓉科技	520	4, 810. 00	0.02
775	002277	友阿股份	800	4, 808. 00	0.02
776	002935	天奥电子	300	4, 800. 00	0.02
776	603277	银都股份	300	4, 800. 00	0.02
777	300307	慈星股份	600	4, 794. 00	0.02
778	301000	肇民科技	100	4, 764. 00	0.02
779	603299	苏盐井神	500	4, 735. 00	0.02
780	002922	伊戈尔	300	4, 719. 00	0.02
781	300620	光库科技	100	4, 711. 00	0.02
782	002007	华兰生物	300	4, 701. 00	0.02
783	603119	浙江荣泰	100	4, 624. 00	0.02

783	603291	联合水务	400	4, 624. 00	0.02
784	300698	万马科技	100	4, 618. 00	0.02
785	002521	齐峰新材	500	4, 570. 00	0.02
786	300443	金雷股份	200	4, 520. 00	0.02
787	002225	濮耐股份	900	4, 455. 00	0.02
788	601800	中国交建	500	4, 445. 00	0.02
789	601083	锦江航运	400	4, 444. 00	0.02
790	000519	中兵红箭	200	4, 378. 00	0.01
791	601811	新华文轩	300	4, 371. 00	0.01
792	601116	三江购物	400	4, 356. 00	0.01
793	301215	中汽股份	700	4, 340. 00	0.01
794	600106	重庆路桥	700	4, 291. 00	0.01
794	603171	税友股份	100	4, 291. 00	0.01
795	002301	齐心集团	600	4, 278. 00	0.01
796	000404	长虹华意	600	4, 260. 00	0.01
797	601199	江南水务	800	4, 224. 00	0.01
798	603301	振德医疗	200	4, 222. 00	0.01
799	002448	中原内配	500	4, 185. 00	0.01
800	601375	中原证券	1,000	4, 160. 00	0.01
801	601808	中海油服	300	4, 128. 00	0.01
802	002765	蓝黛科技	300	4,017.00	0.01
803	001872	招商港口	200	3, 972. 00	0.01
804	002584	西陇科学	400	3, 948. 00	0.01
805	000039	中集集团	500	3, 930. 00	0.01
806	600081	东风科技	300	3, 927. 00	0.01
807	002430	杭氧股份	200	3, 884. 00	0.01
808	002108	沧州明珠	1,000	3,860.00	0.01
809	688459	哈铁科技	400	3, 840. 00	0.01
810	601882	海天精工	200	3, 820. 00	0.01
811	002327	富安娜	500	3, 710. 00	0.01
812	600271	航天信息	400	3, 696. 00	0.01
813	600211	西藏药业	100	3, 682. 00	0.01
814	600820	隧道股份	600	3,660.00	0.01
815	300138	晨光生物	300	3, 636. 00	0.01
816	002901	大博医疗	100	3, 624. 00	0.01
817	001965	招商公路	300	3,600.00	0.01
818	301199	迈赫股份	140	3, 572. 80	0.01
819	000973	佛塑科技	500	3, 560. 00	0.01
820	002960	青鸟消防	360	3, 517. 20	0.01
821	600298	安琪酵母	100	3, 517. 00	0.01
822	002293	罗莱生活	400	3, 496. 00	0.01
823	300628	亿联网络	100	3, 476. 00	0.01
824	300446	航天智造	200	3, 464. 00	0.01

