

东方量化多策略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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	16
§ 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	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12 投资组合报告附注	71
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方量化多策略混合型证券投资基金	
基金简称	东方量化多策略混合	
基金主代码	006785	
前端交易代码	006785	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 2 月 22 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	31,567,620.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
下属分级基金的交易代码	006785	014724
报告期末下属分级基金的份额总额	29,259,695.48 份	2,307,925.49 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
本期已实现收益	7,832,505.45	594,525.43	-1,160,848.47	-11,961.27	-9,781,388.87	-9,997,494.17
本期利润	7,485,099.11	1,076,286.42	-999,560.92	-26,590.34	575,395.21	-4,849,529.95
加权平均基金份额本期利润	0.2527	0.2472	-0.0332	-0.4665	0.0168	-0.0612
本期加权平均净值利润率	29.65%	30.24%	-4.94%	-69.04%	2.08%	-7.58%
本期	34.21%	34.22%	-4.22%	-4.21%	-4.93%	-5.34%

基金份额净值增长率						
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	-388,179.97	-468,751.09	-7,862,025.74	-18,696.62	-6,991,992.06	-47,920.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0133	-0.2031	-0.2648	-0.4673	-0.2324	-0.4299
期末基金资产净值	28,871,515.51	2,266,751.39	21,829,143.17	29,281.93	23,094,575.29	85,166.48
期末基金份额净值	0.9867	0.9822	0.7352	0.7318	0.7676	0.7640
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	-1.33%	-0.28%	-26.48%	-25.71%	-23.24%	-22.44%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化多策略混合 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	1.30%	1.08%	0.28%	1.07%	1.02%	0.01%
过去六个月	20.29%	1.05%	18.49%	1.06%	1.80%	-0.01%
过去一年	34.21%	1.22%	26.12%	1.32%	8.09%	-0.10%
过去三年	22.21%	1.37%	24.00%	1.45%	-1.79%	-0.08%
过去五年	-18.47%	1.40%	10.64%	1.29%	-29.11%	0.11%
自基金合同生效起至今	-1.33%	1.34%	41.64%	1.25%	-42.97%	0.09%

东方量化多策略混合 C

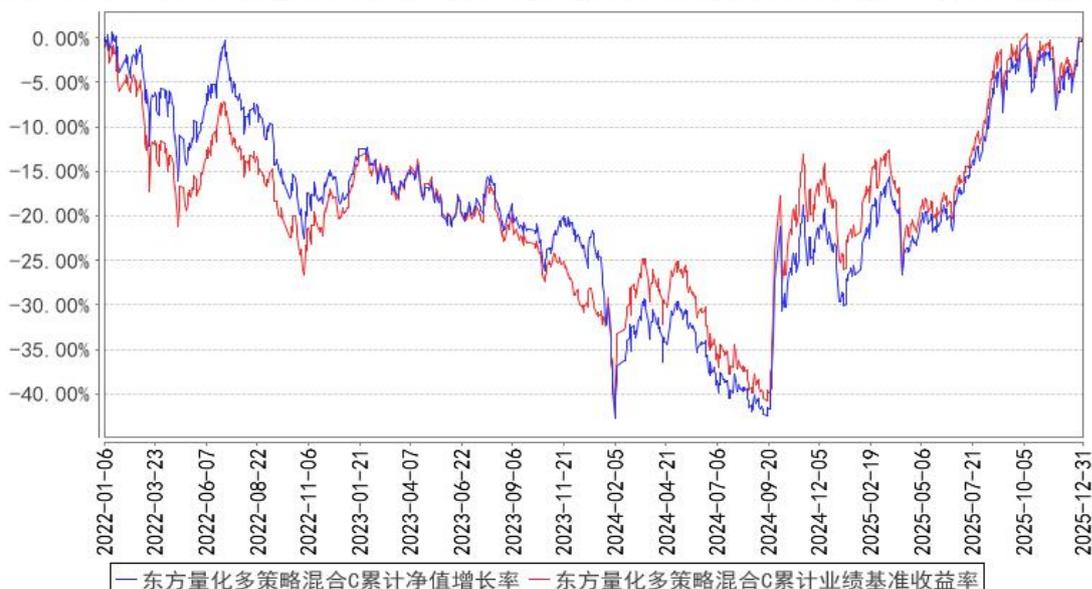
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.31%	1.08%	0.28%	1.07%	1.03%	0.01%
过去六个月	20.29%	1.05%	18.49%	1.06%	1.80%	-0.01%
过去一年	34.22%	1.22%	26.12%	1.32%	8.10%	-0.10%
过去三年	21.69%	1.38%	24.00%	1.45%	-2.31%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-0.28%	1.34%	-0.13%	1.39%	-0.15%	-0.05%

