

东方新策略灵活配置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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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
1.1 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 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	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方新策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东方新策略灵活配置混合	
基金主代码	001318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 26 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	199,049,209.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001318	002060
报告期末下属分级基金的份额总额	27,346,127.83 份	171,703,081.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险的前提下，结合灵活的资产配置和多种投资策略，充分把握市场机会，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对类别资产的灵活配置，调整不同时期内基金的整体风险与收益水平，并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券，获得基金的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债总全价指数收益率×30%
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	王茵
	联系电话	010-66295888	010-63639180
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95595
传真		010-66578700	010-63639132
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100073	100033

法定代表人	崔伟	吴利军
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 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 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
本期已实现收益	227,911.19	1,705,695.42
本期利润	817,896.69	-156,609.38
加权平均基金份 额本期利润	0.0316	-0.0014
本期加权平均净 值利润率	2.85%	-0.13%
本期基金份额净 值增长率	3.24%	3.16%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-1,346,270.86	-7,788,328.89
期末可供分配基 金份额利润	-0.0492	-0.0454
期末基金资产净 值	31,064,436.66	196,196,310.75
期末基金份额净 值	1.1360	1.1426
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	13.60%	13.40%
-------------	--------	--------

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

东方新策略灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.39%	0.54%	1.84%	0.40%	1.55%	0.14%
过去三个月	2.00%	1.08%	1.22%	0.75%	0.78%	0.33%
过去六个月	3.24%	0.90%	-0.03%	0.70%	3.27%	0.20%
过去一年	1.04%	1.15%	10.78%	0.96%	-9.74%	0.19%
过去三年	-12.63%	0.89%	-5.94%	0.76%	-6.69%	0.13%
自基金合同生效起至今	13.60%	0.62%	-8.92%	0.95%	22.52%	-0.33%

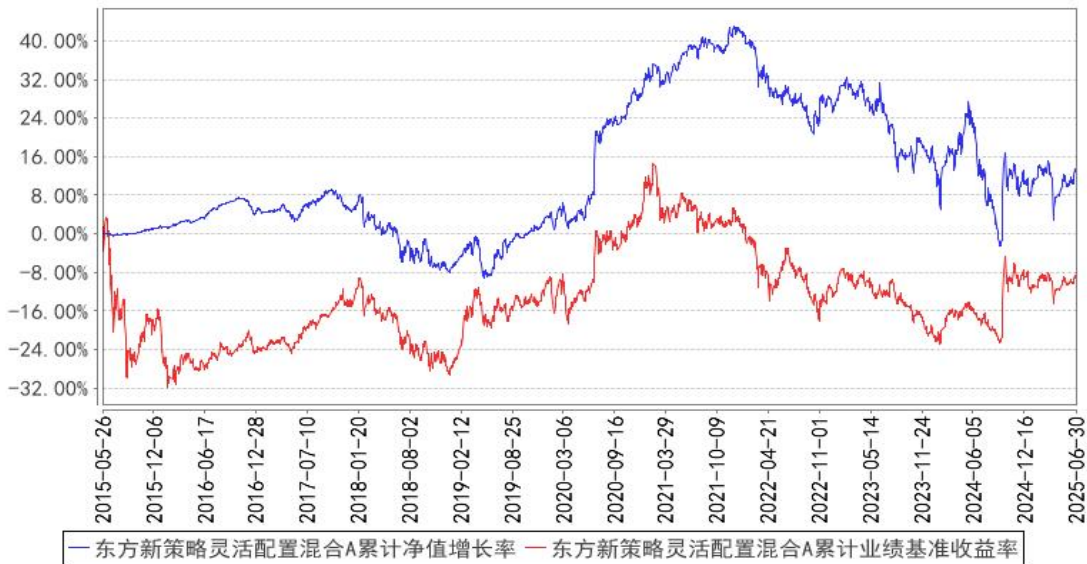
东方新策略灵活配置混合 C

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	3.39%	0.54%	1.84%	0.40%	1.55%	0.14%
过去三个月	2.01%	1.08%	1.22%	0.75%	0.79%	0.33%
过去六个月	3.16%	0.90%	-0.03%	0.70%	3.19%	0.20%
过去一年	0.81%	1.15%	10.78%	0.96%	-9.97%	0.19%
过去三年	-13.37%	0.89%	-5.94%	0.76%	-7.43%	0.13%
自基金合同生效起	13.40%	0.64%	10.26%	0.84%	3.14%	-0.20%

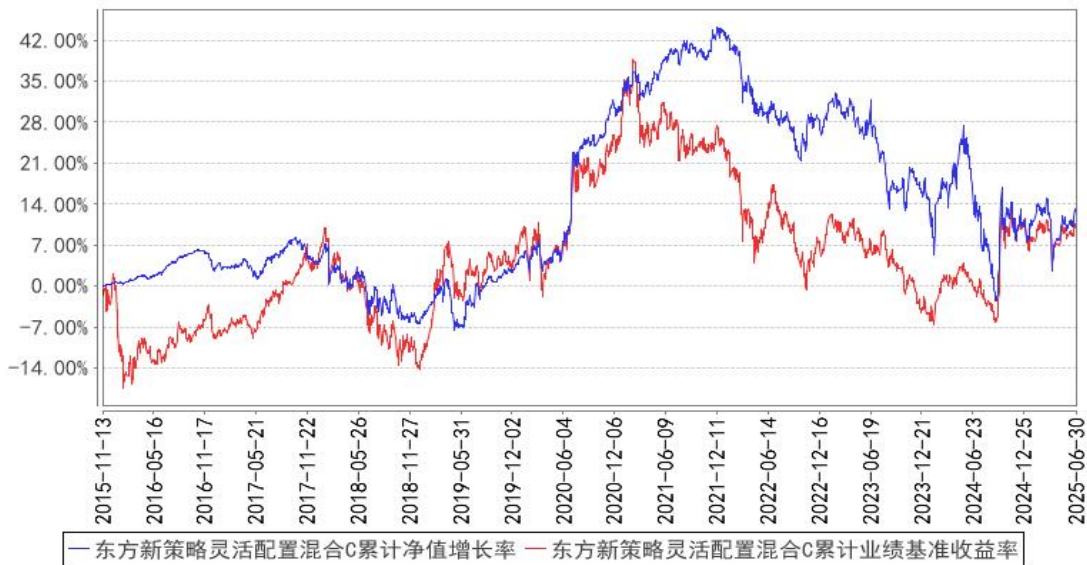
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东方新策略灵活配置混合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



东方新策略灵活配置混合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



§ 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

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		
王芳玲	本基金基金经理	2023 年 11 月 13 日	-	11 年	吉林大学数量经济学专业硕士，11 年证券从业经历。曾任东北证券股份有限公司产品助理、东证融汇证券资产管理有限公司投资主办人。2018 年加盟本基金管理人，曾任专户投资部投资经理助理、权益研究部资深研究员，东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理助理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新策略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、《东方新策略灵活配置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

根据 Wind 数据显示，2025 年上半年，上证指数上涨 2.76%、沪深 300 上涨 0.03%、中证 500 上涨 3.31%、中证 2000 上涨 15.24%、创业板指上涨 0.53%、科创 50 上涨 1.46%。A 股主要指数呈现分化态势，中小市值证券的关注度显著提升，以沪深 300 为代表的大盘股指数表现相对乏力。申万一级行业涨幅前五的行业分别是有色金属、银行、国防军工、传媒、通信，跌幅前五的行业分别是煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰。

报告期内，在全球贸易摩擦升级和地缘政治冲突加剧的背景下，资本市场整体波动显著加剧。

分板块表现来看，贵金属价格延续上行趋势，稀土、钨等金属的战略属性进一步凸显，相关公司股价表现较好；银行资产的红利属性进一步得到资本市场认可；人工智能技术迭代持续推进，光模块、PCB 等细分赛道展现出较强的上涨动能，DeepSeek 的出现亦增加了市场对 AI 应用的关注，部分 AI 应用公司已经进入到订单收入增长阶段；人形机器人在政策支持、技术创新和行业巨头的共同推动下，市场热度较高；部分创新药研发管线海外授权的落地，提升了创新药产业的景气度；受宏观经济不确定性加大、消费复苏进程缓慢等因素影响，以食品饮料为代表的内需消费行业表现相对疲弱。

