

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6 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	76
8.7 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	76
8.8 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	76
8.9 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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§ 9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3 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	78
§ 10 开放式基金份额变动	78
§ 11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	88
12.1 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	88
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	89
13.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东方量化成长灵活配置混合	
基金主代码	005616	
前端交易代码	005616	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	63,056,094.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
下属分级基金的交 易代码	005616	020126
报告期末下属分级 基金的份额总额	57,994,126.78 份	5,061,967.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	运用量化投资策略持续挖掘具有良好成长性和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	本基金结合我国宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、证券市场行情因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，动态调整基金资产在权益类资产和固定收益类资产等大类资产间的配置比例，同时基于量化模型在权益类资产内部对不同风格的股票资产进行优化配置和动态调整。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李景岩
	联系电话	010-66295888
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com
客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	021-60637228
传真	010-66578700	021-60635778
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 25 号

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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100073	100033
法定代表人	崔伟	张金良

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	2023 年 11 月 24 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
本期已实现收益	29,953,878.17	4,549,797.70	-68,986,467.85	-1,510,883.98	18,486,216.01	-101,920.88
本期利润	26,593,634.23	3,684,219.69	-66,839,895.53	-3,949,543.87	18,921,025.86	-15,142.26
加权平均基金份额本期利润	0.4784	0.6428	-0.8544	-0.3901	0.2704	-0.0031
本期加权	32.81%	32.91%	-81.59%	-28.09%	19.38%	-0.20%

平均 净值 利润 率						
本期 基金 份额 净值 增长 率	41.08%	40.38%	3.17%	2.66%	13.43%	-0.23%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末 可供 分配 利润	39,134,021 .02	6,257,919. 90	8,109,982.9 1	2,887,493. 99	51,689,186. 42	4,728,766.4 0
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.6748	1.2363	0.1871	0.5930	0.1506	0.5517
期末 基金 资产 净值	97,128,147 .80	11,319,887 .49	51,463,869. 54	7,756,987. 75	394,881,734 .22	13,300,099. 02
期末 基金 份额 净值	1.6748	2.2363	1.1871	1.5930	1.1506	1.5517
3.1. 3 累 计期 末指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	124.43%	43.79%	59.08%	2.42%	54.19%	-0.23%

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

东方量化成长灵活配置混合 A

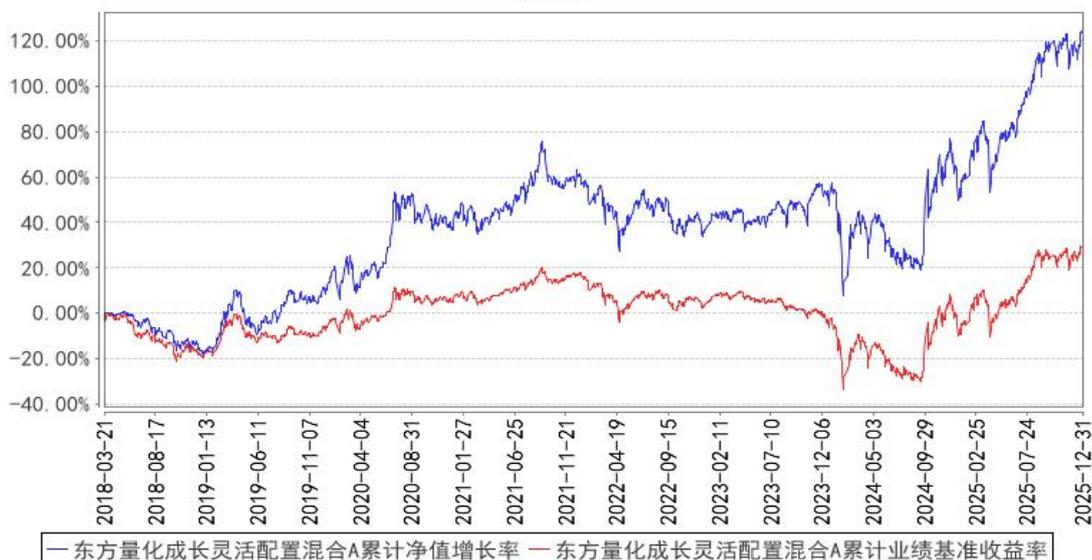
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.89%	1.12%	3.40%	1.13%	-0.51%	-0.01%
过去六个月	18.75%	1.05%	17.44%	1.09%	1.31%	-0.04%
过去一年	41.08%	1.43%	34.54%	1.50%	6.54%	-0.07%
过去三年	65.11%	1.64%	24.96%	1.63%	40.15%	0.01%
过去五年	59.47%	1.47%	21.13%	1.34%	38.34%	0.13%
自基金合同生效起至今	124.43%	1.40%	29.20%	1.20%	95.23%	0.20%

东方量化成长灵活配置混合 C

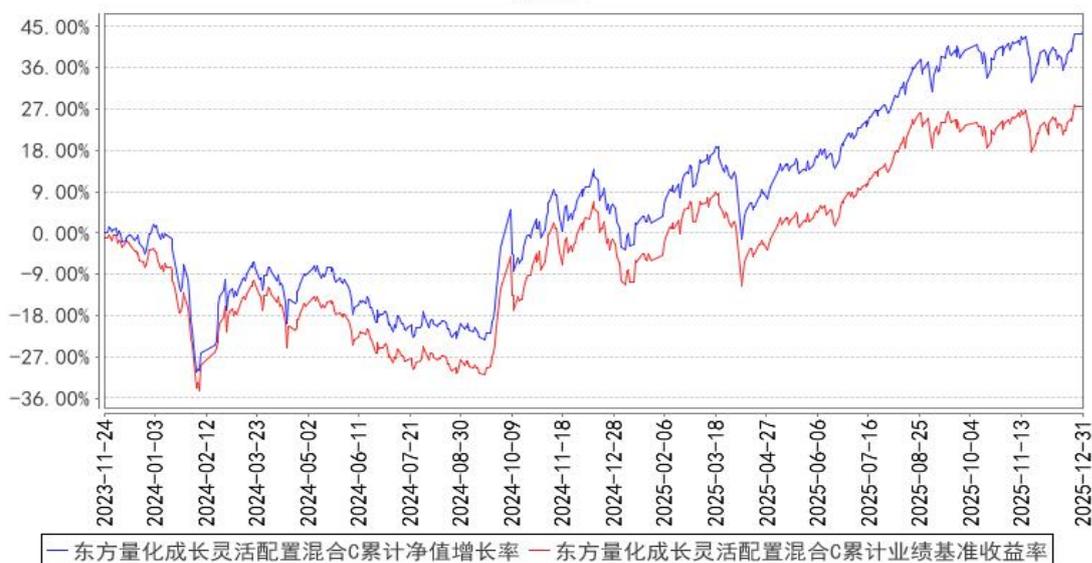
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.76%	1.12%	3.40%	1.13%	-0.64%	-0.01%
过去六个月	18.45%	1.05%	17.44%	1.09%	1.01%	-0.04%
过去一年	40.38%	1.43%	34.54%	1.50%	5.84%	-0.07%
自基金合同生效起至今	43.79%	1.87%	27.54%	1.92%	16.25%	-0.05%

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

东方量化成长灵活配置混合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

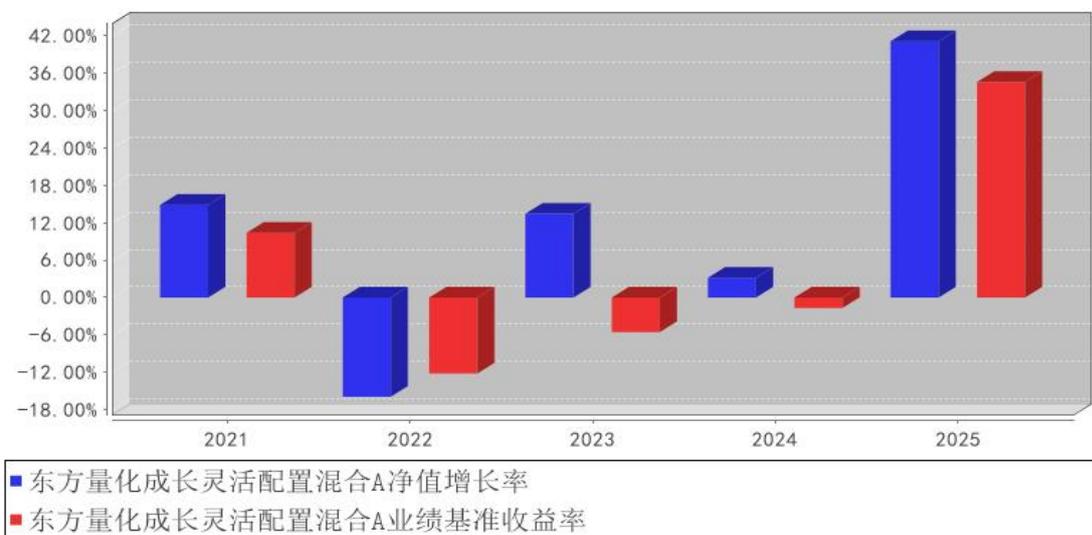


东方量化成长灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

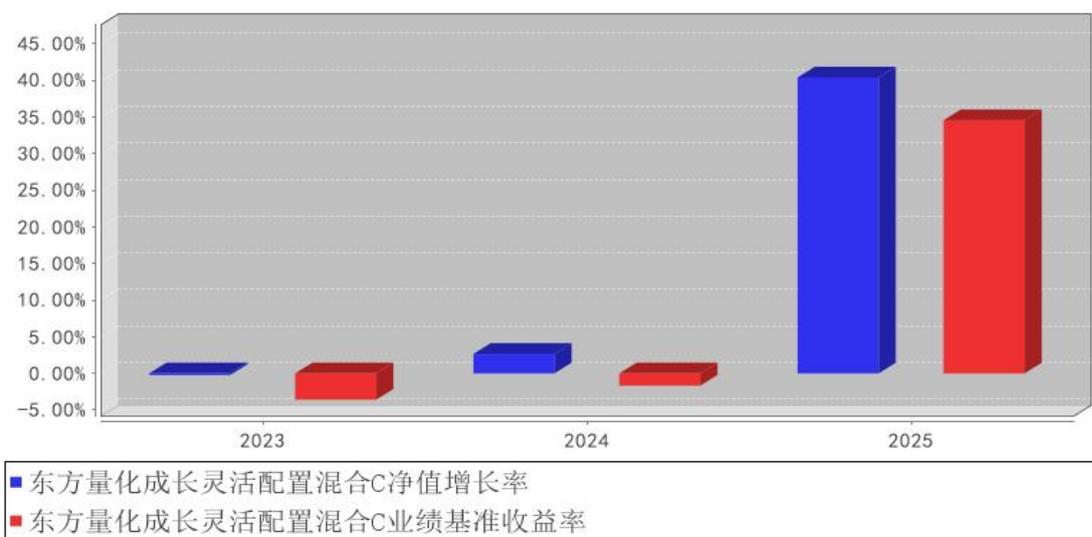


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化成长灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东方量化成长灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	-	-	-	-	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-
合计	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-