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

东方量化多策略混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

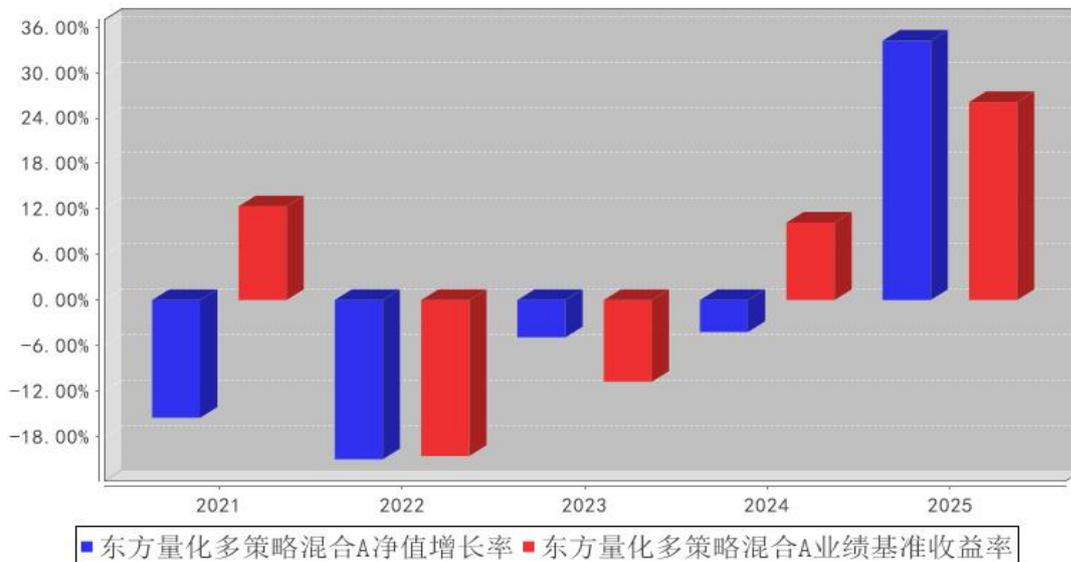


东方量化多策略混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

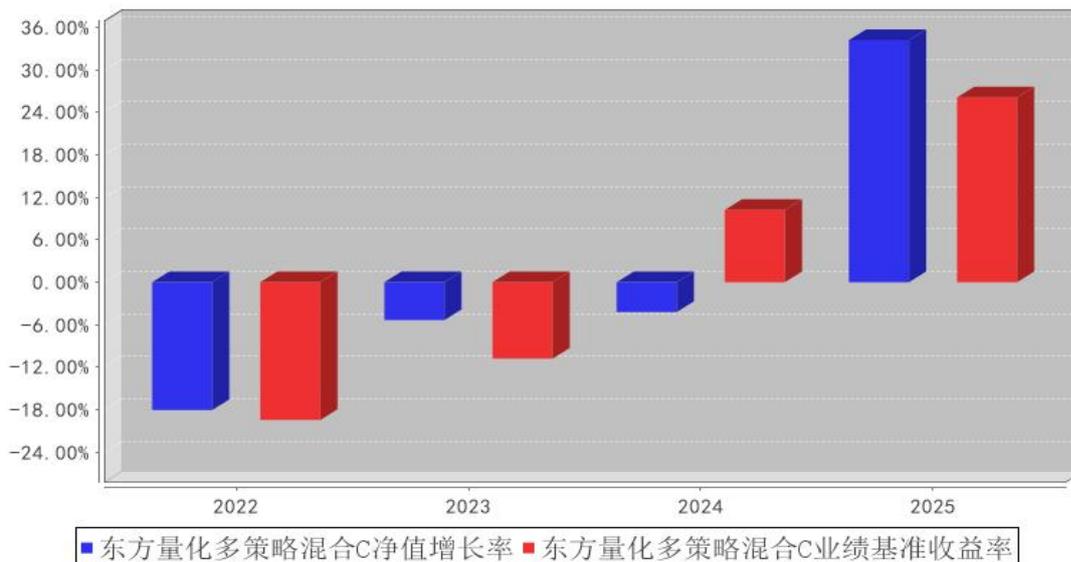


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化多策略混合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



东方量化多策略混合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

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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、量化投资部总经理	2019 年 2 月 22 日	2025 年 12 月 31 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。
--	--	--	--	--	--

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、《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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1000的良好表现。从超额收益来看，产品本期总体超额收益为正，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34.21%，业绩比较基准收益率为26.12%，高于业绩比较基准8.09%；本基金C类净值增长率为34.22%，业绩比较基准收益率为26.12%，高于业绩比较基准8.10%。