产品组合秉持多元化、中长期的投资理念，在报告期内增加了行业覆盖广度，优选各行业的龙头公司，淡化短期外部事件冲击及企业经营周期的影响，拉长持股周期，重视中长期的投资回报。本基金将坚持这种投资策略，以期实现资产的稳健增值与长期回报。

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 3.24%，业绩比较基准收益率为-0.03%，高于业绩比较基准 3.27%；本基金 C 类净值增长率为 3.16%，业绩比较基准收益率为-0.03%，高于业绩比较基准 3.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，贸易摩擦有所缓和，美国资本市场不断上演 TACO 交易，美股呈现先跌后涨态势，美债收益率维持在 4.0%-4.5% 区间震荡，贸易摩擦对美国国内通胀的传导效应低于预期，但美联储对通胀数据反复保持警惕，降息路径如先前预期仍将较为曲折。当前美国货币政策空间较大，随着其就业数据持续走弱，美国经济“软着陆”的概率不断上升；此外，特朗普持续向美联储施压，也可能加大降息的概率和幅度。地缘政治及冲突方面，在经历局部冲击后，呈现缓和迹象，其对资产价格的冲击亦表现为脉冲式特征，后续主导海外大类资产价格走势的核心因素仍将是海外基本面因素。

当前，国内政策的积极导向鲜明，政策表态密集释放，大型基建项目和育儿补贴等刺激性政策如期推出。预计后续货币政策与财政政策仍将延续提质加力的导向，持续营造良好的政策环境。通过适时降准降息等措施保持流动性充裕，通过扩大财政支出、优化税收等手段，加大对实体经济关键领域的支持和投入，全方位助推实体经济高质量发展。在经济向好发展的预期下，权益市场也将涌现出更多的投资机会。

行业走势展望方面：1) AI 产业仍处于快速创新迭代的发展阶段，全产业链蕴含着丰富的投资机会；2) 刚需医药领域始终是我们重点聚焦的方向，部分创新药研发管线出海项目接连落地，推动创新药上下游产业链走向基本面右侧，值得持续关注；3) 周期领域中，除了我们持续看好的

贵金属，其他小金属的投资机会也在增加；4）消费领域受宏观经济不确定性加大、消费复苏进程缓慢等因素影响，目前投资机会相对有限。

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，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，本基金管理人已采取持续营销等措施并已将此情况上报中国证监会。截至报告期末，本基金基金资产净值已达到五千万元以上。

§ 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在东方新策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：东方新策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	887,479.25	432,624.41
结算备付金		622,686.03	479,025.88
存出保证金		63,967.09	15,035.51
交易性金融资产	6.4.7.2	219,532,280.90	20,672,000.63
其中：股票投资		206,461,707.36	19,059,582.00
基金投资		-	-
债券投资		13,070,573.54	1,612,418.63
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	6,900,000.00	4,199,645.89
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		-	302,233.94
应收股利		-	-
应收申购款		79.92	219.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		228,006,493.19	26,100,786.02
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		399,386.96	59,703.83
应付赎回款		442.24	30,630.88
应付管理人报酬		146,727.43	17,668.59
应付托管费		36,681.88	4,417.12
应付销售服务费		1,581.08	51.01
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	6.4.7.7	160,926.19	208,861.46
负债合计		745,745.78	321,332.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	199,049,209.28	23,428,108.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	28,211,538.13	2,351,344.85
净资产合计		227,260,747.41	25,779,453.13
负债和净资产总计		228,006,493.19	26,100,786.02

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，东方新策略灵活配置混合 A 基金份额净值 1.1360 元，基金份额总额 27,346,127.83 份；东方新策略灵活配置混合 C 基金份额净值 1.1426 元，基金份额总额 171,703,081.45 份。东方新策略灵活配置混合份额总额合计为 199,049,209.28 份。

6.2 利润表

会计主体：东方新策略灵活配置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

项 目	附注号	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
一、营业总收入		1,427,156.88	-1,352,903.95
1. 利息收入		71,168.15	71,679.44
其中：存款利息收入	6.4.7.10	14,173.69	14,131.58
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		45,491.83	57,547.86
其他利息收入		11,502.63	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,626,909.10	943,795.69
其中：股票投资收益	6.4.7.11	362,189.60	428,820.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	52,201.00	31,060.37
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	2,212,518.50	483,914.70
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认产		-	-
生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.17	-1,272,319.30	-2,471,555.07
失以“-”号填列）			
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-
号填列）			
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	1,398.93	103,175.99
号填列）			
减：二、营业总支出		765,869.57	220,392.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	591,748.11	136,700.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	147,936.98	34,175.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	20,048.00	247.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-
支出			
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	6,136.48	49,268.75
三、利润总额（亏损总额		661,287.31	-1,573,296.62
以“-”号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		661,287.31	-1,573,296.62
号填列）			
五、其他综合收益的税后		-	-
净额			
六、综合收益总额		661,287.31	-1,573,296.62

6.3 净资产变动表

会计主体：东方新策略灵活配置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

项目	本期 2025 年 1 月 1 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	23,428,108.28	-	2,351,344.85	25,779,453.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	23,428,108.28	-	2,351,344.85	25,779,453.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	175,621,101.00	-	25,860,193.28	201,481,294.28
（一）、综合收益总额	-	-	661,287.31	661,287.31
（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）	175,621,101.00	-	25,198,905.97	200,820,006.97
其中：1. 基金申购款	183,613,544.79	-	26,100,282.09	209,713,826.88
2. 基金赎回款	-7,992,443.79	-	-901,376.12	-8,893,819.91
（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	199,049,209.28	-	28,211,538.13	227,260,747.41
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 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	33,298,468.29	-	5,820,095.07	39,118,563.36

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	33,298,468.29	-	5,820,095.07	39,118,563.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,320,131.77	-	-2,588,931.73	-9,909,063.50
（一）、综合收益总额	-	-	-1,573,296.62	-1,573,296.62
（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）	-7,320,131.77	-	-1,015,635.11	-8,335,766.88
其中：1. 基金申购款	11,746,376.65	-	1,497,027.08	13,243,403.73
2. 基金赎回款	-19,066,508.42	-	-2,512,662.19	-21,579,170.61
（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	25,978,336.52	-	3,231,163.34	29,209,499.86

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：

刘鸿鹏

基金管理人负责人

刘鸿鹏

主管会计工作负责人

王丹丹

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方新策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 4 月 30 日中国
第 19 页 共 64 页

证监会《关于准予东方新策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]796 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《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 4,074,890,021.76 元人民币,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)“瑞华验字[2015]第 01300041 号”验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,075,263,256.48 份基金单位,其中认购资金利息折合 373,234.72 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金自 2015 年 11 月 13 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额,此前已持有本基金份额的投资人,其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额指在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用,从本类别基金资产中不计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额;C 类基金份额指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。两级基金份额分别设置基金代码,分别计算基金份额净值并单独公告。详情请见本公司于 2015 年 11 月 13 日刊登的《关于东方新策略灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改<基金合同>的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方新策略灵活配置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(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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)。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。

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》、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

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	887,479.25
等于：本金	886,904.73
加：应计利息	574.52
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	887,479.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		208,966,104.34	-	206,461,707.36	-2,504,396.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,968,524.00	80,833.54	13,070,573.54	21,216.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,968,524.00	80,833.54	13,070,573.54	21,216.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		221,934,628.34	80,833.54	219,532,280.90	-2,483,180.98

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,900,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,900,000.00	-

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,823.65
其中：交易所市场	3,823.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	156,136.48
应付申购款利息	965.94
合计	160,926.19