§ 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12月31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12月31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）基金、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）基金、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金。

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、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理。
盛泽	本基金基金经理、	2018 年 8 月 13 日	2025 年 3 月 12 日	10 年	量化投资部总经理，华威大学经济与国际金融经济学硕士，10 年证券从业经历。曾

<p>量化投资部总经理</p>				<p>任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018年7月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理、量化投资部副总经理、资产配置部总经理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证500指数增强型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理，现任东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方沪深300指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证A500指数增强型证券投资基金基金经理。</p>
-----------------	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

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、《东方量化成长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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易管理制度的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 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，本基金继续以小微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。

2025年小市值表现较好，产品收益也受益于基准指数中证2000的良好表现。从超额收益来看，产品本期总体超额收益为正，超额收益主要由上半年贡献，下半年超额收益相对较少，尤其其中7月初至8月中旬之间呈现回撤。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日,本基金 A 类净值增长率为 41.08%,业绩比较基准收益率为 34.54%,高于业绩比较基准 6.54%;本基金 C 类净值增长率为 40.38%,业绩比较基准收益率为 34.54%,高于业绩比较基准 5.84%。

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,国内宏观经济运行总体平稳,增长韧性逐步显现,内需政策支持与预期改善带动下温和修复,产业结构调整持续推进,新动能贡献度有所提升,流动性环境保持合理充裕。展望后续,2026 年两会释放继续稳增长、稳就业并“努力争取更好结果”的政策信号,提出经济增长 4.5%—5%的预期目标,有望进一步巩固市场对基本面企稳向好的预期,为经济运行与资本市场提供更为友好的宏观环境。资本市场风险偏好或有望在波动中温和修复,预计政策支持与景气改善预期相对明确的领域或更易获得资金青睐,结构性机会仍值得关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定,完善内部控制制度和操作流程;在基金日常运作上,开展定期和不定期监察,强化内控体系和制度的落实;在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面,通过定期检查、专项检查等方式,及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括:

(1) 开展对公司各项业务的日常监察,对风险隐患做到及时发现、及时化解,保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。(2) 根据中国证监会颁布的相关法律法规,进一步加强基金投资运作的监察力度,完善了基金投资有关控制制度。(3) 进一步完善公司内控体系,完善业务流程,在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制,并进行持续监督,跟踪检查执行情况。

(4) 注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察,并通过开展法规学习活动等形式,提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度,本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上,确保基金资产的规范运作,维护基金份额持有人的合法利益,给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),估值委员会委员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运

营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

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

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

⑤负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

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

4. 合规法务部、风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.8 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2602436 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操

	作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人东方基金管理股份有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报</p>

	<p>风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	龚凯 刘莹
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2026年3月30日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,416,989.30	6,989,954.01
结算备付金		3,036,488.17	1,913,819.23
存出保证金		33,573.16	21,833.32
交易性金融资产	7.4.7.2	107,605,194.77	57,363,193.95
其中：股票投资		101,347,476.42	53,431,312.99
基金投资		-	-
债券投资		6,257,718.35	3,931,880.96

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		94,608.59	79,120.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		114,186,853.99	66,367,921.32
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,001,764.40	-139.43
应付清算款		159.08	2,629,253.10
应付赎回款		1,313,853.71	4,200,957.20
应付管理人报酬		111,964.98	68,324.38
应付托管费		18,660.85	11,387.38
应付销售服务费		5,001.02	3,811.86
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	7.4.7.7	287,414.66	233,469.54
负债合计		5,738,818.70	7,147,064.03
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	63,056,094.37	48,223,380.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	45,391,940.92	10,997,476.90
净资产合计		108,448,035.29	59,220,857.29
负债和净资产总计		114,186,853.99	66,367,921.32

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，东方量化成长灵活配置混合 A 基金份额净值 1.6748 元，基金份额总额 57,994,126.78 份；东方量化成长灵活配置混合 C 基金份额净值 2.2363 元，基金份额

总额 5,061,967.59 份。东方量化成长灵活配置混合份额总额合计为 63,056,094.37 份。

7.2 利润表

会计主体：东方量化成长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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		31,803,042.70	-69,200,775.81
1. 利息收入		38,644.63	60,735.74
其中：存款利息收入	7.4.7.10	38,644.63	60,634.08
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		-	101.66
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		35,623,754.31	-70,729,422.54
其中：股票投资收益	7.4.7.11	34,179,293.99	-71,868,041.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	68,406.60	153,831.57
资产支持证券投 资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	750,187.52	226,267.66
股利收益	7.4.7.16	625,866.20	758,519.65
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）	7.4.7.17	-4,225,821.95	-292,087.57
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	366,465.71	1,759,998.56
减：二、营业总支出		1,525,188.78	1,588,663.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,099,143.13	1,150,648.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	183,190.64	191,774.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	55,646.97	69,881.09

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		37,522.13	23,078.31
其中：卖出回购金融资产支出		37,522.13	23,078.31
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		2,702.16	815.77
8. 其他费用	7.4.7.20	146,983.75	152,465.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,277,853.92	-70,789,439.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,277,853.92	-70,789,439.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		30,277,853.92	-70,789,439.40

7.3 净资产变动表

会计主体：东方量化成长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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,832,713.98	-	34,394,464.02	49,227,178.00
（一）、综合收益总额	-	-	30,277,853.92	30,277,853.92
（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）	14,832,713.98	-	4,116,610.10	18,949,324.08
其中：1. 基金申	91,293,542.68	-	54,648,338.51	145,941,881.19

购款				
2. 基金赎回款	-76,460,828.70	-	-50,531,728.41	-126,992,557.11
(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	63,056,094.37	-	45,391,940.92	108,448,035.29
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31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	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-303,540,500.03	-	-45,420,475.92	-348,960,975.95
(一)、综合收益总额	-	-	-70,789,439.40	-70,789,439.40
(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)	-303,540,500.03	-	25,368,963.48	-278,171,536.55
其中：1. 基金申购款	178,215,023.74	-	39,291,196.38	217,506,220.12
2. 基金赎回款	-481,755,523.77	-	-13,922,232.90	-495,677,756.67
(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	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>王丹丹</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 6 月 24 日中国证监会《关于准予东方臻利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1419 号），2017 年 8 月 22 日中国证监会《关于准予东方臻利债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1557 号）和《关于东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（证券基金机构监管部部函[2018]644 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《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2018 年 2 月 5 日至 2018 年 3 月 16 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 694,130,731.06 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2018]第 01300010 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 694,463,618.20 份基金单位，其中认购资金利息折合 332,887.14 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金自 2023 年 11 月 24 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 2023 年 11 月 23 日发布的《关于东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额、变更业绩比较基准并修改《基金合同》等法律文件的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可交换债券、可转换债券、分离交易的可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

7.4.2 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》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现

损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的各类基金份额的基金份额净值转成相应类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红

方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后任一类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	3,416,989.30	6,989,954.01
等于：本金	3,416,504.44	6,989,311.34
加：应计利息	484.86	642.67
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	3,416,989.30	6,989,954.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	105,668,075.03	-	101,347,476.42	-4,320,598.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	6,200,434.00	55,978.35	6,257,718.35	1,306.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,200,434.00	55,978.35	6,257,718.35	1,306.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		111,868,509.03	55,978.35	107,605,194.77	-4,319,292.61
项目	上年度末 2024年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		53,528,570.65	-	53,431,312.99	-97,257.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,903,203.00	24,890.96	3,931,880.96	3,787.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,903,203.00	24,890.96	3,931,880.96	3,787.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		57,431,773.65	24,890.96	57,363,193.95	-93,470.66

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
----	--------------------	---------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	810.77	4,002.93
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	169,603.89	105,466.61
其中：交易所市场	169,603.89	105,466.61
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	117,000.00	124,000.00
合计	287,414.66	233,469.54

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,353,886.63	43,353,886.63
本期申购	64,790,327.13	64,790,327.13
本期赎回（以“-”号填列）	-50,150,086.98	-50,150,086.98
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	57,994,126.78	57,994,126.78

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,869,493.76	4,869,493.76
本期申购	26,503,215.55	26,503,215.55
本期赎回（以“-”号填列）	-26,310,741.72	-26,310,741.72
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	5,061,967.59	5,061,967.59

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。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,370,088.25	-13,260,105.34	8,109,982.91
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,370,088.25	-13,260,105.34	8,109,982.91
本期利润	29,953,878.17	-3,360,243.94	26,593,634.23
本期基金份额交易产生的变动数	7,171,730.20	-2,741,326.32	4,430,403.88
其中：基金申购款	46,998,430.31	-17,914,271.94	29,084,158.37
基金赎回款	-39,826,700.11	15,172,945.62	-24,653,754.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,495,696.62	-19,361,675.60	39,134,021.02

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,238,089.97	-1,350,595.98	2,887,493.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,238,089.97	-1,350,595.98	2,887,493.99
本期利润	4,549,797.70	-865,578.01	3,684,219.69
本期基金份额交易产生的变动数	-936,389.52	622,595.74	-313,793.78
其中：基金申购款	31,877,559.61	-6,313,379.47	25,564,180.14
基金赎回款	-32,813,949.13	6,935,975.21	-25,877,973.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,851,498.15	-1,593,578.25	6,257,919.90

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	16,609.36	23,511.92
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	21,955.70	34,577.93
其他	79.57	2,544.23
合计	38,644.63	60,634.08

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖	34,179,293.99	-71,868,041.42

股票差价收入		
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	34,179,293.99	-71,868,041.42

7.4.7.11.2 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出股票成交总 额	676,994,282.20	1,770,332,103.99
减：卖出股票成本 总额	641,781,164.08	1,839,220,701.36
减：交易费用	1,033,824.13	2,979,444.05
买卖股票差价收 入	34,179,293.99	-71,868,041.42

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	69,518.60	103,400.85
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	-1,112.00	50,430.72
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	68,406.60	153,831.57