824	603357	设计总院	400	3, 464. 00	0.01
825	002312	川发龙蟒	300	3, 444. 00	0.01
826	000601	韶能股份	700	3, 402. 00	0.01
827	301013	利和兴	200	3, 390. 00	0.01
828	002519	银河电子	600	3, 354. 00	0.01
829	300805	电声股份	300	3, 300. 00	0.01
830	301370	国科恒泰	300	3, 195. 00	0.01
831	300545	联得装备	100	3, 180. 00	0.01
832	603590	康辰药业	100	3, 144. 00	0.01
833	600435	北方导航	200	3, 118. 00	0.01
834	002526	山东矿机	800	3, 088. 00	0.01
835	603848	好太太	200	3, 080. 00	0.01
836	002911	佛燃能源	300	3, 078. 00	0.01
837	600377	宁沪高速	200	3, 068. 00	0.01
838	605128	上海沿浦	100	3, 026. 00	0.01
839	600216	浙江医药	200	2, 958. 00	0.01
840	002345	潮宏基	200	2, 926. 00	0.01
841	688575	亚辉龙	200	2, 918. 00	0.01
842	603053	成都燃气	300	2, 883. 00	0.01
843	002675	东诚药业	200	2, 878. 00	0.01
844	002803	吉宏股份	200	2, 852. 00	0.01
845	002138	顺络电子	100	2, 812. 00	0.01
846	600848	上海临港	300	2, 721. 00	0.01
847	300783	三只松鼠	100	2, 711. 00	0.01
848	600971	恒源煤电	400	2, 640. 00	0.01
849	601139	深圳燃气	400	2, 544. 00	0.01
850	002255	海陆重工	300	2, 526. 00	0.01
851	002083	孚日股份	500	2, 415. 00	0.01
852	601186	中国铁建	300	2, 403. 00	0.01
853	600874	创业环保	400	2, 388. 00	0.01
854	000877	天山股份	500	2, 320. 00	0.01
855	600482	中国动力	100	2, 307. 00	0.01
856	301123	奕东电子	100	2, 281. 00	0.01
857	002461	珠江啤酒	200	2, 258. 00	0.01
858	603057	紫燕食品	100	2, 186. 00	0.01
859	000650	仁和药业	400	2, 168. 00	0.01
860	603611	诺力股份	100	2, 154. 00	0.01
861	000411	英特集团	200	2, 144. 00	0.01
862	600548	深高速	200	2, 094. 00	0.01
863	001288	运机集团	100	2, 083. 00	0.01
864	688403	汇成股份	200	2, 078. 00	0.01
865	300222	科大智能	200	2, 038. 00	0.01
866	002061	浙江交科	500	1, 980. 00	0.01

867	603826	坤彩科技	100	1, 957. 00	0.01
868	300566	激智科技	100	1, 949. 00	0.01
869	002218	拓日新能	600	1, 944. 00	0.01
870	300802	矩子科技	100	1, 884. 00	0.01
871	001260	坤泰股份	100	1,883.00	0.01
872	603055	台华新材	200	1,826.00	0.01
873	603206	嘉环科技	100	1,718.00	0.01
874	002737	葵花药业	100	1, 572. 00	0.01
875	600008	首创环保	500	1,510.00	0.01
876	300248	新开普	100	1, 499. 00	0.01
877	001356	富岭股份	100	1, 455. 00	0.00
878	603219	富佳股份	100	1, 451. 00	0.00
879	603938	三孚股份	100	1, 438. 00	0.00
880	300869	康泰医学	100	1, 434. 00	0.00
881	300040	九洲集团	200	1, 416. 00	0.00
882	605300	佳禾食品	100	1, 401. 00	0.00
883	002152	广电运通	100	1, 344. 00	0.00
884	002240	盛新锂能	100	1, 288. 00	0.00
885	002361	神剑股份	200	1, 254. 00	0.00
886	603170	宝立食品	100	1, 247. 00	0.00
887	603303	得邦照明	100	1, 207. 00	0.00
888	600388	龙净环保	100	1, 200. 00	0.00
889	605007	五洲特纸	100	1, 151. 00	0.00
890	300276	三丰智能	100	1, 100. 00	0.00
891	600497	驰宏锌锗	200	1, 058. 00	0.00
892	603901	永创智能	100	1,054.00	0.00
893	002449	国星光电	100	1,008.00	0.00
894	300320	海达股份	100	994.00	0.00
895	600737	中粮糖业	100	945.00	0.00
896	002238	天威视讯	100	881.00	0.00
897	601827	三峰环境	100	840.00	0.00
898	600064	南京高科	100	771.00	0.00
899	000886	海南高速	100	672.00	0.00
900	600973	宝胜股份	100	506.00	0.00
901	601636	旗滨集团	100	501.00	0.00
902	002562	兄弟科技	100	488.00	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

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	688347	华虹公司	440, 189. 41	2.01
2	000766	通化金马	370, 753. 00	1.70