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方新策略灵活配置混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,247,746.26	23,247,746.26
本期申购	6,394,197.23	6,394,197.23
本期赎回（以“-”号填列）	-2,295,815.66	-2,295,815.66
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	27,346,127.83	27,346,127.83

东方新策略灵活配置混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,362.02	180,362.02
本期申购	177,219,347.56	177,219,347.56
本期赎回（以“-”号填列）	-5,696,628.13	-5,696,628.13
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	171,703,081.45	171,703,081.45

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

东方新策略灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,314,940.46	3,646,883.40	2,331,942.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,314,940.46	3,646,883.40	2,331,942.94
本期利润	227,911.19	589,985.50	817,896.69
本期基金份额交易产生的变动数	-259,241.59	827,710.79	568,469.20
其中：基金申购款	-382,626.24	1,177,834.34	795,208.10
基金赎回款	123,384.65	-350,123.55	-226,738.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,346,270.86	5,064,579.69	3,718,308.83

东方新策略灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,368.23	28,770.14	19,401.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-9,368.23	28,770.14	19,401.91
本期利润	1,705,695.42	-1,862,304.80	-156,609.38
本期基金份额交易产生的变动数	-9,484,656.08	34,115,092.85	24,630,436.77
其中：基金申购款	-9,767,536.79	35,072,610.78	25,305,073.99
基金赎回款	282,880.71	-957,517.93	-674,637.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,788,328.89	32,281,558.19	24,493,229.30

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,709.04
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	1,392.33
其他	72.32
合计	14,173.69

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 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	362,189.60
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	362,189.60

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	25,370,244.39
减：卖出股票成本总额	24,873,761.16
减：交易费用	134,293.63
买卖股票差价收入	362,189.60

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	52,201.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）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	52,201.00

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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	2,212,518.50
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	2,212,518.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,272,319.30
股票投资	-1,290,453.30
债券投资	18,134.00
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	-1,272,319.30

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,329.95
基金转换费收入	68.98
合计	1,398.93

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	6,136.48
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	6,136.48

注：自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 10 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
中国光大银行股份有限公司	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	591,748.11	136,700.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	89,314.08	53,494.09
应支付基金管理人的净管理费	502,434.03	83,206.82

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

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、公休假等，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 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
当期发生的基金应支付的托管费	147,936.98	34,175.25

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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计提方式与支付方式：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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方新策略灵活配置 混合 A	东方新策略灵活配置 混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	12,794.30	12,794.30
合计	-	12,794.30	12,794.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方新策略灵活配置 混合 A	东方新策略灵活配置 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：本基金仅对 C 类基金份额收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.01% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.01\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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 2025 年 3 月 18 日起本基金 C 类份额实行销售服务费率优惠调整，费率由 0.30% 调整到 0.01%，截至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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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
	887,479.25	12,709.04	702,212.96	7,739.01

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购 日	期	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
001390	古麒 绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	12.08	21.50	178	2,150.24	3,827.00	-
301560	众捷 汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	16.50	33.05	190	3,135.00	6,279.50	-
301590	优优 绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	89.60	152.21	51	4,569.60	7,762.71	-
301595	太力 科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	17.05	35.86	196	3,341.80	7,028.56	-
301636	泽润 新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	33.06	53.69	128	4,231.68	6,872.32	-
301678	新恒 汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	12.80	54.21	342	4,377.60	18,539.82	-
603014	威高 血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	26.50	35.16	120	3,180.00	4,219.20	-
603049	中策 橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	46.50	42.99	104	4,836.00	4,470.96	-
603120	肯特 催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	15.00	41.30	15	225.00	619.50	-
603202	天有 为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	93.50	92.79	35	3,272.50	3,247.65	-
603382	海阳 科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股 流通 受限	11.50	28.45	105	1,207.50	2,987.25	-
603400	华之 杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	19.88	49.62	57	1,133.16	2,828.34	-
688755	汉邦 科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	22.77	44.55	203	4,622.31	9,043.65	-
688775	影石 创新	2025 年 6 月	6 个月	新股 流通	47.27	156.28	190	8,981.30	29,693.20	-

		4 日		受限						
--	--	-----	--	----	--	--	--	--	--	--

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
--------	-----	------

	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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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	887,479.25	-	-	-	887,479.25
结算备付金	622,686.03	-	-	-	622,686.03
存出保证金	63,967.09	-	-	-	63,967.09
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-206,461,707.36	206,461,707.36
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,070,573.54	-	-	-	13,070,573.54
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	6,900,000.00	-	-	-	6,900,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	79.92	79.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,544,705.91	-	-	-206,461,787.28	228,006,493.19
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	-	-	-	399,386.96	399,386.96
应付赎回款	-	-	-	442.24	442.24
应付管理人报酬	-	-	-	146,727.43	146,727.43
应付托管费	-	-	-	36,681.88	36,681.88
应付销售服务费	-	-	-	1,581.08	1,581.08
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	-	-	-	160,926.19	160,926.19

负债总计	-	-	-	745,745.78	745,745.78
利率敏感度缺口	21,544,705.91	-	-	-205,716,041.50	227,260,747.41
上年度末 2024 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	432,624.41	-	-	-	432,624.41
结算备付金	479,025.88	-	-	-	479,025.88
存出保证金	15,035.51	-	-	-	15,035.51
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	19,059,582.00	19,059,582.00
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,612,418.63	-	-	-	1,612,418.63
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	4,199,645.89	-	-	-	4,199,645.89
应收清算款	-	-	-	302,233.94	302,233.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	219.76	219.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,738,750.32	-	-	19,362,035.70	26,100,786.02
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	-	-	-	59,703.83	59,703.83
应付赎回款	-	-	-	30,630.88	30,630.88
应付管理人报酬	-	-	-	17,668.59	17,668.59
应付托管费	-	-	-	4,417.12	4,417.12
应付销售服务费	-	-	-	51.01	51.01
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	-	-	-	208,861.46	208,861.46
负债总计	-	-	-	321,332.89	321,332.89
利率敏感度缺口	6,738,750.32	-	-	-19,040,702.81	25,779,453.13

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-15,772.12	-2,261.82
	市场利率下调 0.25%	15,772.12	2,261.82

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

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	206,461,707.36	90.85	19,059,582.00	73.93
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	13,070,573.54	5.75	1,612,418.63	6.25
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	219,532,280.90	96.60	20,672,000.63	80.19

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(2025 年 6 月 30 日)	上年度末(2024 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上涨 5%	11,147,835.00	987,011.01
	沪深 300 指数下跌 5%	-11,147,835.00	-987,011.01

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	206,354,287.70	19,059,582.00
第二层次	13,070,573.54	1,612,418.63

第三层次	107,419.66	—
合计	219,532,280.90	20,672,000.63

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	206,461,707.36	90.55
	其中：股票	206,461,707.36	90.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,070,573.54	5.73
	其中：债券	13,070,573.54	5.73
	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	6,900,000.00	3.03
	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	1,510,165.28	0.66
8	其他各项资产	64,047.01	0.03
9	合计	228,006,493.19	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

金额单位：人民币元

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	1,156,167.00	0.51
B	采矿业	10,619,278.00	4.67
C	制造业	120,350,569.36	52.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,532,058.00	2.87
E	建筑业	4,094,755.00	1.80
F	批发和零售业	1,486,080.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	7,134,360.00	3.14
H	住宿和餐饮业	176,784.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,458,564.80	5.92
J	金融业	33,127,461.00	14.58
K	房地产业	1,841,952.00	0.81
L	租赁和商务服务业	2,104,567.20	0.93
M	科学研究和技术服务业	2,318,798.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	463,750.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	139,536.00	0.06
Q	卫生和社会工作	815,102.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	641,925.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	206,461,707.36	90.85

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

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	600519	贵州茅台	5,700	8,034,264.00	3.54
2	300750	宁德时代	24,200	6,103,724.00	2.69
3	601318	中国平安	98,100	5,442,588.00	2.39
4	600036	招商银行	113,700	5,224,515.00	2.30
5	601166	兴业银行	151,700	3,540,678.00	1.56
6	600900	长江电力	111,800	3,369,652.00	1.48
7	000333	美的集团	44,900	3,241,780.00	1.43
8	601899	紫金矿业	149,700	2,919,150.00	1.28
9	002594	比亚迪	8,300	2,754,853.00	1.21