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,662,169.70	30,244,494.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,600,651.00	29,862,550.28
减：应计利息总额	62,630.70	331,513.30
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-1,112.00	50,430.72

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	750,187.52	226,267.66

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	625,866.20	758,519.65
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	625,866.20	758,519.65
----	------------	------------

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,225,821.95	-292,087.57
股票投资	-4,223,340.95	-262,936.85
债券投资	-2,481.00	-29,150.72
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	-4,225,821.95	-292,087.57

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	340,897.01	1,698,144.74
基金转换费收入	25,568.70	61,853.82
合计	366,465.71	1,759,998.56

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	28,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,783.75	265.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	146,983.75	152,465.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北国控资本管理有限公司	本基金管理人股东
海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人全资子公司

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	350,244,478.68	25.55	271,579,927.77	8.27

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	3,397,292.00	25.17	5,702,171.00	13.63

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	38,300,000.00	61.58	2,900,000.00	8.60

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	156,173.91	25.71	56,973.15	33.59
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	242,794.22	12.89	12,584.61	11.93

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,099,143.13	1,150,648.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	403,862.04	295,752.99
应支付基金管理人的净管理费	695,281.09	854,895.69

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 1.20% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	183,190.64	191,774.74

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 0.20% 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	306.92	306.92
合计	-	306.92	306.92
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	5,424.99	5,424.99
合计	-	5,424.99	5,424.99

注：①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 类基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 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，未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,416,989.30	16,609.36	6,989,954.01	23,511.92

7.4.10.7 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。

7.4.11 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股流通受限	48.00	57.16	78	3,744.00	4,458.48	-
001280	中国钨业	2025年11月25日	6个月	新股流通受限	17.89	57.64	471	8,426.19	27,148.44	-

		日								
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	42.28	56.11	31	1,310.68	1,739.41	-
001369	双欣材料	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	6.85	15.66	192	1,315.20	3,006.72	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	22.29	40.76	54	1,203.66	2,201.04	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股流通受限	36.80	75.01	68	2,502.40	5,100.68	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	27.00	137.23	98	2,646.00	13,448.54	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股流通受限	7.05	26.80	367	2,587.35	9,835.60	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股流通受限	5.69	17.17	492	2,799.48	8,447.64	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.48	777	9,696.96	19,797.96	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股流通受限	22.63	73.23	93	2,104.59	6,810.39	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	67.75	94	2,061.42	6,368.50	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001331	胜通	2025	股价异	46.31	2026	50.94	200	2,672.00	9,262.00	-

	能源	年 12 月 30 日	动		年 01 月 06 日					
--	----	-------------------	---	--	-------------------	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,001,764.40 元，于 2026 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2025 年 12 月 31 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

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。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 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

7.4.13.2.3 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 12 月 31 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

7.4.13.2.4 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.5 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 12 月 31 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

7.4.13.2.6 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 12 月 31 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,416,989.30	-	-	-	3,416,989.30
结算备付金	3,036,488.17	-	-	-	3,036,488.17
存出保证金	33,573.16	-	-	-	33,573.16
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-101,347,476.42	101,347,476.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,257,718.35	-	-	-	6,257,718.35
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	94,608.59	94,608.59
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,744,768.98	-	-	-101,442,085.01	114,186,853.99
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	4,001,764.40	-	-	-	4,001,764.40
应付清算款	-	-	-	159.08	159.08
应付赎回款	-	-	-	1,313,853.71	1,313,853.71
应付管理人报酬	-	-	-	111,964.98	111,964.98
应付托管费	-	-	-	18,660.85	18,660.85
应付销售服务费	-	-	-	5,001.02	5,001.02
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	-	-	-	287,414.66	287,414.66
负债总计	4,001,764.40	-	-	1,737,054.30	5,738,818.70
利率敏感度缺口	8,743,004.58	-	-	99,705,030.71	108,448,035.29
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	6,989,954.01	-	-	-	6,989,954.01
结算备付金	1,913,819.23	-	-	-	1,913,819.23
存出保证金	21,833.32	-	-	-	21,833.32
交易性金融资产-股 票投资	-	-	-	53,431,312.99	53,431,312.99
交易性金融资产-基 金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债 券投资	3,931,880.96	-	-	-	3,931,880.96
交易性金融资产-资 产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	79,120.81	79,120.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,857,487.52	-	-	53,510,433.80	66,367,921.32
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-139.43	-	-	-	-139.43
应付清算款	-	-	-	2,629,253.10	2,629,253.10
应付赎回款	-	-	-	4,200,957.20	4,200,957.20
应付管理人报酬	-	-	-	68,324.38	68,324.38
应付托管费	-	-	-	11,387.38	11,387.38
应付销售服务费	-	-	-	3,811.86	3,811.86
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	-	-	-	233,469.54	233,469.54
负债总计	-139.43	-	-	7,147,203.46	7,147,064.03
利率敏感度缺口	12,857,626.95	-	-	46,363,230.34	59,220,857.29

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-5,326.00	-5,329.21
	市场利率下调 0.25%	5,326.00	5,329.21

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	101,347,476.42	93.45	53,431,312.99	90.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	6,257,718.35	5.77	3,931,880.96	6.64

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	107,605,194.77	99.22	57,363,193.95	96.86

7.4.13.4.3.2 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12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	沪深 300 指数上涨 5%	4,524,810.25	3,215,946.63
	沪深 300 指数下跌 5%	-4,524,810.25	-3,215,946.63

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	101,229,851.02	53,237,560.99
第二层次	6,266,980.35	4,125,632.96
第三层次	108,363.40	-
合计	107,605,194.77	57,363,193.95

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	40,397.93	40,397.93
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	67,965.47	67,965.47
其中：计入损益的利得或损失	-	67,965.47	67,965.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	108,363.40	108,363.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	67,965.47	67,965.47

项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	58,683.05	58,683.05
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	81,810.97	81,810.97
转出第三层次	-	187,677.72	187,677.72
当期利得或损失总额	-	47,183.70	47,183.70
其中：计入损益的利得或损失	-	47,183.70	47,183.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	108,363.40	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	29.38%-94.23%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	101,347,476.42	88.76
	其中：股票	101,347,476.42	88.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,257,718.35	5.48
	其中：债券	6,257,718.35	5.48
	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	6,453,477.47	5.65
8	其他各项资产	128,181.75	0.11
9	合计	114,186,853.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,044,150.00	0.96
B	采矿业	284,360.44	0.26
C	制造业	75,048,065.68	69.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,371,088.00	1.26
E	建筑业	599,896.00	0.55
F	批发和零售业	4,320,213.14	3.98
G	交通运输、仓储和邮政业	742,101.00	0.68
H	住宿和餐饮业	149,841.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,943,163.72	9.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,039,378.00	1.88
L	租赁和商务服务业	1,285,814.00	1.19

M	科学研究和技术服务业	2,459,703.56	2.27
N	水利、环境和公共设施管理业	729,217.88	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	151,998.00	0.14
P	教育	159,952.00	0.15
Q	卫生和社会工作	174,421.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	842,484.00	0.78
S	综合	1,629.00	0.00
	合计	101,347,476.42	93.45

8.2.2 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。

8.3 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	000570	苏常柴 A	190,300	1,058,068.00	0.98
2	600386	北巴传媒	167,000	733,130.00	0.68
3	002412	汉森制药	103,800	665,358.00	0.61
4	002546	新联电子	90,600	633,294.00	0.58
5	603319	美湖股份	17,100	625,518.00	0.58
6	300053	航宇微	30,500	580,110.00	0.53
7	688636	智明达	12,778	547,409.52	0.50
8	600429	三元股份	102,000	528,360.00	0.49
9	002322	理工能科	43,800	526,038.00	0.49
10	300680	隆盛科技	8,900	497,243.00	0.46
11	301005	超捷股份	3,200	496,864.00	0.46
12	301183	东田微	3,200	496,288.00	0.46
13	603183	建研院	113,600	489,616.00	0.45
14	002664	信质集团	19,900	476,804.00	0.44
15	688401	路维光电	9,599	468,527.19	0.43
16	603191	望变电气	31,400	465,034.00	0.43
17	300292	吴通控股	102,300	461,373.00	0.43
18	002565	顺灏股份	24,700	452,751.00	0.42
19	688066	航天宏图	13,864	451,411.84	0.42
20	002533	金杯电工	36,000	449,280.00	0.41
21	002782	可立克	24,600	446,736.00	0.41
22	002297	博云新材	36,500	436,905.00	0.40
23	301075	多瑞医药	7,200	429,624.00	0.40
24	002441	众业达	45,300	425,820.00	0.39
25	301086	鸿富瀚	3,800	425,182.00	0.39
26	603336	宏辉果蔬	49,300	422,008.00	0.39
27	301382	蜂助手	11,700	414,648.00	0.38
28	600792	云煤能源	106,100	411,668.00	0.38

29	688275	万润新能	5,415	408,291.00	0.38
30	301326	捷邦科技	3,700	403,892.00	0.37
31	300101	振芯科技	14,200	403,706.00	0.37
32	600645	中源协和	16,000	403,200.00	0.37
33	301392	汇成真空	3,100	400,024.00	0.37
34	688526	科前生物	25,500	389,130.00	0.36
35	300415	伊之密	14,800	385,688.00	0.36
36	300980	祥源新材	11,700	381,771.00	0.35
37	002115	三维通信	29,800	379,652.00	0.35
38	603130	云中马	6,700	379,555.00	0.35
39	000530	冰山冷热	51,500	376,980.00	0.35
40	002943	宇晶股份	9,500	376,200.00	0.35
41	603399	永杉锂业	36,200	376,118.00	0.35
42	002083	孚日股份	31,600	376,040.00	0.35
43	688028	沃尔德	5,799	374,267.46	0.35
44	600266	城建发展	73,200	371,124.00	0.34
45	301419	阿莱德	10,900	369,292.00	0.34
46	300041	回天新材	33,000	365,640.00	0.34
47	001319	铭科精技	13,300	365,351.00	0.34
48	000534	万泽股份	16,600	365,200.00	0.34
49	688590	新致软件	19,556	364,914.96	0.34
50	300790	宇瞳光学	12,200	364,902.00	0.34
51	002386	天原股份	66,600	361,638.00	0.33
52	603328	依顿电子	32,500	356,200.00	0.33
53	000049	德赛电池	13,200	354,816.00	0.33
54	002334	英威腾	39,300	354,486.00	0.33
55	002970	锐明技术	7,300	354,050.00	0.33
56	300720	海川智能	10,400	352,456.00	0.32
57	300785	值得买	8,000	350,560.00	0.32
58	002865	钧达股份	6,400	349,504.00	0.32
59	300539	横河精密	8,300	348,766.00	0.32
60	300342	天银机电	10,500	347,865.00	0.32
61	688378	奥来德	12,667	345,809.10	0.32
62	300740	水羊股份	14,400	343,296.00	0.32
63	688478	晶升股份	9,171	343,087.11	0.32
64	603687	大胜达	35,700	340,221.00	0.31
65	002626	金达威	17,200	339,012.00	0.31
66	300352	北信源	55,100	337,763.00	0.31
67	688238	和元生物	50,136	333,905.76	0.31
68	300050	世纪鼎利	60,200	332,906.00	0.31
69	300242	佳云科技	66,200	331,000.00	0.31
70	002687	乔治白	68,200	328,724.00	0.30
71	002438	江苏神通	20,600	327,540.00	0.30