3	300304	云意电气	323, 663. 00	1.48
4	002497	雅化集团	308, 473. 00	1.41
5	688484	南芯科技	301, 120. 70	1.38
6	688608	恒玄科技	287, 131. 00	1.31
7	300779	惠城环保	286, 288. 00	1.31
8	603799	华友钴业	273, 128. 00	1.25
9	300346	南大光电	268, 682. 00	1.23
10	600259	广晟有色	261, 550. 00	1.20
11	600330	天通股份	260, 103. 00	1.19
12	688588	凌志软件	254, 102. 35	1.16
13	603738	泰晶科技	248, 207. 00	1.14
14	002706	良信股份	247, 771.00	1.13
15	301219	腾远钴业	245, 500. 00	1.12
16	000021	深科技	244, 253. 00	1.12
17	002126	银轮股份	233, 581. 00	1.07
18	002215	诺普信	229, 735. 00	1.05
19	002249	大洋电机	229, 428. 00	1.05
20	600143	金发科技	223, 467. 00	1.02

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

				亚叔干区: 八八八中八
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	688347	华虹公司	471, 513. 11	2. 16
2	300304	云意电气	343, 650. 00	1.57
3	688608	恒玄科技	325, 575. 00	1.49
4	000766	通化金马	314, 756. 00	1.44
5	002126	银轮股份	312, 953. 00	1.43
6	002497	雅化集团	303, 183. 00	1.39
7	688166	博瑞医药	294, 032. 36	1.35
8	002249	大洋电机	290, 431. 00	1.33
9	600330	天通股份	266, 844. 00	1. 22
10	603799	华友钴业	260, 760. 00	1. 19
11	688484	南芯科技	259, 356. 89	1. 19
12	002706	良信股份	259, 049. 00	1. 19
13	603738	泰晶科技	258, 406. 00	1. 18
14	600259	广晟有色	257, 044. 00	1. 18
15	605589	圣泉集团	250, 287. 00	1.15
16	600120	浙江东方	245, 482. 00	1.12
17	300451	创业慧康	240, 009. 00	1.10
18	300115	长盈精密	239, 207. 00	1.09

19	000917	电广传媒	233, 116. 00	1.07
20	600446	金证股份	231, 751.00	1.06

- 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	79, 567, 396. 60
卖出股票收入 (成交) 总额	75, 654, 746. 49

- 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	1,607,051.84	5. 50
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	1,607,051.84	5. 50

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

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	019766	25 国债 01	16,000	1, 607, 051. 84	5. 50

- 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在被监管部门立案调查,或在报告编制目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	8, 925. 93
2	应收清算款	245, 248. 48
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	1,009.71
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	-
9	合计	255, 184. 12

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

本基金本报告期末前十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

1八 安百 50 日i		內45445461	
份额级别	特有人	1 尺段接角的悬	特有人结构
′′′′ (′′′) (11 12 /	/ 八八八八 口 日 八二二	11 12 7 7 7 17 17

	户数	金份额	机构投资者		个人投资者	
	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
东方量化 多策略混 合 A	510	57, 872. 53	24, 732, 161. 50	83. 80	4, 782, 826. 40	16. 20
东方量化 多策略混 合 C	64	95, 856. 56	0.00	0.00	6, 134, 819. 90	100.00
合计	574	62, 107. 68	24, 732, 161. 50	69. 38	10, 917, 646. 30	30. 62

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	东方量化多策略混合 A	823, 366. 23	2.79
理人所 有从业 人员持 有本基 金	东方量化多策略混合 C	1.01	0.00
	合计	823, 367. 24	2.31

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、	东方量化多策略混合 A	0
基金投资和研究部门 负责人持有本开放式 基金	东方量化多策略混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有	东方量化多策略混合 A	0~10
本开放式基金	东方量化多策略混合C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合C
基金合同生效日		
(2019年2月22日)	330, 005, 184. 34	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份	29, 691, 168. 91	40, 013. 84
额总额	29, 091, 100. 91	40, 013. 84
本报告期基金总申购	1, 682, 806. 44	43, 731, 731. 14

份额		
减:本报告期基金总赎回份额	1, 858, 987. 45	37, 636, 925. 08
本报告期基金拆分变 动份额	_	_
本报告期期末基金份 额总额	29, 514, 987. 90	6, 134, 819. 90

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

2025年4月8日,基金管理人发布了《东方基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告》,自2025年4月7日起张晓丹女士担任公司副总经理,秦熠群先生担任首席信息官,刘鸿鹏先生不再担任首席信息官。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。

2025年2月,中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025年3月,中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025年4月,中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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、基金托管业务的诉讼。

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

本报告期内,本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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