10	300059	东方财富	115,000	2,659,950.00	1.17
11	600030	中信证券	89,700	2,477,514.00	1.09
12	601398	工商银行	320,200	2,430,318.00	1.07
13	600276	恒瑞医药	41,700	2,164,230.00	0.95
14	000858	五粮液	17,600	2,092,640.00	0.92
15	000651	格力电器	42,000	1,886,640.00	0.83
16	601288	农业银行	301,100	1,770,468.00	0.78
17	601328	交通银行	215,200	1,721,600.00	0.76
18	600887	伊利股份	59,400	1,656,072.00	0.73
19	002475	立讯精密	47,400	1,644,306.00	0.72
20	688981	中芯国际	18,600	1,639,962.00	0.72
21	600919	江苏银行	134,000	1,599,960.00	0.70
22	601816	京沪高铁	274,900	1,580,675.00	0.70
23	603259	药明康德	22,300	1,550,965.00	0.68
24	600000	浦发银行	110,700	1,536,516.00	0.68
25	000725	京东方 A	341,700	1,363,383.00	0.60
26	002371	北方华创	3,000	1,326,630.00	0.58
27	300760	迈瑞医疗	5,600	1,258,600.00	0.55
28	601088	中国神华	30,500	1,236,470.00	0.54
29	300308	中际旭创	8,400	1,225,224.00	0.54
30	300502	新易盛	9,380	1,191,447.60	0.52
31	688041	海光信息	8,300	1,172,707.00	0.52
32	601601	中国太保	30,800	1,155,308.00	0.51
33	601668	中国建筑	194,600	1,122,842.00	0.49
34	300124	汇川技术	17,300	1,117,061.00	0.49
35	601728	中国电信	141,700	1,098,175.00	0.48
36	002352	顺丰控股	22,400	1,092,224.00	0.48
37	000001	平安银行	90,400	1,091,128.00	0.48
38	688256	寒武纪	1,800	1,082,700.00	0.48
39	002714	牧原股份	25,200	1,058,652.00	0.47
40	603501	豪威集团	7,900	1,008,435.00	0.44
41	002230	科大讯飞	21,000	1,005,480.00	0.44
42	601127	赛力斯	7,400	993,968.00	0.44
43	000063	中兴通讯	29,800	968,202.00	0.43
44	603019	中科曙光	13,500	950,400.00	0.42
45	600941	中国移动	8,400	945,420.00	0.42
46	600309	万华化学	17,300	938,698.00	0.41
47	300274	阳光电源	13,600	921,672.00	0.41
48	601857	中国石油	105,200	899,460.00	0.40
49	601919	中远海控	59,300	891,872.00	0.39
50	002415	海康威视	32,000	887,360.00	0.39
51	000425	徐工机械	111,500	866,355.00	0.38
52	600406	国电南瑞	38,300	858,303.00	0.38

53	688008	澜起科技	10,400	852,800.00	0.38
54	600690	海尔智家	34,400	852,432.00	0.38
55	600660	福耀玻璃	14,900	849,449.00	0.37
56	601012	隆基绿能	55,500	833,610.00	0.37
57	601766	中国中车	112,700	793,408.00	0.35
58	603986	兆易创新	6,200	784,486.00	0.35
59	600050	中国联通	144,700	772,698.00	0.34
60	000100	TCL 科技	175,800	761,214.00	0.33
61	600028	中国石化	134,900	760,836.00	0.33
62	000338	潍柴动力	49,000	753,620.00	0.33
63	000568	泸州老窖	6,600	748,440.00	0.33
64	601006	大秦铁路	110,200	727,320.00	0.32
65	300476	胜宏科技	5,400	725,652.00	0.32
66	601985	中国核电	77,000	717,640.00	0.32
67	002027	分众传媒	95,200	694,960.00	0.31
68	600104	上汽集团	43,200	693,360.00	0.31
69	688012	中微公司	3,800	692,740.00	0.30
70	601225	陕西煤业	35,800	688,792.00	0.30
71	600150	中国船舶	20,300	660,562.00	0.29
72	600418	江淮汽车	16,300	653,467.00	0.29
73	601988	中国银行	115,300	647,986.00	0.29
74	605499	东鹏饮料	1,900	596,695.00	0.26
75	000792	盐湖股份	34,900	596,092.00	0.26
76	603288	海天味业	15,200	591,432.00	0.26
77	000625	长安汽车	46,000	586,960.00	0.26
78	600760	中航沈飞	10,000	586,200.00	0.26
79	600111	北方稀土	23,100	575,190.00	0.25
80	688271	联影医疗	4,500	574,830.00	0.25
81	601628	中国人寿	13,900	572,541.00	0.25
82	601658	邮储银行	104,100	569,427.00	0.25
83	600938	中国海油	21,800	569,198.00	0.25
84	600905	三峡能源	133,200	567,432.00	0.25
85	688111	金山办公	2,000	560,100.00	0.25
86	600436	片仔癀	2,800	560,028.00	0.25
87	002625	光启技术	14,000	559,720.00	0.25
88	600089	特变电工	46,900	559,517.00	0.25
89	000157	中联重科	76,700	554,541.00	0.24
90	300015	爱尔眼科	43,900	547,872.00	0.24
91	601888	中国中免	8,900	542,633.00	0.24
92	601390	中国中铁	96,400	540,804.00	0.24
93	002050	三花智控	20,500	540,790.00	0.24
94	002463	沪电股份	12,700	540,766.00	0.24
95	600547	山东黄金	16,800	536,424.00	0.24

96	600019	宝钢股份	80,500	530,495.00	0.23
97	600048	保利发展	65,400	529,740.00	0.23
98	002241	歌尔股份	22,700	529,364.00	0.23
99	603993	洛阳钼业	62,700	527,934.00	0.23
100	300014	亿纬锂能	11,500	526,815.00	0.23
101	600415	小商品城	25,200	521,136.00	0.23
102	002384	东山精密	13,200	498,564.00	0.22
103	601600	中国铝业	70,700	497,728.00	0.22
104	000977	浪潮信息	9,600	488,448.00	0.21
105	601989	中国重工	105,100	487,664.00	0.21
106	600585	海螺水泥	22,300	478,781.00	0.21
107	600570	恒生电子	14,200	476,268.00	0.21
108	000538	云南白药	8,200	457,478.00	0.20
109	002179	中航光电	11,200	452,032.00	0.20
110	600893	航发动力	11,700	450,918.00	0.20
111	600584	长电科技	13,300	448,077.00	0.20
112	603799	华友钴业	12,000	444,240.00	0.20
113	000938	紫光股份	18,300	439,017.00	0.19
114	000988	华工科技	9,000	423,090.00	0.19
115	300408	三环集团	12,400	414,160.00	0.18
116	002049	紫光国微	6,200	408,332.00	0.18
117	002028	思源电气	5,600	408,296.00	0.18
118	000002	万科 A	63,500	407,670.00	0.18
119	600795	国电电力	84,100	407,044.00	0.18
120	600438	通威股份	24,200	405,350.00	0.18
121	300433	蓝思科技	17,900	399,170.00	0.18
122	600489	中金黄金	27,200	397,936.00	0.18
123	601669	中国电建	81,200	395,444.00	0.17
124	600988	赤峰黄金	15,400	383,152.00	0.17
125	300339	润和软件	7,500	381,225.00	0.17
126	601689	拓普集团	7,900	373,275.00	0.16
127	002422	科伦药业	10,300	369,976.00	0.16
128	600009	上海机场	11,600	368,532.00	0.16
129	002460	赣锋锂业	10,500	354,585.00	0.16
130	600160	巨化股份	12,300	352,764.00	0.16
131	000768	中航西飞	12,700	347,218.00	0.15
132	300394	天孚通信	4,340	346,505.60	0.15
133	601186	中国铁建	43,100	345,231.00	0.15
134	002456	欧菲光	29,000	343,650.00	0.15
135	600183	生益科技	11,300	340,695.00	0.15
136	600839	四川长虹	34,900	339,228.00	0.15
137	002074	国轩高科	10,200	331,092.00	0.15
138	000963	华东医药	8,200	330,952.00	0.15