72	688336	三生国健	5,495	327,337.15	0.30
73	002955	鸿合科技	10,800	326,916.00	0.30
74	002100	天康生物	44,300	326,491.00	0.30
75	003019	宸展光电	9,700	324,756.00	0.30
76	001208	华菱线缆	13,500	324,540.00	0.30
77	002345	潮宏基	25,900	323,750.00	0.30
78	001283	豪鹏科技	4,600	322,000.00	0.30
79	301201	诚达药业	7,900	321,530.00	0.30
80	300700	岱勒新材	26,000	321,100.00	0.30
81	603131	上海沪工	10,600	320,650.00	0.30
82	688601	力芯微	7,445	317,082.55	0.29
83	688007	光峰科技	16,987	315,448.59	0.29
84	688347	华虹公司	2,916	314,548.92	0.29
85	300375	鹏翎股份	59,300	311,918.00	0.29
86	000735	罗牛山	34,300	310,072.00	0.29
87	300095	华伍股份	25,400	307,848.00	0.28
88	688262	国芯科技	10,135	307,597.25	0.28
89	603122	合富中国	12,600	307,440.00	0.28
90	301263	泰恩康	10,600	307,294.00	0.28
91	600888	新疆众和	37,500	307,125.00	0.28
92	002285	世联行	107,300	305,805.00	0.28
93	002134	天津普林	11,400	305,406.00	0.28
94	688552	航天南湖	8,392	304,797.44	0.28
95	603286	日盈电子	4,400	304,304.00	0.28
96	688539	高华科技	6,123	303,149.73	0.28
97	688518	联赢激光	12,463	302,726.27	0.28
98	688285	高铁电气	34,857	302,558.76	0.28
99	688711	宏微科技	9,514	301,879.22	0.28
100	002445	中南文化	116,000	301,600.00	0.28
101	300963	中洲特材	14,500	301,310.00	0.28
102	300231	银信科技	28,600	301,158.00	0.28
103	301349	信德新材	6,400	300,224.00	0.28
104	301110	青木科技	4,500	297,810.00	0.27
105	300945	曼卡龙	18,400	297,344.00	0.27
106	301391	卡莱特	3,500	296,975.00	0.27
107	002250	联化科技	22,000	294,360.00	0.27
108	000058	深赛格	31,200	293,280.00	0.27
109	301125	腾亚精工	15,900	292,242.00	0.27
110	300048	合康新能	49,000	291,550.00	0.27
111	688261	东微半导	3,553	291,381.53	0.27
112	300075	数字政通	18,900	289,926.00	0.27
113	000417	合百集团	35,600	288,360.00	0.27
114	688179	阿拉丁	22,977	286,982.73	0.26

115	002519	银河电子	43,900	284,472.00	0.26
116	300008	天海防务	36,000	284,040.00	0.26
117	300663	科蓝软件	16,100	284,004.00	0.26
118	600693	东百集团	15,900	283,338.00	0.26
119	301529	福赛科技	2,500	282,750.00	0.26
120	002491	通鼎互联	47,100	282,600.00	0.26
121	688233	神工股份	4,030	282,220.90	0.26
122	002965	祥鑫科技	6,930	281,912.40	0.26
123	002823	凯中精密	17,500	281,050.00	0.26
124	300189	神农种业	37,700	280,488.00	0.26
125	300499	高澜股份	9,100	279,188.00	0.26
126	600229	城市传媒	43,900	278,326.00	0.26
127	603115	海星股份	14,800	276,908.00	0.26
128	301327	华宝新能	4,800	276,816.00	0.26
129	000823	超声电子	20,300	275,268.00	0.25
130	688598	金博股份	9,341	274,251.76	0.25
131	300952	恒辉安防	6,700	273,829.00	0.25
132	688268	华特气体	4,758	273,061.62	0.25
133	301307	美利信	7,800	269,724.00	0.25
134	300148	天舟文化	61,400	269,546.00	0.25
135	688041	海光信息	1,200	269,292.00	0.25
136	002164	宁波东力	16,800	268,968.00	0.25
137	688525	佰维存储	2,341	268,723.39	0.25
138	300252	金信诺	18,300	267,546.00	0.25
139	688562	航天软件	11,151	266,285.88	0.25
140	688383	新益昌	3,400	266,118.00	0.25
141	002792	通宇通讯	6,200	264,740.00	0.24
142	300932	三友联众	21,900	262,581.00	0.24
143	000782	恒申新材	52,500	260,400.00	0.24
144	600748	上实发展	47,900	259,618.00	0.24
145	300903	科翔股份	13,300	256,557.00	0.24
146	688593	新相微	12,671	255,700.78	0.24
147	301093	华兰股份	5,000	255,500.00	0.24
148	600686	金龙汽车	14,400	255,456.00	0.24
149	300806	斯迪克	8,300	255,142.00	0.24
150	002899	英派斯	9,300	254,541.00	0.23
151	300291	百纳千成	33,800	253,162.00	0.23
152	300139	晓程科技	8,300	251,988.00	0.23
153	000819	岳阳兴长	15,500	251,565.00	0.23
154	002208	合肥城建	20,300	251,314.00	0.23
155	301082	久盛电气	14,000	250,600.00	0.23
156	605598	上海港湾	3,600	250,128.00	0.23
157	300560	中富通	15,400	248,864.00	0.23

158	603280	南方路机	6,600	246,840.00	0.23
159	301096	百诚医药	4,300	245,702.00	0.23
160	002300	太阳电缆	26,400	242,880.00	0.22
161	601116	三江购物	17,600	242,352.00	0.22
162	300087	荃银高科	20,700	241,776.00	0.22
163	300134	大富科技	19,200	240,000.00	0.22
164	300435	中泰股份	10,800	239,976.00	0.22
165	301020	密封科技	10,800	238,680.00	0.22
166	301021	英诺激光	4,900	238,385.00	0.22
167	688720	艾森股份	3,376	237,602.88	0.22
168	300443	金雷股份	8,440	237,417.20	0.22
169	300569	天能重工	41,300	237,062.00	0.22
170	002383	合众思壮	18,800	236,692.00	0.22
171	002474	榕基软件	23,700	233,682.00	0.22
172	002956	西麦食品	8,300	233,396.00	0.22
173	605305	中际联合	5,600	233,296.00	0.22
174	600817	宇通重工	20,300	230,811.00	0.21
175	300219	鸿利智汇	31,900	229,999.00	0.21
176	301280	珠城科技	4,300	229,018.00	0.21
177	603187	海容冷链	14,500	227,505.00	0.21
178	688448	磁谷科技	4,692	227,421.24	0.21
179	301555	惠柏新材	6,800	227,324.00	0.21
180	300531	优博讯	12,600	227,304.00	0.21
181	003043	华亚智能	4,900	227,213.00	0.21
182	002350	北京科锐	27,900	227,106.00	0.21
183	300902	国安达	10,900	227,047.00	0.21
184	688199	久日新材	9,612	226,554.84	0.21
185	600714	金瑞矿业	18,400	225,584.00	0.21
186	688155	先惠技术	3,699	223,604.55	0.21
187	002374	中锐股份	62,000	223,200.00	0.21
188	688581	安杰思	3,800	222,794.00	0.21
189	301120	新特电气	12,900	222,783.00	0.21
190	301150	中一科技	5,300	222,547.00	0.21
191	002029	七匹狼	20,000	220,600.00	0.20
192	688228	开普云	1,133	220,493.13	0.20
193	301290	东星医疗	8,700	219,849.00	0.20
194	300286	安科瑞	9,500	219,260.00	0.20
195	603808	歌力思	25,700	218,964.00	0.20
196	688258	卓易信息	2,855	218,607.35	0.20
197	000586	汇源通信	16,100	217,833.00	0.20
198	301158	德石股份	9,700	216,989.00	0.20
199	301132	满坤科技	6,500	216,450.00	0.20
200	603367	辰欣药业	12,400	214,768.00	0.20

201	600552	凯盛科技	17,300	214,520.00	0.20
202	301106	骏成科技	7,200	214,344.00	0.20
203	300365	恒华科技	33,900	214,248.00	0.20
204	301051	信濠光电	10,900	213,640.00	0.20
205	605208	永茂泰	15,700	213,206.00	0.20
206	300589	江龙船艇	11,800	212,990.00	0.20
207	300179	四方达	13,900	210,168.00	0.19
208	301518	长华化学	5,900	209,863.00	0.19
209	300513	恒实科技	22,100	209,729.00	0.19
210	301448	开创电气	4,200	209,328.00	0.19
211	600756	浪潮软件	11,300	208,146.00	0.19
212	688718	唯赛勃	15,888	207,815.04	0.19
213	600814	杭州解百	25,600	207,360.00	0.19
214	301007	德迈仕	5,100	206,652.00	0.19
215	301260	格力博	12,000	204,600.00	0.19
216	600278	东方创业	26,900	204,440.00	0.19
217	603289	泰瑞机器	20,100	203,412.00	0.19
218	688371	菲沃泰	10,962	202,468.14	0.19
219	688079	美迪凯	17,881	202,412.92	0.19
220	301117	佳缘科技	3,800	202,350.00	0.19
221	688255	凯尔达	5,500	201,465.00	0.19
222	002314	南山控股	70,500	200,925.00	0.19
223	600195	中牧股份	25,500	200,685.00	0.19
224	605555	德昌股份	10,900	199,470.00	0.18
225	300119	瑞普生物	10,600	198,962.00	0.18
226	002997	瑞鹄模具	5,300	198,220.00	0.18
227	300283	温州宏丰	26,200	197,286.00	0.18
228	688618	三旺通信	7,358	196,164.28	0.18
229	688410	山外山	13,062	195,538.14	0.18
230	301063	海锅股份	8,000	195,280.00	0.18
231	301136	招标股份	9,600	194,496.00	0.18
232	600572	康恩贝	43,600	194,456.00	0.18
233	000031	大悦城	68,900	194,298.00	0.18
234	300890	翔丰华	6,500	193,700.00	0.18
235	002075	沙钢股份	33,400	192,050.00	0.18
236	600103	青山纸业	45,800	191,902.00	0.18
237	688038	中科通达	10,859	191,878.53	0.18
238	688049	炬芯科技	3,642	191,569.20	0.18
239	603275	众辰科技	4,200	191,436.00	0.18
240	301360	荣旗科技	2,700	191,430.00	0.18
241	300648	星云股份	3,700	190,846.00	0.18
242	300838	浙江力诺	12,500	190,625.00	0.18
243	003041	真爱美家	3,500	190,155.00	0.18