		股票	厚交易	应支付该券		
券商名称	交易单元 数量	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 (%)	备注
浙商证券 股份有限 公司	2	96, 935, 402. 6 0	62. 45	43, 223. 23	62. 45	_
长江证券 股份有限 公司	2	38, 793, 967. 7 6	24. 99	17, 298. 56	24. 99	_
德邦证券 股份有限 公司	2	19, 492, 772. 7 3	12. 56	8, 692. 22	12. 56	_
光大证券 股份有限 公司	2	_	_	_	_	_
申万宏源 证券有限 公司	2	I		I	_	_
太平洋证 券股份有 限公司	2	1		-	_	_
兴业证券 股份有限 公司	2	-		-	_	_
恒泰证券 股份有限 公司	2	_	_	-	_	-
首创证券 股份有限 公司	2	-	_	_	_	_

注: (1) 此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

(2) 交易单元的选择标准和程序

券商选择标准:①资力雄厚,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。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚,或处罚未对其研究服务业务产生重大影响;④合规风

控能力较强,具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制;⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格,能够提供高效、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具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格,建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制,具备独立客观的研究观点,能够提供各类研究服务支持,形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等;⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象;⑧证监会券商分类标准原则上CCC级以下不纳入合作对象;⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

券商选择程序:每年定期根据已租用交易单元的券商提供的资质说明,经交易佣金管理小组 审议通过后,建立公司内部券商白名单。如有新增券商,在履行上述程序通过后,可不定期加入 公司内部白名单。

- (3) 本报告期内租用首创证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司上海、深圳交易单元各一个。
- (4)根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》,自2024年7月1日起,基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率,且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用;其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用,但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍,且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

2024年7月1日前,该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自2024年7月1日起,券商仅为本基金提供交易单元租用以及研究服务。

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

	债券多	交易	债券回见	购交易	权证法	た 易
券商名 称	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(%)
浙商证 券股份 有限公 司	2, 996, 489. 0 0	85. 71	600, 000. 00	27. 27	1	-
长江证 券股份 有限公 司	499, 756. 00	14. 29	1, 300, 000. 00	59.09	_	-

德邦证						
券股份	_	_	300, 000. 00	13.64	_	_
有限公			300, 000. 00	13.04		
司						
光大证						
券股份	_	_	_	_	_	_
有限公						
司						
申万宏						
源证券	_	_	_	_	_	_
有限公						
司						
太平洋						
证券股	_	_	_	_	_	_
份有限						
公司						
兴业证						
券股份	_	_	_	_	_	_
有限公						
司						
恒泰证						
券股份	_	_	_	_	_	_
有限公						
司						
首创证						
券股份	_	_	_	_	_	_
有限公						
司						

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	东方量化多策略混合型证券投资基金 2024年第4季度报告	基金管理人网站及中国	9095年1月99日			
1		证监会基金电子披露网 站	2025年1月22日			
2	关于增加海通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	2025年3月15日			
3	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	2025年3月29日			
4	东方基金管理股份有限公司旗下公募	证券时报、证券日报、	2025年3月31日			

	基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024下半年度)	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	
5	东方量化多策略混合型证券投资基金 2024年年度报告	基金管理人网站及中国 证监会基金电子披露网 站	2025年3月31日
6	关于增加华西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	2025 年 4 月 2 日
7	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	2025 年 4 月 8 日
8	关于增加杭州银行股份有限公司杭 E 家平台为公司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	2025 年 4 月 8 日
9	东方基金管理股份有限公司基金行业 高级管理人员变更公告	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	2025 年 4 月 8 日
10	东方量化多策略混合型证券投资基金 2025 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	2025年4月22日
11	关于东方基金管理股份有限公司旗下 部分基金参加浙商银行股份有限公司 转换补差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	2025年5月13日
12	东方基金管理股份有限公司关于终止 民商基金销售(上海)有限公司办理 本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	2025年5月28日
13	关于增加中邮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	2025年6月12日

- 1		= - \ \ \ \ \ \	
- 1		[褒 xx 立占	
- 1		四十二十二十二	

§ 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

		报告期内持有基金份额变化情况			报告期末持有基金情况		
投资者 类别	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时 间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比 (%)
机构	1	20250101 - 20250630	24, 732, 16 1. 50	0.00	0.00	24, 732, 161. 50	69. 38

产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

- (1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本,可能造成基金净值的波动。
- (2)当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时,基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理,可能会影响投资者赎回。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方量化多策略混合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 2025年8月29日