139	600989	宝丰能源	20,400	329,256.00	0.14
140	600115	中国东航	80,600	324,818.00	0.14
141	600066	宇通客车	13,000	323,180.00	0.14
142	600886	国投电力	21,900	322,806.00	0.14
143	601058	赛轮轮胎	24,600	322,752.00	0.14
144	601360	三六零	31,400	320,280.00	0.14
145	601100	恒立液压	4,400	316,800.00	0.14
146	688036	传音控股	3,900	310,830.00	0.14
147	000408	藏格矿业	7,200	307,224.00	0.14
148	300442	润泽科技	6,200	307,086.00	0.14
149	688169	石头科技	1,960	306,838.00	0.14
150	002920	德赛西威	3,000	306,390.00	0.13
151	002466	天齐锂业	9,500	304,380.00	0.13
152	002001	新 和 成	14,200	302,034.00	0.13
153	002340	格林美	47,500	301,625.00	0.13
154	001979	招商蛇口	34,300	300,811.00	0.13
155	000807	云铝股份	18,800	300,424.00	0.13
156	600426	华鲁恒升	13,800	299,046.00	0.13
157	601800	中国交建	33,500	297,815.00	0.13
158	000975	山金国际	15,700	297,358.00	0.13
159	600011	华能国际	41,600	297,024.00	0.13
160	002252	上海莱士	43,200	296,784.00	0.13
161	600029	南方航空	50,300	296,770.00	0.13
162	600196	复星医药	11,800	296,062.00	0.13
163	002517	恺英网络	15,300	295,443.00	0.13
164	300661	圣邦股份	4,030	293,263.10	0.13
165	600674	川投能源	18,200	291,928.00	0.13
166	000661	长春高新	2,900	287,622.00	0.13
167	688126	沪硅产业	15,200	284,544.00	0.13
168	600346	恒力石化	19,900	283,774.00	0.12
169	002558	巨人网络	11,900	280,245.00	0.12
170	300251	光线传媒	13,800	279,726.00	0.12
171	301236	软通动力	5,100	278,664.00	0.12
172	600487	亨通光电	18,200	278,460.00	0.12
173	601111	中国国航	35,200	277,728.00	0.12
174	300207	欣旺达	13,800	276,828.00	0.12
175	601868	中国能建	121,900	271,837.00	0.12
176	002195	岩山科技	48,200	271,366.00	0.12
177	600460	士兰微	10,900	270,538.00	0.12
178	003816	中国广核	73,900	268,996.00	0.12
179	000066	中国长城	18,100	267,880.00	0.12
180	600372	中航机载	22,200	267,732.00	0.12
181	600745	闻泰科技	7,900	264,887.00	0.12

182	002648	卫星化学	15,200	263,416.00	0.12
183	601117	中国化学	34,200	262,314.00	0.12
184	600096	云天化	11,900	261,443.00	0.12
185	300450	先导智能	10,400	258,440.00	0.11
186	600741	华域汽车	14,600	257,690.00	0.11
187	002465	海格通信	18,400	256,496.00	0.11
188	300347	泰格医药	4,800	255,936.00	0.11
189	688213	思特威	2,500	255,550.00	0.11
190	600256	广汇能源	42,200	254,044.00	0.11
191	002156	通富微电	9,900	253,638.00	0.11
192	600879	航天电子	24,200	253,374.00	0.11
193	002916	深南电路	2,340	252,275.40	0.11
194	300418	昆仑万维	7,500	252,225.00	0.11
195	002273	水晶光电	12,600	251,622.00	0.11
196	601021	春秋航空	4,500	250,425.00	0.11
197	300866	安克创新	2,200	249,920.00	0.11
198	002236	大华股份	15,700	249,316.00	0.11
199	000786	北新建材	9,400	248,912.00	0.11
200	601319	中国人保	28,500	248,235.00	0.11
201	600219	南山铝业	64,700	247,801.00	0.11
202	601168	西部矿业	14,900	247,787.00	0.11
203	601633	长城汽车	11,500	247,020.00	0.11
204	688777	中控技术	5,500	247,005.00	0.11
205	600176	中国巨石	21,600	246,240.00	0.11
206	600352	浙江龙盛	24,200	245,872.00	0.11
207	688608	恒玄科技	700	243,586.00	0.11
208	002601	龙佰集团	15,000	243,150.00	0.11
209	300782	卓胜微	3,400	242,658.00	0.11
210	002185	华天科技	24,000	242,400.00	0.11
211	002555	三七互娱	14,000	242,060.00	0.11
212	000831	中国稀土	6,700	242,004.00	0.11
213	002294	信立泰	5,100	241,383.00	0.11
214	300395	菲利华	4,700	240,170.00	0.11
215	600039	四川路桥	24,200	239,580.00	0.11
216	600482	中国动力	10,300	237,621.00	0.10
217	600885	宏发股份	10,500	234,255.00	0.10
218	000630	铜陵有色	70,100	234,134.00	0.10
219	300017	网宿科技	21,800	233,696.00	0.10
220	688235	百济神州	1,000	233,640.00	0.10
221	002493	荣盛石化	28,200	233,496.00	0.10
222	001965	招商公路	19,400	232,800.00	0.10
223	688396	华润微	4,900	231,084.00	0.10
224	002129	TCL 中环	30,000	230,400.00	0.10

225	002709	天赐材料	12,700	230,124.00	0.10
226	302132	中航成飞	2,600	228,644.00	0.10
227	300223	北京君正	3,300	228,360.00	0.10
228	300759	康龙化成	9,300	228,222.00	0.10
229	300896	爱美客	1,300	227,253.00	0.10
230	688099	晶晨股份	3,200	227,232.00	0.10
231	000933	神火股份	13,600	226,304.00	0.10
232	601877	正泰电器	9,700	219,899.00	0.10
233	600362	江西铜业	9,300	217,899.00	0.10
234	002281	光迅科技	4,400	217,008.00	0.10
235	002130	沃尔核材	9,100	216,762.00	0.10
236	300122	智飞生物	11,000	215,490.00	0.09
237	688617	惠泰医疗	725	215,325.00	0.09
238	000423	东阿阿胶	4,100	214,430.00	0.09
239	603392	万泰生物	3,500	213,500.00	0.09
240	002595	豪迈科技	3,600	213,192.00	0.09
241	002436	兴森科技	16,100	213,164.00	0.09
242	600161	天坛生物	11,100	213,009.00	0.09
243	002738	中矿资源	6,600	212,256.00	0.09
244	002532	天山铝业	25,500	211,905.00	0.09
245	600233	圆通速递	16,400	211,396.00	0.09
246	002180	纳思达	9,200	211,048.00	0.09
247	300002	神州泰岳	17,800	210,040.00	0.09
248	600588	用友网络	15,700	209,909.00	0.09
249	688002	睿创微纳	3,000	209,160.00	0.09
250	002938	鹏鼎控股	6,500	208,195.00	0.09
251	002138	顺络电子	7,400	208,088.00	0.09
252	688122	西部超导	4,000	207,520.00	0.09
253	688506	百利天恒	700	207,284.00	0.09
254	002078	太阳纸业	15,200	204,592.00	0.09
255	002472	双环传动	6,100	204,289.00	0.09
256	300832	新产业	3,600	204,192.00	0.09
257	002128	电投能源	10,300	203,734.00	0.09
258	002353	杰瑞股份	5,800	203,000.00	0.09
259	688120	华海清科	1,200	202,440.00	0.09
260	300346	南大光电	6,360	201,230.40	0.09
261	300054	鼎龙股份	7,000	200,760.00	0.09
262	688047	龙芯中科	1,500	200,085.00	0.09
263	000301	东方盛虹	24,000	199,920.00	0.09
264	300136	信维通信	8,900	199,360.00	0.09
265	300024	机器人	11,600	199,288.00	0.09
266	600143	金发科技	19,300	198,983.00	0.09
267	601618	中国中冶	66,200	197,276.00	0.09