244	300681	英搏尔	7,500	187,950.00	0.17
245	002479	富春环保	38,300	187,670.00	0.17
246	002039	黔源电力	10,300	187,151.00	0.17
247	688109	品茗科技	1,463	185,947.30	0.17
248	605228	神通科技	12,400	185,132.00	0.17
249	002669	康达新材	12,100	183,920.00	0.17
250	002655	共达电声	14,100	182,172.00	0.17
251	688315	诺禾致源	13,713	182,108.64	0.17
252	001328	登康口腔	4,600	181,608.00	0.17
253	688209	英集芯	9,030	180,058.20	0.17
254	301031	中熔电气	1,600	179,504.00	0.17
255	301012	扬电科技	6,700	177,215.00	0.16
256	300072	海新能科	38,500	177,100.00	0.16
257	688719	爱科赛博	4,010	177,041.50	0.16
258	300916	朗特智能	5,400	177,012.00	0.16
259	688456	有研粉材	2,250	174,825.00	0.16
260	603380	易德龙	4,600	174,800.00	0.16
261	600262	北方股份	6,700	174,401.00	0.16
262	600212	绿能慧充	21,600	173,880.00	0.16
263	600020	中原高速	40,700	173,382.00	0.16
264	688138	清溢光电	6,151	173,212.16	0.16
265	300464	星徽股份	27,300	173,082.00	0.16
266	301153	中科江南	7,000	173,040.00	0.16
267	603859	能科科技	4,100	172,405.00	0.16
268	300278	华昌达	28,200	172,020.00	0.16
269	301381	赛维时代	8,300	170,897.00	0.16
270	600798	宁波海运	48,500	170,720.00	0.16
271	002279	久其软件	21,300	170,187.00	0.16
272	301228	实朴检测	4,400	169,884.00	0.16
273	300891	惠云钛业	19,300	169,840.00	0.16
274	301209	联合化学	1,500	169,335.00	0.16
275	002866	传艺科技	9,400	169,294.00	0.16
276	000899	赣能股份	17,000	168,300.00	0.16
277	300997	欢乐家	6,400	167,360.00	0.15
278	300619	金银河	3,800	166,820.00	0.15
279	001230	劲旅环境	7,600	165,604.00	0.15
280	301320	豪江智能	9,700	164,609.00	0.15
281	688247	宣泰医药	16,948	164,395.60	0.15
282	688392	骄成超声	1,458	163,587.60	0.15
283	688236	春立医疗	7,110	162,676.80	0.15
284	300086	康芝药业	13,500	162,405.00	0.15
285	688084	晶品特装	1,949	161,377.20	0.15
286	603615	茶花股份	6,900	161,322.00	0.15

287	603931	格林达	5,100	161,058.00	0.15
288	002420	毅昌科技	20,900	160,721.00	0.15
289	688648	中邮科技	2,604	160,041.84	0.15
290	300673	佩蒂股份	8,900	159,577.00	0.15
291	688148	芳源股份	18,176	159,403.52	0.15
292	300043	星辉娱乐	28,200	159,330.00	0.15
293	301526	国际复材	22,400	156,800.00	0.14
294	002635	安洁科技	11,300	156,618.00	0.14
295	300991	创益通	3,700	156,066.00	0.14
296	603989	艾华集团	9,300	156,054.00	0.14
297	688579	地纬智能	14,456	155,835.68	0.14
298	300062	中能电气	18,600	154,938.00	0.14
299	688472	阿特斯	10,378	154,735.98	0.14
300	002728	特一药业	14,200	154,070.00	0.14
301	688030	山石网科	8,434	153,245.78	0.14
302	300639	凯普生物	28,400	152,792.00	0.14
303	600724	宁波富达	26,400	152,064.00	0.14
304	300736	百邦科技	9,800	151,998.00	0.14
305	300702	天宇股份	6,400	151,040.00	0.14
306	301230	泓博医药	5,000	149,350.00	0.14
307	688118	普元信息	5,832	148,832.64	0.14
308	688610	埃科光电	2,400	148,344.00	0.14
309	688219	会通股份	11,940	148,294.80	0.14
310	605128	上海沿浦	4,000	147,440.00	0.14
311	000576	甘化科工	14,000	147,420.00	0.14
312	002918	蒙娜丽莎	10,300	146,569.00	0.14
313	301073	君亭酒店	5,600	145,936.00	0.13
314	002238	天威视讯	17,800	144,714.00	0.13
315	688609	九联科技	14,089	143,848.69	0.13
316	603151	邦基科技	7,900	142,358.00	0.13
317	000526	学大教育	3,600	141,192.00	0.13
318	688799	华纳药厂	2,937	140,094.90	0.13
319	002640	跨境通	30,600	138,618.00	0.13
320	603629	利通电子	5,200	138,580.00	0.13
321	301107	瑜欣电子	4,900	138,376.00	0.13
322	688197	首药控股	3,937	136,771.38	0.13
323	300774	倍杰特	7,100	134,900.00	0.12
324	605258	协和电子	4,300	134,461.00	0.12
325	688225	亚信安全	6,929	134,422.60	0.12
326	688416	恒烁股份	2,434	134,186.42	0.12
327	603713	密尔克卫	2,400	133,848.00	0.12
328	600796	钱江生化	22,000	133,320.00	0.12
329	605580	恒盛能源	5,900	133,104.00	0.12

330	300880	迦南智能	7,500	131,850.00	0.12
331	600235	民丰特纸	19,200	130,560.00	0.12
332	301367	瑞迈特	1,500	128,565.00	0.12
333	000677	恒天海龙	29,200	128,188.00	0.12
334	600638	新黄浦	19,700	127,459.00	0.12
335	002111	威海广泰	12,100	127,292.00	0.12
336	688267	中触媒	4,500	126,765.00	0.12
337	688620	安凯微	10,478	126,155.12	0.12
338	300387	富邦科技	14,700	125,097.00	0.12
339	002613	北玻股份	33,500	124,620.00	0.11
340	688737	中自科技	5,500	123,420.00	0.11
341	301272	英华特	3,000	123,150.00	0.11
342	605286	同力天启	3,000	121,830.00	0.11
343	301239	普瑞眼科	3,700	121,693.00	0.11
344	300535	达威股份	6,800	121,448.00	0.11
345	300970	华绿生物	5,900	121,009.00	0.11
346	600461	洪城环境	13,000	120,510.00	0.11
347	688176	亚虹医药	10,459	120,383.09	0.11
348	300022	吉峰科技	15,300	119,646.00	0.11
349	301578	辰奕智能	3,500	118,230.00	0.11
350	300709	精研科技	2,500	117,900.00	0.11
351	688510	航亚科技	4,376	117,714.40	0.11
352	002577	雷柏科技	6,600	117,546.00	0.11
353	002062	宏润建设	12,500	115,625.00	0.11
354	300652	雷迪克	2,100	115,206.00	0.11
355	603866	桃李面包	21,900	115,194.00	0.11
356	301072	中捷精工	5,100	114,852.00	0.11
357	688103	国力电子	1,894	114,757.46	0.11
358	603238	诺邦股份	6,500	114,530.00	0.11
359	002033	丽江股份	12,500	114,375.00	0.11
360	603326	我乐家居	12,800	113,920.00	0.11
361	002886	沃特股份	5,200	112,944.00	0.10
362	002516	旷达科技	17,100	112,689.00	0.10
363	300713	英可瑞	6,500	112,450.00	0.10
364	002068	黑猫股份	12,700	112,014.00	0.10
365	000529	广弘控股	18,400	110,584.00	0.10
366	300920	润阳科技	2,400	110,568.00	0.10
367	300021	大禹节水	24,000	110,400.00	0.10
368	603579	荣泰健康	4,600	109,526.00	0.10
369	688314	康拓医疗	3,300	109,098.00	0.10
370	300304	云意电气	9,300	108,252.00	0.10
371	003030	祖名股份	5,200	104,988.00	0.10
372	300320	海达股份	11,200	104,496.00	0.10

373	002469	三维化学	12,400	103,540.00	0.10
374	002941	新疆交建	6,500	103,025.00	0.09
375	688329	艾隆科技	4,805	102,298.45	0.09
376	300369	绿盟科技	13,600	101,728.00	0.09
377	603201	常润股份	6,000	101,280.00	0.09
378	688338	赛科希德	3,900	100,932.00	0.09
379	002988	豪美新材	2,700	99,360.00	0.09
380	002695	煌上煌	8,400	98,616.00	0.09
381	600790	轻纺城	25,400	97,282.00	0.09
382	688046	药康生物	6,273	96,353.28	0.09
383	300923	研奥股份	3,700	94,461.00	0.09
384	600425	青松建化	22,600	94,016.00	0.09
385	301151	冠龙节能	5,000	94,000.00	0.09
386	605050	福然德	6,900	92,943.00	0.09
387	688665	四方光电	1,874	91,394.98	0.08
388	300112	万讯自控	10,600	91,266.00	0.08
389	301266	宇邦新材	2,500	90,875.00	0.08
390	600359	新农开发	12,700	90,805.00	0.08
391	001326	联域股份	1,900	89,718.00	0.08
392	301220	亚香股份	2,340	88,335.00	0.08
393	301268	铭利达	4,800	87,504.00	0.08
394	002641	公元股份	20,200	87,264.00	0.08
395	603900	莱绅通灵	10,300	87,138.00	0.08
396	300787	海能实业	7,400	86,950.00	0.08
397	603767	中马传动	3,600	86,580.00	0.08
398	000402	金融街	30,700	84,425.00	0.08
399	603527	众源新材	7,500	83,175.00	0.08
400	300817	双飞集团	3,900	82,719.00	0.08
401	600649	城投控股	18,500	82,325.00	0.08
402	603848	好太太	4,400	80,388.00	0.07
403	688655	迅捷兴	4,683	80,219.79	0.07
404	301558	三态股份	9,800	79,870.00	0.07
405	603159	上海亚虹	3,100	79,701.00	0.07
406	002949	华阳国际	5,100	79,305.00	0.07
407	300873	海晨股份	3,600	79,092.00	0.07
408	002765	蓝黛科技	5,800	77,546.00	0.07
409	000828	东莞控股	7,200	77,472.00	0.07
410	300599	雄塑科技	9,500	77,425.00	0.07
411	301318	维海德	2,800	77,392.00	0.07
412	000042	中洲控股	9,900	75,438.00	0.07
413	600251	冠农股份	8,100	74,763.00	0.07
414	001269	欧晶科技	3,100	74,648.00	0.07
415	301032	新柴股份	6,100	73,383.00	0.07

416	688133	泰坦科技	3,312	73,327.68	0.07
417	688591	泰凌微	1,694	72,096.64	0.07
418	002616	长青集团	12,600	68,796.00	0.06
419	003015	日久光电	4,300	67,080.00	0.06
420	603968	醋化股份	6,000	67,020.00	0.06
421	688129	东来技术	3,300	66,759.00	0.06
422	301687	新广益	932	66,134.66	0.06
423	603229	奥翔药业	6,600	65,472.00	0.06
424	688551	科威尔	1,768	65,115.44	0.06
425	300583	赛托生物	4,700	64,343.00	0.06
426	600780	通宝能源	11,100	63,048.00	0.06
427	688702	盛科通信	444	62,910.36	0.06
428	000751	锌业股份	15,300	62,577.00	0.06
429	301502	华阳智能	1,400	62,552.00	0.06
430	600138	中青旅	6,300	62,244.00	0.06
431	603969	银龙股份	6,000	60,660.00	0.06
432	300025	华星创业	10,400	59,904.00	0.06
433	603085	天成自控	4,900	58,065.00	0.05
434	603071	物产环能	4,300	56,846.00	0.05
435	002442	龙星科技	9,000	55,890.00	0.05
436	000544	中原环保	6,700	55,744.00	0.05
437	603309	维力医疗	4,100	55,719.00	0.05
438	002688	金河生物	9,300	55,335.00	0.05
439	300985	致远新能	3,000	55,050.00	0.05
440	300234	开尔新材	10,000	55,000.00	0.05
441	002852	道道全	5,200	54,860.00	0.05
442	300032	金龙机电	10,100	54,237.00	0.05
443	002746	仙坛股份	8,900	54,023.00	0.05
444	300425	中建环能	10,900	53,955.00	0.05
445	600791	京能置业	11,400	53,352.00	0.05
446	300466	赛摩智能	5,200	52,260.00	0.05
447	002871	伟隆股份	2,900	52,200.00	0.05
448	002081	金螳螂	15,200	51,984.00	0.05
449	603206	嘉环科技	3,000	51,870.00	0.05
450	603590	康辰药业	1,300	51,675.00	0.05
451	301103	何氏眼科	2,600	51,012.00	0.05
452	002376	新北洋	6,500	50,180.00	0.05
453	601339	百隆东方	8,400	48,636.00	0.04
454	002909	集泰股份	7,100	48,351.00	0.04
455	001210	金房能源	2,800	47,964.00	0.04
456	300183	东软载波	3,200	47,456.00	0.04
457	300725	药石科技	1,200	46,272.00	0.04
458	300625	三雄极光	3,900	46,215.00	0.04

459	600615	鑫源智造	4,100	45,838.00	0.04
460	000501	武商集团	4,500	45,540.00	0.04
461	002454	松芝股份	5,100	44,421.00	0.04
462	301178	天亿马	900	44,172.00	0.04
463	688297	中无人机	900	43,218.00	0.04
464	688677	海泰新光	992	42,814.72	0.04
465	601882	海天精工	2,200	42,812.00	0.04
466	688370	丛麟科技	1,744	42,501.28	0.04
467	301359	东南电子	2,200	42,064.00	0.04
468	688638	誉辰智能	1,154	41,924.82	0.04
469	603103	横店影视	2,500	41,450.00	0.04
470	688505	复旦张江	4,942	41,018.60	0.04
471	688085	三友医疗	2,239	40,346.78	0.04
472	605259	绿田机械	1,800	40,284.00	0.04
473	688679	通源环境	1,496	39,793.60	0.04
474	002483	润邦股份	5,500	39,270.00	0.04
475	688162	巨一科技	1,269	39,085.20	0.04
476	600861	北京人力	2,100	38,514.00	0.04
477	600597	光明乳业	4,700	38,023.00	0.04
478	605599	菜百股份	2,300	37,651.00	0.03
479	603970	中农立华	2,900	37,294.00	0.03
480	300977	深圳瑞捷	2,100	36,099.00	0.03
481	688553	汇宇制药	1,950	34,690.50	0.03
482	300079	数码视讯	6,400	34,496.00	0.03
483	300092	科新机电	2,100	33,159.00	0.03
484	603637	镇海股份	3,000	32,610.00	0.03
485	688616	西力科技	2,616	31,993.68	0.03
486	001369	双欣材料	1,913	31,420.43	0.03
487	000965	天保基建	8,000	31,360.00	0.03
488	001256	炜冈科技	1,400	31,276.00	0.03
489	301008	宏昌科技	900	31,050.00	0.03
490	688098	申联生物	3,476	30,866.88	0.03
491	301098	金埔园林	3,500	30,030.00	0.03
492	000789	万年青	5,400	28,242.00	0.03
493	002999	天禾股份	4,100	28,003.00	0.03
494	688680	海优新材	726	27,769.50	0.03
495	600419	天润乳业	2,800	27,720.00	0.03
496	002448	中原内配	2,100	27,153.00	0.03
497	001280	中国铀业	471	27,148.44	0.03
498	301429	森泰股份	1,400	26,600.00	0.02
499	603060	国检集团	4,300	26,144.00	0.02
500	002587	奥拓电子	3,800	25,688.00	0.02
501	300798	锦鸡股份	3,600	25,596.00	0.02

502	300636	同和药业	3,400	25,534.00	0.02
503	300103	达刚控股	3,100	24,893.00	0.02
504	600662	外服控股	4,800	24,096.00	0.02
505	300643	万通智控	1,200	23,328.00	0.02
506	688659	元琛科技	2,457	23,218.65	0.02
507	001396	誉帆科技	539	23,128.79	0.02
508	605567	春雪食品	2,100	23,100.00	0.02
509	688181	八亿时空	678	21,912.96	0.02
510	301296	新巨丰	2,500	21,300.00	0.02
511	600876	凯盛新能	2,100	20,706.00	0.02
512	301656	联合动力	777	19,797.96	0.02
513	603729	龙韵股份	1,200	19,308.00	0.02
514	002599	盛通股份	2,200	18,788.00	0.02
515	300359	全通教育	3,500	18,760.00	0.02
516	003026	中晶科技	600	18,528.00	0.02
517	001322	箭牌家居	2,000	17,740.00	0.02
518	603818	曲美家居	4,800	17,328.00	0.02
519	301037	保立佳	1,200	17,280.00	0.02
520	300246	宝莱特	2,100	17,010.00	0.02
521	301589	诺瓦星云	100	16,455.00	0.02
522	002835	同为股份	1,000	16,380.00	0.02
523	002057	中钢天源	1,600	16,304.00	0.02
524	002037	保利联合	1,700	16,150.00	0.01
525	300845	捷安高科	1,400	15,778.00	0.01
526	300864	南大环境	800	15,776.00	0.01
527	301081	严牌股份	1,500	15,195.00	0.01
528	002712	思美传媒	2,600	14,456.00	0.01
529	301222	浙江恒威	500	14,260.00	0.01
530	601330	绿色动力	2,100	14,133.00	0.01
531	301563	云汉芯城	98	13,448.54	0.01
532	301519	舜禹股份	1,000	13,420.00	0.01
533	300355	蒙草生态	3,200	12,928.00	0.01
534	002863	今飞凯达	2,200	12,914.00	0.01
535	000498	山东路桥	2,100	12,663.00	0.01
536	603916	苏博特	1,300	12,298.00	0.01
537	603321	梅轮电梯	1,500	12,060.00	0.01
538	603722	阿科力	300	11,841.00	0.01
539	300936	中英科技	300	11,700.00	0.01
540	603118	共进股份	1,000	11,500.00	0.01
541	002296	辉煌科技	1,000	11,200.00	0.01
542	002393	力生制药	500	10,855.00	0.01
543	301584	建发致新	367	9,835.60	0.01
544	300813	泰林生物	400	9,828.00	0.01

545	603679	华体科技	600	9,696.00	0.01
546	002401	中远海科	600	9,558.00	0.01
547	300928	华安鑫创	300	9,345.00	0.01
548	001331	胜通能源	200	9,262.00	0.01
549	600335	国机汽车	1,400	9,114.00	0.01
550	301638	南网数字	492	8,447.64	0.01
551	300830	金现代	800	8,144.00	0.01
552	300074	华平股份	1,600	7,376.00	0.01
553	301503	智迪科技	200	7,212.00	0.01
554	688726	拉普拉斯	200	7,200.00	0.01
555	601368	绿城水务	1,400	6,944.00	0.01
556	300303	聚飞光电	1,000	6,840.00	0.01
557	301667	纳百川	93	6,810.39	0.01
558	000026	飞亚达	400	6,552.00	0.01
559	300422	博世科	1,400	6,426.00	0.01
560	002969	嘉美包装	500	6,330.00	0.01
561	603577	汇金通	600	6,312.00	0.01
562	300381	溢多利	900	5,868.00	0.01
563	603790	雅运股份	300	5,847.00	0.01
564	300149	睿智医药	600	5,736.00	0.01
565	688786	悦安新材	200	5,642.00	0.01
566	000948	南天信息	300	5,385.00	0.00
567	605066	天正电气	700	5,110.00	0.00
568	301449	天溯计量	68	5,100.68	0.00
569	301176	逸豪新材	200	5,034.00	0.00
570	688067	爱威科技	200	4,912.00	0.00
571	301186	超达装备	100	4,856.00	0.00
572	301568	思泰克	100	4,853.00	0.00
573	002662	峰璟股份	1,200	4,824.00	0.00
574	603385	惠达卫浴	700	4,788.00	0.00
575	603076	乐惠国际	200	4,688.00	0.00
576	605018	长华集团	400	4,632.00	0.00
577	601002	晋亿实业	900	4,626.00	0.00
578	688589	力合微	200	4,550.00	0.00
579	300824	北鼎股份	400	4,524.00	0.00
580	001233	海安集团	78	4,458.48	0.00
581	601061	中信金属	300	4,320.00	0.00
582	002908	德生科技	400	4,212.00	0.00
583	301101	明月镜片	100	4,143.00	0.00
584	688428	诺诚健华	200	4,104.00	0.00
585	002873	新天药业	400	3,968.00	0.00
586	605169	洪通燃气	300	3,954.00	0.00
587	300515	三德科技	200	3,932.00	0.00