268	603606	东方电缆	3,800	196,498.00	0.09
269	002223	鱼跃医疗	5,500	195,800.00	0.09
270	002202	金风科技	19,000	194,750.00	0.09
271	600188	兖矿能源	16,000	194,720.00	0.09
272	002821	凯莱英	2,200	194,150.00	0.09
273	002065	东华软件	20,200	193,920.00	0.09
274	601615	明阳智能	16,800	193,032.00	0.08
275	600895	张江高科	7,500	192,750.00	0.08
276	688223	晶科能源	37,100	192,549.00	0.08
277	002085	万丰奥威	12,100	192,269.00	0.08
278	300383	光环新网	13,400	191,620.00	0.08
279	000999	华润三九	6,110	191,120.80	0.08
280	002271	东方雨虹	17,700	189,921.00	0.08
281	603596	伯特利	3,600	189,684.00	0.08
282	300496	中科创达	3,300	188,826.00	0.08
283	002405	四维图新	22,100	188,734.00	0.08
284	002624	完美世界	12,400	188,108.00	0.08
285	603659	璞泰来	10,000	187,800.00	0.08
286	600862	中航高科	7,200	187,776.00	0.08
287	002459	晶澳科技	18,800	187,624.00	0.08
288	601872	招商轮船	29,900	187,174.00	0.08
289	688578	艾力斯	2,000	186,080.00	0.08
290	601607	上海医药	10,400	185,952.00	0.08
291	002008	大族激光	7,500	182,775.00	0.08
292	603605	珀莱雅	2,200	182,138.00	0.08
293	600549	厦门钨业	8,600	179,912.00	0.08
294	300604	长川科技	4,000	179,640.00	0.08
295	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.08
296	000426	兴业银锡	11,200	176,960.00	0.08
297	605117	德业股份	3,360	176,937.60	0.08
298	002155	湖南黄金	9,900	176,715.00	0.08
299	603087	甘李药业	3,200	175,296.00	0.08
300	300474	景嘉微	2,400	175,200.00	0.08
301	300012	华测检测	14,900	174,181.00	0.08
302	002444	巨星科技	6,800	173,468.00	0.08
303	603129	春风动力	800	173,200.00	0.08
304	600153	建发股份	16,700	173,179.00	0.08
305	300058	蓝色光标	26,320	172,659.20	0.08
306	300037	新宙邦	4,900	172,480.00	0.08
307	688266	泽璟制药	1,600	172,016.00	0.08
308	600332	白云山	6,500	171,340.00	0.08
309	000009	中国宝安	19,200	170,496.00	0.08
310	000733	振华科技	3,400	170,170.00	0.07

311	605589	圣泉集团	6,100	169,275.00	0.07
312	688072	拓荆科技	1,100	169,081.00	0.07
313	000617	中油资本	23,100	168,630.00	0.07
314	300699	光威复材	5,300	167,851.00	0.07
315	601216	君正集团	30,400	167,808.00	0.07
316	300001	特锐德	7,000	167,790.00	0.07
317	300253	卫宁健康	15,800	167,480.00	0.07
317	601233	桐昆股份	15,800	167,480.00	0.07
318	600392	盛和资源	12,700	167,259.00	0.07
319	300003	乐普医疗	12,100	166,738.00	0.07
320	300073	当升科技	3,800	166,706.00	0.07
321	688180	君实生物	4,900	166,502.00	0.07
322	600803	新奥股份	8,800	166,320.00	0.07
323	000519	中兵红箭	7,500	164,175.00	0.07
324	300628	亿联网络	4,700	163,372.00	0.07
325	000932	华菱钢铁	37,100	163,240.00	0.07
326	300142	沃森生物	14,800	162,800.00	0.07
327	601799	星宇股份	1,300	162,500.00	0.07
328	000034	神州数码	4,300	161,852.00	0.07
329	002812	恩捷股份	5,500	161,095.00	0.07
330	600699	均胜电子	9,200	160,448.00	0.07
331	300316	晶盛机电	5,900	160,185.00	0.07
332	002414	高德红外	15,600	159,900.00	0.07
333	600177	雅戈尔	21,800	159,140.00	0.07
334	002007	华兰生物	10,100	158,267.00	0.07
335	000878	云南铜业	12,400	157,728.00	0.07
336	600398	海澜之家	22,600	157,296.00	0.07
337	300568	星源材质	12,400	157,232.00	0.07
338	600118	中国卫星	5,500	157,135.00	0.07
339	601567	三星医疗	6,900	154,698.00	0.07
340	002389	航天彩虹	6,000	153,600.00	0.07
341	601238	广汽集团	20,500	153,545.00	0.07
342	002152	广电运通	11,300	151,872.00	0.07
343	603260	合盛硅业	3,200	151,680.00	0.07
344	600521	华海药业	8,100	150,903.00	0.07
345	300315	掌趣科技	24,800	150,536.00	0.07
346	002410	广联达	11,200	150,192.00	0.07
347	000623	吉林敖东	8,800	149,160.00	0.07
348	603979	金诚信	3,200	148,608.00	0.07
349	300413	芒果超媒	6,800	148,376.00	0.07
350	600704	物产中大	28,100	148,087.00	0.07
351	600018	上港集团	25,900	147,889.00	0.07
352	002044	美年健康	28,700	147,518.00	0.06

353	002318	久立特材	6,300	147,357.00	0.06
354	300627	华测导航	4,200	147,000.00	0.06
355	600141	兴发集团	7,100	145,763.00	0.06
356	000738	航发控制	7,000	145,250.00	0.06
357	600497	驰宏锌锗	27,200	143,888.00	0.06
358	688599	天合光能	9,900	143,847.00	0.06
359	000400	许继电气	6,600	143,682.00	0.06
360	600765	中航重机	8,500	143,480.00	0.06
361	600316	洪都航空	3,800	143,260.00	0.06
362	601677	明泰铝业	11,500	142,830.00	0.06
363	300459	汤姆猫	25,400	142,240.00	0.06
364	002409	雅克科技	2,600	142,194.00	0.06
365	300919	中伟股份	4,300	141,384.00	0.06
366	002607	中公教育	45,600	139,536.00	0.06
367	600498	烽火通信	6,600	138,798.00	0.06
368	002245	蔚蓝锂芯	10,800	138,564.00	0.06
369	002739	万达电影	12,100	138,303.00	0.06
370	300088	长信科技	23,000	137,080.00	0.06
371	002407	多氟多	11,200	136,528.00	0.06
372	300724	捷佳伟创	2,500	135,750.00	0.06
373	600529	山东药玻	6,100	135,054.00	0.06
374	300757	罗博特科	900	134,973.00	0.06
375	603939	益丰药房	5,500	134,585.00	0.06
376	600637	东方明珠	17,900	133,713.00	0.06
377	601018	宁波港	36,300	132,858.00	0.06
378	300068	南都电源	8,300	132,136.00	0.06
379	000039	中集集团	16,800	132,048.00	0.06
380	000960	锡业股份	8,600	131,580.00	0.06
381	002432	九安医疗	3,600	131,148.00	0.06
382	600563	法拉电子	1,200	130,908.00	0.06
383	600535	天士力	8,300	129,895.00	0.06
384	688188	柏楚电子	980	129,026.80	0.06
385	688009	中国通号	25,100	129,014.00	0.06
386	301358	湖南裕能	4,100	127,879.00	0.06
387	600486	扬农化工	2,200	127,600.00	0.06
388	300558	贝达药业	2,200	127,490.00	0.06
389	000887	中鼎股份	7,200	126,648.00	0.06
390	600820	隧道股份	20,700	126,270.00	0.06
391	300763	锦浪科技	2,200	126,258.00	0.06
392	688303	大全能源	5,900	125,788.00	0.06
393	300285	国瓷材料	7,200	124,920.00	0.05
394	002841	视源股份	3,600	124,560.00	0.05
395	002064	华峰化学	18,700	123,607.00	0.05