588	601007	金陵饭店	500	3,905.00	0.00
589	002824	和胜股份	200	3,880.00	0.00
590	688132	邦彦技术	200	3,684.00	0.00
591	301418	协昌科技	100	3,650.00	0.00
592	600081	东风科技	300	3,549.00	0.00
593	000930	中粮科技	600	3,462.00	0.00
594	603599	广信股份	300	3,444.00	0.00
595	300951	博硕科技	100	3,435.00	0.00
596	002585	双星新材	500	3,365.00	0.00
597	301108	洁雅股份	100	3,326.00	0.00
598	301330	熵基科技	100	3,305.00	0.00
599	300488	恒锋工具	100	3,264.00	0.00
600	001373	翔腾新材	100	3,228.00	0.00
601	002367	康力电梯	400	3,224.00	0.00
602	002406	远东传动	400	3,176.00	0.00
603	002615	哈尔斯	400	3,068.00	0.00
604	002127	南极电商	900	3,033.00	0.00
605	603016	新宏泰	100	3,012.00	0.00
606	001259	利仁科技	100	3,001.00	0.00
607	003028	振邦智能	100	2,959.00	0.00
608	300668	杰恩设计	100	2,918.00	0.00
609	300510	金冠股份	700	2,891.00	0.00
610	301130	西点药业	100	2,854.00	0.00
611	603138	海量数据	200	2,844.00	0.00
612	301135	瑞德智能	100	2,810.00	0.00
613	301163	宏德股份	100	2,679.00	0.00
614	002649	博彦科技	200	2,638.00	0.00
615	603070	万控智造	200	2,592.00	0.00
616	300721	怡达股份	200	2,546.00	0.00
617	000767	晋控电力	900	2,520.00	0.00
618	300960	通业科技	100	2,518.00	0.00
619	600422	昆药集团	200	2,512.00	0.00
620	002802	洪汇新材	200	2,488.00	0.00
621	300138	晨光生物	200	2,482.00	0.00
622	000573	粤宏远 A	600	2,478.00	0.00
623	600449	宁夏建材	200	2,472.00	0.00
624	301395	仁信新材	200	2,452.00	0.00
625	002302	西部建设	400	2,448.00	0.00
626	000520	凤凰航运	500	2,420.00	0.00
626	300451	创业慧康	500	2,420.00	0.00
627	603578	三星新材	200	2,416.00	0.00
628	605158	华达新材	300	2,412.00	0.00
629	000541	佛山照明	400	2,404.00	0.00

630	000919	金陵药业	300	2,385.00	0.00
631	002030	达安基因	400	2,384.00	0.00
632	002022	科华生物	400	2,376.00	0.00
633	002206	海利得	400	2,340.00	0.00
634	300575	中旗股份	400	2,332.00	0.00
635	000813	德展健康	600	2,304.00	0.00
636	600054	黄山旅游	200	2,264.00	0.00
637	600051	宁波联合	300	2,262.00	0.00
638	600668	尖峰集团	200	2,260.00	0.00
639	002216	三全食品	200	2,258.00	0.00
640	601518	吉林高速	800	2,256.00	0.00
641	300194	福安药业	500	2,215.00	0.00
642	300656	民德电子	100	2,202.00	0.00
643	001367	海森药业	100	2,195.00	0.00
644	002106	莱宝高科	200	2,192.00	0.00
645	603075	热威股份	100	2,184.00	0.00
646	603648	畅联股份	200	2,180.00	0.00
647	600982	宁波能源	500	2,170.00	0.00
648	002362	汉王科技	100	2,164.00	0.00
649	688468	科美诊断	294	2,157.96	0.00
650	002437	誉衡药业	700	2,149.00	0.00
651	300664	鹏鹞环保	400	2,144.00	0.00
652	000059	华锦股份	400	2,140.00	0.00
653	002809	红墙股份	200	2,138.00	0.00
654	300577	开润股份	100	2,137.00	0.00
655	000726	鲁泰 A	300	2,136.00	0.00
656	601678	滨化股份	500	2,120.00	0.00
657	603676	卫信康	200	2,104.00	0.00
658	600017	日照港	700	2,100.00	0.00
659	600784	鲁银投资	300	2,094.00	0.00
660	000607	华媒控股	500	2,075.00	0.00
661	002857	三晖电气	100	2,074.00	0.00
662	000589	贵州轮胎	400	2,072.00	0.00
663	002726	龙大美食	500	2,055.00	0.00
664	000404	长虹华意	300	2,031.00	0.00
665	603126	中材节能	300	2,016.00	0.00
666	605183	确成股份	100	1,992.00	0.00
667	000928	中钢国际	300	1,983.00	0.00
668	688459	哈铁科技	204	1,968.60	0.00
669	600308	华泰股份	500	1,950.00	0.00
670	002757	南兴股份	100	1,947.00	0.00
671	600716	凤凰股份	500	1,935.00	0.00
671	603855	华荣股份	100	1,935.00	0.00

672	605266	健之佳	100	1,922.00	0.00
673	300717	华信新材	100	1,904.00	0.00
674	300942	易瑞生物	200	1,882.00	0.00
675	603949	雪龙集团	100	1,877.00	0.00
676	301332	德尔玛	200	1,868.00	0.00
677	688571	杭华股份	250	1,862.50	0.00
678	001286	陕西能源	200	1,862.00	0.00
679	002035	华帝股份	300	1,860.00	0.00
680	600491	龙元建设	700	1,848.00	0.00
681	002661	克明食品	200	1,828.00	0.00
682	002551	尚荣医疗	500	1,825.00	0.00
683	603029	天鹅股份	100	1,824.00	0.00
684	000707	双环科技	300	1,815.00	0.00
685	600874	创业环保	300	1,782.00	0.00
686	002109	兴化股份	500	1,775.00	0.00
687	002884	凌霄泵业	100	1,769.00	0.00
688	002567	唐人神	400	1,760.00	0.00
689	002224	三力士	400	1,756.00	0.00
690	600300	维维股份	500	1,755.00	0.00
691	002606	大连电瓷	200	1,748.00	0.00
692	001285	瑞立科密	31	1,739.41	0.00
693	002646	天佑德酒	200	1,730.00	0.00
694	600997	开滦股份	300	1,725.00	0.00
695	000516	国际医学	400	1,716.00	0.00
696	603912	佳力图	200	1,714.00	0.00
697	603310	巍华新材	100	1,681.00	0.00
698	601199	江南水务	300	1,671.00	0.00
699	603237	五芳斋	100	1,668.00	0.00
700	002521	齐峰新材	200	1,664.00	0.00
701	601096	宏盛华源	400	1,660.00	0.00
702	301006	迈拓股份	100	1,649.00	0.00
703	000055	方大集团	400	1,640.00	0.00
704	000900	现代投资	400	1,636.00	0.00
705	603357	设计总院	200	1,630.00	0.00
706	600805	悦达投资	300	1,629.00	0.00
707	300384	三联虹普	100	1,625.00	0.00
708	600883	博闻科技	200	1,612.00	0.00
709	002034	旺能环境	100	1,590.00	0.00
710	000990	诚志股份	200	1,584.00	0.00
711	301179	泽宇智能	100	1,581.00	0.00
712	300994	久祺股份	100	1,579.00	0.00
713	300284	苏交科	200	1,576.00	0.00
714	000822	山东海化	300	1,575.00	0.00

715	000507	珠海港	300	1,563.00	0.00
716	600794	保税科技	400	1,560.00	0.00
717	600269	赣粤高速	300	1,557.00	0.00
718	600035	楚天高速	400	1,552.00	0.00
719	002159	三特索道	100	1,533.00	0.00
720	002817	黄山胶囊	200	1,520.00	0.00
721	301303	真兰仪表	100	1,514.00	0.00
722	300441	鲍斯股份	200	1,510.00	0.00
723	002832	比音勒芬	100	1,496.00	0.00
724	603107	上海汽配	100	1,483.00	0.00
725	300279	和晶科技	200	1,444.00	0.00
726	002004	华邦健康	300	1,434.00	0.00
727	601101	昊华能源	200	1,432.00	0.00
728	603170	宝立食品	100	1,428.00	0.00
729	301090	华润材料	200	1,408.00	0.00
730	002845	同兴达	100	1,407.00	0.00
731	600963	岳阳林纸	300	1,401.00	0.00
732	600609	金杯汽车	300	1,389.00	0.00
733	603111	康尼机电	200	1,370.00	0.00
734	600851	海欣股份	200	1,366.00	0.00
735	300107	建新股份	200	1,364.00	0.00
736	600925	苏能股份	300	1,362.00	0.00
737	000605	渤海股份	200	1,342.00	0.00
737	002327	富安娜	200	1,342.00	0.00
738	002749	国光股份	100	1,333.00	0.00
739	300275	梅安森	100	1,331.00	0.00
740	603006	黎明股份	100	1,312.00	0.00
741	000554	泰山石油	200	1,296.00	0.00
742	300051	珧升科技	200	1,290.00	0.00
743	300371	汇中股份	100	1,257.00	0.00
744	600971	恒源煤电	200	1,248.00	0.00
745	000045	深纺织 A	100	1,222.00	0.00
746	002063	远光软件	200	1,214.00	0.00
747	300040	九洲集团	200	1,204.00	0.00
748	600123	兰花科创	200	1,182.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002783	凯龙股份	3,167,081.00	5.35
2	300814	中富电路	2,954,674.00	4.99
3	300231	银信科技	2,878,350.00	4.86

4	300739	明阳电路	2,827,736.00	4.77
5	300434	金石亚药	2,630,942.00	4.44
6	301128	强瑞技术	2,292,391.00	3.87
7	300062	中能电气	2,071,228.00	3.50
8	002115	三维通信	2,010,865.00	3.40
9	002164	宁波东力	1,996,289.00	3.37
10	002965	祥鑫科技	1,732,724.10	2.93
11	301662	宏工科技	1,683,564.00	2.84
12	688228	开普云	1,651,269.71	2.79
13	300680	隆盛科技	1,634,943.50	2.76
14	605188	国光连锁	1,631,246.00	2.75
15	002887	绿茵生态	1,600,096.00	2.70
16	002565	顺灏股份	1,574,102.00	2.66
17	688388	嘉元科技	1,540,440.14	2.60
18	301120	新特电气	1,524,851.00	2.57
19	002852	道道全	1,521,013.00	2.57
20	300884	狄耐克	1,487,992.00	2.51
21	301255	通力科技	1,474,671.60	2.49
22	301150	中一科技	1,472,757.00	2.49
23	003015	日久光电	1,469,554.00	2.48
24	002792	通宇通讯	1,424,976.30	2.41
25	603319	美湖股份	1,421,000.00	2.40
26	603686	福龙马	1,415,968.00	2.39
27	300465	高伟达	1,403,281.00	2.37
28	688049	炬芯科技	1,390,387.06	2.35
29	301183	东田微	1,380,545.15	2.33
30	300421	力星股份	1,367,806.00	2.31
31	300510	金冠股份	1,360,045.00	2.30
32	688028	沃尔德	1,346,750.65	2.27
33	300440	运达科技	1,341,406.00	2.27
34	600980	北矿科技	1,306,028.00	2.21
35	688668	鼎通科技	1,295,091.07	2.19
36	300299	富春股份	1,287,703.00	2.17
37	300707	威唐工业	1,286,655.00	2.17
38	688007	光峰科技	1,267,302.49	2.14
39	002686	亿利达	1,263,031.00	2.13
40	300872	天阳科技	1,257,702.00	2.12
41	688239	航宇科技	1,252,118.53	2.11
42	300539	横河精密	1,244,361.00	2.10
43	301396	宏景科技	1,237,050.00	2.09
44	002492	恒基达鑫	1,235,367.00	2.09
45	301208	中亦科技	1,229,718.00	2.08
46	002104	恒宝股份	1,225,671.00	2.07

47	300968	格林精密	1,220,428.00	2.06
48	688325	赛微微电	1,199,712.64	2.03
49	002264	新华都	1,193,972.00	2.02
50	002017	东信和平	1,187,449.80	2.01
51	300581	晨曦航空	1,186,025.00	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300814	中富电路	3,245,236.00	5.48
2	002783	凯龙股份	3,193,390.00	5.39
3	300739	明阳电路	3,014,466.00	5.09
4	300231	银信科技	2,589,624.00	4.37
5	300434	金石亚药	2,561,692.00	4.33
6	301128	强瑞技术	2,522,339.60	4.26
7	605255	天普股份	2,243,885.00	3.79
8	300062	中能电气	2,074,984.15	3.50
9	688228	开普云	1,922,539.25	3.25
10	002164	宁波东力	1,878,156.00	3.17
11	603686	福龙马	1,723,209.00	2.91
12	002115	三维通信	1,697,784.00	2.87
13	301150	中一科技	1,691,633.00	2.86
14	002887	绿茵生态	1,675,736.00	2.83
15	605188	国光连锁	1,671,448.00	2.82
16	688388	嘉元科技	1,646,552.42	2.78
17	300440	运达科技	1,639,623.00	2.77
18	300884	狄耐克	1,579,585.00	2.67
19	002852	道道全	1,547,850.00	2.61
20	301255	通力科技	1,541,470.00	2.60
21	300465	高伟达	1,508,000.00	2.55
22	003015	日久光电	1,500,764.00	2.53
23	002965	祥鑫科技	1,497,624.50	2.53
24	688668	鼎通科技	1,459,907.06	2.47
25	300510	金冠股份	1,451,216.00	2.45
26	688239	航宇科技	1,437,943.27	2.43
27	300421	力星股份	1,435,596.00	2.42
28	301662	宏工科技	1,430,705.00	2.42
29	300299	富春股份	1,423,169.00	2.40
30	300680	隆盛科技	1,415,236.00	2.39
31	002686	亿利达	1,398,338.00	2.36

32	301120	新特电气	1,398,203.00	2.36
33	301396	宏景科技	1,391,669.00	2.35
34	300872	天阳科技	1,374,989.00	2.32
35	688372	伟测科技	1,365,271.79	2.31
36	002792	通宇通讯	1,348,785.00	2.28
37	002492	恒基达鑫	1,347,230.00	2.27
38	300707	威唐工业	1,344,444.60	2.27
39	300968	格林精密	1,337,431.00	2.26
40	688325	赛微微电	1,336,712.96	2.26
41	002565	顺灏股份	1,310,806.00	2.21
42	002017	东信和平	1,304,203.00	2.20
43	600980	北矿科技	1,302,614.00	2.20
44	002255	海陆重工	1,301,647.00	2.20
45	002264	新华都	1,284,734.00	2.17
46	688049	炬芯科技	1,268,427.97	2.14
47	000593	德龙汇能	1,260,464.00	2.13
48	300684	中石科技	1,251,844.00	2.11
49	301018	申菱环境	1,248,798.00	2.11
50	300581	晨曦航空	1,248,715.00	2.11
51	301123	奕东电子	1,237,258.00	2.09
52	301208	中亦科技	1,223,373.00	2.07
53	300272	开能健康	1,213,133.00	2.05
54	002104	恒宝股份	1,205,215.00	2.04
55	301137	哈焊华通	1,189,339.00	2.01

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。

8.4.3 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	693,920,668.46
卖出股票收入（成交）总额	676,994,282.20

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。

8.5 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	6,257,718.35	5.77
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	6,257,718.35	5.77

8.6 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	019773	25 国债 08	50,000	5,050,482.19	4.66
2	019785	25 国债 13	12,000	1,207,236.16	1.11

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本投资期内部分时段中用少量仓位投资于股指期货作为辅助投资手段，旨在利用股指期货提升组合的投资效率和流动性，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本。投资股指期货时以套期保值为目的，在风险可控和遵守合同约定的前提下，谨慎持有少量流动性好、交易活跃的股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	33,573.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	94,608.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,181.75

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
东方量化成长灵活配置混合 A	31,841	1,821.37	14,419,225.45	24.86	43,574,901.33	75.14
东方量化成长灵活配置混合 C	1,341	3,774.77	0.00	-	5,061,967.59	100.00
合计	33,182	1,900.31	14,419,225.45	22.87	48,636,868.92	77.13

9.2 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	东方量化成长灵活配置混合 A	482,709.38	0.83
	东方量化成长灵活配置混合 C	84,877.27	1.68
	合计	567,586.65	0.90

9.3 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	东方量化成长灵活配置混合 A	0
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方量化成长灵活配置混合 A	10~50
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2018年3月21日) 基金份额总额	694,463,618.20	-
本报告期期初基金份额总额	43,353,886.63	4,869,493.76
本报告期基金总申购份额	64,790,327.13	26,503,215.55
减：本报告期基金总赎回份额	50,150,086.98	26,310,741.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,994,126.78	5,061,967.59

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 28,000.00 元；截至 2025 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
招商证券股份有限公司	1	466,254,295.43	34.02	207,905.13	34.23	-
东北证券股份有限公司	2	350,244,478.68	25.55	156,173.91	25.71	-
国投证券股份有限公司	1	196,545,386.06	14.34	87,639.77	14.43	-
华西证券股份有限公司	2	157,368,680.60	11.48	70,171.92	11.55	-
国金证券股份有限公司	1	93,726,389.33	6.84	41,792.72	6.88	-
长城证券股份有限公司	1	36,741,348.52	2.68	16,383.31	2.70	-
国泰海通证券股份有限公司	1	36,622,887.70	2.67	16,330.84	2.69	-
华鑫证券有限责任公司	2	18,708,366.95	1.36	4,601.05	0.76	-
国信证券股份有限公司	1	14,445,912.15	1.05	6,441.78	1.06	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

国联民生 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 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资历雄厚，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) 本基金本报告期撤销租用一个交易单元，为东兴证券股份有限公司上海证券交易所交易单元。

(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。

11.7.2 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 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3,397,292.00	25.17	38,300,000.00	61.58	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	9,699,629.00	71.86	18,400,000.00	29.58	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	400,500.00	2.97	2,500,000.00	4.02	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	3,000,000.00	4.82	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	东方量化成长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	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	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 12 日
3	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号）	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 13 日
4	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	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 13 日
5	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
6	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
7	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
8	东方量化成长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

9	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
10	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
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
13	东方量化成长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
14	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	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 30 日
15	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 2 号）	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 30 日
16	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
17	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
18	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

19	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 2 日
20	关于增加国联民生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 7 月 3 日
21	关于增加招商银行股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类销售机构的公告	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 7 月 9 日
22	关于增加开源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 7 月 11 日
23	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 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 7 月 21 日
24	关于增加申万宏源证券有限公司等三家机构为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 7 月 28 日
25	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 8 月 19 日
26	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 20 日
27	关于增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台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 8 月 22 日
28	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 29 日

29	关于旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司转换转入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 9 月 2 日
30	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 9 月 2 日
31	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 9 月 4 日
32	关于增加平安银行股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额销售机构的公告	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 9 月 19 日
33	关于增加国泰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 9 月 26 日
34	关于增加北京济安基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 16 日
35	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 3 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 10 月 28 日
36	关于增加西部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 11 月 3 日
37	关于增加申万宏源证券有限公司等三家机构为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 11 月 14 日
38	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及	2025 年 11 月 20 日

		中国证监会基金电子披露网站	
39	关于增加上海国信嘉利基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 20 日
40	关于东方基金管理股份有限公司旗下部分基金参与招商银行股份有限公司转换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 12 月 10 日
41	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 12 月 12 日
42	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 12 月 24 日
43	东方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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 12 月 24 日
44	关于增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 12 月 25 日
45	关于增加国泰海通证券股份有限公司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 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
机构	1	20250101 - 20250729	14,419,22 5.45	0.00	0.00	14,419,225.45	22.87
	2	20251016 - 20251231	14,419,22 5.45	0.00	0.00	14,419,225.45	22.87
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 一、《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方量化成长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、基金份额净值及其他临时公告

13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

13.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2026 年 3 月 31 日