396	600008	首创环保	40,800	123,216.00	0.05
397	603486	科沃斯	2,100	122,283.00	0.05
398	300296	利亚德	20,000	122,000.00	0.05
399	600998	九州通	23,700	121,818.00	0.05
400	300144	宋城演艺	14,200	121,410.00	0.05
401	603806	福斯特	9,300	120,528.00	0.05
402	603568	伟明环保	6,300	120,204.00	0.05
403	600763	通策医疗	2,900	119,712.00	0.05
404	002312	川发龙蟒	10,400	119,392.00	0.05
405	605358	立昂微	5,100	118,830.00	0.05
406	600170	上海建工	49,500	118,305.00	0.05
407	002025	航天电器	2,300	118,243.00	0.05
408	601179	中国西电	19,200	117,888.00	0.05
409	603816	顾家家居	4,600	117,392.00	0.05
410	600166	福田汽车	43,200	117,072.00	0.05
411	600038	中直股份	3,000	116,430.00	0.05
412	002497	雅化集团	10,200	116,280.00	0.05
413	000683	博源化工	24,000	114,960.00	0.05
414	600208	衢州发展	38,500	113,960.00	0.05
415	000818	航锦科技	5,000	112,500.00	0.05
416	601000	唐山港	27,700	112,462.00	0.05
417	600312	平高电气	7,300	112,347.00	0.05
418	600323	瀚蓝环境	4,600	112,010.00	0.05
419	002244	滨江集团	11,300	110,175.00	0.05
420	000629	钒钛股份	42,900	109,824.00	0.05
421	300676	华大基因	2,200	109,494.00	0.05
422	000708	中信特钢	9,300	109,368.00	0.05
423	603885	吉祥航空	8,100	109,107.00	0.05
424	002603	以岭药业	7,700	108,570.00	0.05
425	000830	鲁西化工	10,400	107,120.00	0.05
426	600867	通化东宝	12,900	105,780.00	0.05
427	688005	容百科技	4,700	104,904.00	0.05
428	600499	科达制造	10,700	104,860.00	0.05
429	603613	国联股份	4,400	104,236.00	0.05
430	600859	王府井	7,500	104,175.00	0.05
431	002439	启明星辰	6,500	103,935.00	0.05
432	300390	天华新能	5,400	102,978.00	0.05
433	300182	捷成股份	18,600	102,486.00	0.05
434	603077	和邦生物	57,800	101,150.00	0.04
435	603000	人民网	5,000	101,050.00	0.04
436	000547	航天发展	12,000	100,800.00	0.04
437	600325	华发股份	20,600	100,322.00	0.04
438	600655	豫园股份	18,000	99,900.00	0.04

439	000563	陕国投 A	27,900	99,603.00	0.04
440	002145	中核钛白	24,000	99,600.00	0.04
441	600004	白云机场	10,900	99,190.00	0.04
442	600511	国药股份	3,400	99,144.00	0.04
443	000998	隆平高科	9,900	97,515.00	0.04
444	600131	国网信通	5,500	97,350.00	0.04
445	300529	健帆生物	4,500	97,065.00	0.04
446	300567	精测电子	1,600	96,976.00	0.04
447	601966	玲珑轮胎	6,600	96,822.00	0.04
448	603899	晨光股份	3,300	95,667.00	0.04
449	300601	康泰生物	6,200	94,178.00	0.04
450	600667	太极实业	14,300	94,094.00	0.04
451	002756	永兴材料	2,900	92,075.00	0.04
452	600754	锦江酒店	4,100	92,004.00	0.04
453	002120	韵达股份	13,600	91,120.00	0.04
454	300438	鹏辉能源	3,300	91,113.00	0.04
455	300070	碧水源	20,100	90,450.00	0.04
456	300751	迈为股份	1,300	90,428.00	0.04
457	603833	欧派家居	1,600	90,320.00	0.04
458	002544	普天科技	3,800	89,110.00	0.04
459	300573	兴齐眼药	1,680	87,007.20	0.04
460	600258	首旅酒店	6,000	84,780.00	0.04
461	000032	深桑达 A	4,100	82,943.00	0.04
462	300457	赢合科技	3,600	82,800.00	0.04
463	000967	盈峰环境	11,800	82,010.00	0.04
464	300118	东方日升	8,500	81,430.00	0.04
465	002508	老板电器	4,200	79,842.00	0.04
466	002831	裕同科技	3,400	79,628.00	0.04
467	600129	太极集团	3,700	78,847.00	0.03
468	002292	奥飞娱乐	8,000	77,760.00	0.03
469	002572	索菲亚	5,300	74,253.00	0.03
470	601636	旗滨集团	14,700	73,647.00	0.03
471	002266	浙富控股	23,800	73,304.00	0.03
472	688063	派能科技	1,600	72,128.00	0.03
473	603650	彤程新材	2,200	70,730.00	0.03
474	300769	德方纳米	2,100	69,342.00	0.03
475	000035	中国天楹	15,800	67,782.00	0.03
476	002091	江苏国泰	9,000	65,430.00	0.03
477	600315	上海家化	3,100	65,317.00	0.03
478	688390	固德威	1,500	65,175.00	0.03
479	002372	伟星新材	5,700	59,052.00	0.03
480	001914	招商积余	4,000	49,480.00	0.02
481	600007	中国国贸	1,800	37,044.00	0.02

482	600335	国机汽车	5,300	34,185.00	0.02
483	688775	影石创新	190	29,693.20	0.01
484	301678	新恒汇	342	18,539.82	0.01
485	688755	汉邦科技	203	9,043.65	0.00
486	301590	优优绿能	51	7,762.71	0.00
487	301595	太力科技	196	7,028.56	0.00
488	301636	泽润新能	128	6,872.32	0.00
489	301560	众捷汽车	190	6,279.50	0.00
490	603049	中策橡胶	104	4,470.96	0.00
491	603014	威高血净	120	4,219.20	0.00
492	001390	古麒绒材	178	3,827.00	0.00
493	603202	天有为	35	3,247.65	0.00
494	603382	海阳科技	105	2,987.25	0.00
495	603400	华之杰	57	2,828.34	0.00
496	603120	肯特催化	15	619.50	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	600519	贵州茅台	8,681,512.00	33.68
2	300750	宁德时代	6,399,737.00	24.82
3	601318	中国平安	5,058,319.00	19.62
4	600036	招商银行	4,921,719.00	19.09
5	601166	兴业银行	3,264,380.00	12.66
6	000333	美的集团	3,141,017.00	12.18
7	600900	长江电力	3,117,859.00	12.09
8	002594	比亚迪	3,057,945.00	11.86
9	300059	东方财富	2,705,981.00	10.50
10	601398	工商银行	2,232,152.00	8.66
11	600030	中信证券	2,213,232.00	8.59
12	601899	紫金矿业	2,146,491.00	8.33
13	000858	五粮液	1,958,757.00	7.60
14	688981	中芯国际	1,810,971.98	7.02
15	002475	立讯精密	1,702,335.00	6.60
16	600276	恒瑞医药	1,688,098.00	6.55
17	600887	伊利股份	1,642,832.00	6.37
18	601328	交通银行	1,595,998.00	6.19
19	300124	汇川技术	1,534,803.00	5.95
20	601288	农业银行	1,533,109.00	5.95
21	601816	京沪高铁	1,519,893.00	5.90
22	000725	京东方 A	1,510,314.00	5.86
23	000651	格力电器	1,476,331.00	5.73

24	002371	北方华创	1,456,477.00	5.65
25	603259	药明康德	1,408,468.00	5.46
26	300760	迈瑞医疗	1,383,007.00	5.36
27	688256	寒武纪	1,340,874.00	5.20
28	688041	海光信息	1,325,619.51	5.14
29	600919	江苏银行	1,286,392.00	4.99
30	600309	万华化学	1,183,946.00	4.59
31	603019	中科曙光	1,167,446.00	4.53
32	601728	中国电信	1,158,607.00	4.49
33	603501	豪威集团	1,139,997.00	4.42
34	600000	浦发银行	1,119,046.00	4.34
35	000063	中兴通讯	1,114,001.00	4.32
36	601088	中国神华	1,098,317.00	4.26
37	002230	科大讯飞	1,098,224.00	4.26
38	002415	海康威视	1,074,991.00	4.17
39	601988	中国银行	1,074,060.00	4.17
40	000425	徐工机械	1,073,305.00	4.16
41	601668	中国建筑	1,053,215.00	4.09
42	000001	平安银行	1,052,223.00	4.08
43	601127	赛力斯	1,008,453.00	3.91
44	601012	隆基绿能	963,249.00	3.74
45	002352	顺丰控股	939,012.04	3.64
46	002714	牧原股份	937,188.00	3.64
47	600690	海尔智家	927,553.00	3.60
48	600050	中国联通	916,758.00	3.56
49	600941	中国移动	903,824.00	3.51
50	600406	国电南瑞	875,379.00	3.40
51	000568	泸州老窖	868,972.00	3.37
52	601766	中国中车	857,152.00	3.32
53	300308	中际旭创	857,122.00	3.32
54	688111	金山办公	842,354.08	3.27
55	688008	澜起科技	840,915.35	3.26
56	000100	TCL 科技	837,811.00	3.25
57	603986	兆易创新	820,790.00	3.18
58	000338	潍柴动力	813,370.00	3.16
59	601919	中远海控	809,369.45	3.14
60	601857	中国石油	808,241.00	3.14
61	688012	中微公司	803,738.00	3.12
62	002050	三花智控	784,906.00	3.04
63	600028	中国石化	771,219.00	2.99
64	601601	中国太保	757,639.00	2.94
65	300274	阳光电源	743,637.00	2.88
66	300433	蓝思科技	741,673.00	2.88

67	601985	中国核电	734,590.00	2.85
68	601006	大秦铁路	718,846.00	2.79
69	600104	上汽集团	705,035.00	2.73
70	601225	陕西煤业	680,203.00	2.64
71	002241	歌尔股份	677,274.00	2.63
72	000157	中联重科	653,484.00	2.53
73	600150	中国船舶	634,303.00	2.46
74	002027	分众传媒	622,292.00	2.41
75	000938	紫光股份	621,848.00	2.41
76	300502	新易盛	620,502.00	2.41
77	603288	海天味业	617,478.00	2.40
78	300015	爱尔眼科	616,795.00	2.39
79	688271	联影医疗	603,449.01	2.34
80	000625	长安汽车	602,600.00	2.34
81	600019	宝钢股份	601,234.00	2.33
82	002625	光启技术	595,827.00	2.31
83	000792	盐湖股份	583,613.00	2.26
84	600048	保利发展	578,790.00	2.25
85	300014	亿纬锂能	575,805.00	2.23
86	600089	特变电工	575,307.80	2.23
87	000977	浪潮信息	574,056.00	2.23
88	600660	福耀玻璃	564,601.58	2.19
89	600436	片仔癀	561,531.00	2.18
90	600418	江淮汽车	560,677.00	2.17
91	601390	中国中铁	560,223.00	2.17
92	600905	三峡能源	558,839.00	2.17
93	601600	中国铝业	552,167.00	2.14
94	601658	邮储银行	551,730.00	2.14
95	601888	中国中免	548,080.00	2.13
96	600938	中国海油	547,995.00	2.13
97	600111	北方稀土	537,134.00	2.08
98	600585	海螺水泥	534,082.00	2.07
99	600438	通威股份	526,952.76	2.04
100	601628	中国人寿	519,312.00	2.01

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

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	603529	爱玛科技	1,129,130.00	4.38
2	600079	人福医药	920,209.00	3.57

3	600664	哈药股份	705,306.00	2.74
4	301015	百洋医药	617,416.00	2.39
5	603596	伯特利	607,695.00	2.36
6	002906	华阳集团	603,051.00	2.34
7	600988	赤峰黄金	561,978.00	2.18
8	600566	济川药业	542,400.00	2.10
9	002050	三花智控	538,137.00	2.09
10	603195	公牛集团	530,004.00	2.06
11	300433	蓝思科技	517,515.00	2.01
12	301511	德福科技	509,467.00	1.98
13	688036	传音控股	494,898.40	1.92
14	603369	今世缘	493,120.00	1.91
15	300762	上海瀚讯	467,613.00	1.81
16	601988	中国银行	448,096.00	1.74
17	600422	昆药集团	446,714.00	1.73
18	603198	迎驾贡酒	434,614.00	1.69
19	688111	金山办公	433,891.00	1.68
20	600298	安琪酵母	429,347.00	1.67

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	213,566,339.82
卖出股票收入（成交）总额	25,370,244.39

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	13,070,573.54	5.75
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	13,070,573.54	5.75

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	019766	25 国债 01	114,000	11,450,244.33	5.04
2	019749	24 国债 15	16,000	1,620,329.21	0.71

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

本基金所持有的招商银行（600036）存在多个分支机构因业务合规管理不当被监管部门予以警告或予以处罚的情况。公司公告以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的兴业银行（601166）存在多个分支机构因业务合规管理不当被监管部门予以警告或予以处罚的情况。公司公告以上事项不会对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，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、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。

本基金投资招商银行主要基于以下原因：公司具有较强的零售业务基础，经过两年的改革，资产端结构优化，核心客户基本盘增长，拨备及资本安全垫较为充足，股息率较高，具有配置价值。

本基金投资兴业银行主要基于以下原因：公司规模稳健扩张，负债成本改善明显，资产质量平稳，分红率逐年提高，具有配置价值。

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备选股票库之外的股票。

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	63,967.09
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	79.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,047.01

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

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（%）
东方新策略灵活配置混合 A	965	28,337.96	6,224,988.88	22.76	21,121,138.95	77.24
东方新策略灵活配置混合 C	58	2,960,397.96	171,641,155.68	99.96	61,925.77	0.04
合计	1,023	194,574.01	177,866,144.56	89.36	21,183,064.72	10.64

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	东方新策略灵活配置混合 A	42,265.26	0.15
	东方新策略灵活配置混合 C	0.00	0.00
	合计	42,265.26	0.02

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	东方新策略灵活配置混合 A	0
	东方新策略灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方新策略灵活配置混合 A	0
	东方新策略灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2015 年 5 月 26 日)	4, 075, 263, 256. 48	—
基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	23, 247, 746. 26	180, 362. 02
本报告期基金总申购 份额	6, 394, 197. 23	177, 219, 347. 56
减: 本报告期基金总 赎回份额	2, 295, 815. 66	5, 696, 628. 13
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	27, 346, 127. 83	171, 703, 081. 45

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 1 月, 中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

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。

本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无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
民生证券股份有限公司	2	133,886,086.21	56.15	59,700.16	56.15	-
中信建投证券股份有限公司	1	100,148,945.86	42.00	44,656.75	42.00	-
中国银河证券股份有限公司	1	4,410,555.40	1.85	1,966.86	1.85	-

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）本报告期内本基金交易单元未发生变化。

（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

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 (%)
民生证券股份有限公司	11,368,726.00	100.00	526,700,000.00	90.48	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	55,400,000.00	9.52	-	-

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	东方新策略灵活配置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

		露网站	
3	关于东方新策略灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额销售服务费率优惠的公告	证券时报、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 17 日
4	东方新策略灵活配置混合型证券投资基金暂停 50 万元以上（不含 50 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报、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 25 日
5	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
6	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（2024 下半年度）	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 31 日
7	东方新策略灵活配置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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	东方新策略灵活配置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
13	关于东方基金管理股份有限公司旗下	证券时报、证券日报、	2025 年 5 月 13 日

	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	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	
14	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
15	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露网站	2025 年 6 月 12 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、《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新策略灵活配置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