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，内在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，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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 2602435 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	东方量化多策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的东方量化多策略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。</p> <p>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</p>

	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风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、</p>

	<p>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：东方量化多策略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	652,008.03	1,396,901.00
结算备付金		90,151.85	73,681.68
存出保证金		15,701.91	13,145.57
交易性金融资产	7.4.7.2	30,915,701.49	21,073,485.49
其中：股票投资		29,198,275.35	19,763,733.74
基金投资		-	-
债券投资		1,717,426.14	1,309,751.75
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	50,332.32
应收股利		-	-
应收申购款		1,602.25	0.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		31,675,165.53	22,607,547.05
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		400,176.40	600,213.50
应付清算款		150.80	55,507.90
应付赎回款		65,486.84	108.97
应付管理人报酬		20,553.74	15,570.06
应付托管费		3,853.82	2,919.38
应付销售服务费		18.81	0.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	46,658.22	74,801.83
负债合计		536,898.63	749,121.95
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	31,567,620.97	29,731,182.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	-429,354.07	-7,872,757.65
净资产合计		31,138,266.90	21,858,425.10
负债和净资产总计		31,675,165.53	22,607,547.05

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，东方量化多策略混合 A 基金份额净值 0.9867 元，基金份额总额 29,259,695.48 份；东方量化多策略混合 C 基金份额净值 0.9822 元，基金份额总额

2,307,925.49 份。东方量化多策略混合份额总额合计 31,567,620.97 份。

7.2 利润表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 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		8,850,302.58	-783,294.74
1. 利息收入		9,477.65	10,615.94
其中：存款利息收入	7.4.7.10	9,237.61	10,615.94
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		240.04	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		8,572,508.32	-945,136.92
其中：股票投资收益	7.4.7.11	8,247,999.02	-1,244,059.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	19,707.94	21,830.19
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	-	-
股利收益	7.4.7.16	304,801.36	277,092.84
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	134,354.65	146,658.48
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	133,961.96	4,567.76
减：二、营业总支出		288,917.05	242,856.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	229,674.02	161,958.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	43,063.83	30,367.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	352.95	4.65

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,020.64	2,866.28
其中：卖出回购金融资产支出		6,020.64	2,866.28
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	9,805.61	47,659.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,561,385.53	-1,026,151.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,561,385.53	-1,026,151.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,561,385.53	-1,026,151.26

7.3 净资产变动表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 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	29,731,182.75	-	-7,872,757.65	21,858,425.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	29,731,182.75	-	-7,872,757.65	21,858,425.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,836,438.22	-	7,443,403.58	9,279,841.80
（一）、综合收益总额	-	-	8,561,385.53	8,561,385.53
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,836,438.22	-	-1,117,981.95	718,456.27
其中：1. 基金申	51,991,573.95	-	-11,786,168.49	40,205,405.46

购款				
2. 基金赎回款	-50,155,135.73	-	10,668,186.54	-39,486,949.19
(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	31,567,620.97	-	-429,354.07	31,138,266.90
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	30,198,046.83	-	-7,018,305.06	23,179,741.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,198,046.83	-	-7,018,305.06	23,179,741.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-466,864.08	-	-854,452.59	-1,321,316.67
(一)、综合收益总额	-	-	-1,026,151.26	-1,026,151.26
(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)	-466,864.08	-	171,698.67	-295,165.41
其中：1. 基金申购款	1,350,565.05	-	-425,800.47	924,764.58
2. 基金赎回款	-1,817,429.13	-	597,499.14	-1,219,929.99
(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	-	-	-	-

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	29,731,182.75	-	-7,872,757.65	21,858,425.10

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

东方量化多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 7 月 10 日中国证监会《关于准予东方量化多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1093 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 1 月 7 日至 2019 年 2 月 15 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 329,903,665.65 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2019]第 01210017 号”验资报告验证。

经向中国证监会备案，《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 2 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,005,184.34 份基金单位，其中认购资金利息折合 101,518.69 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、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、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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的要求，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	652,008.03	1,396,901.00
等于：本金	651,892.43	1,396,629.48
加：应计利息	115.60	271.52
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	652,008.03	1,396,901.00

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	29,355,677.44	-	29,198,275.35	-157,402.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,697,612.35	17,366.14	1,717,426.14	2,447.65
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,697,612.35	17,366.14	1,717,426.14	2,447.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	31,053,289.79	17,366.14	30,915,701.49	-154,954.44	
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	20,054,961.23	-	19,763,733.74	-291,227.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,300,431.60	7,401.75	1,309,751.75	1,918.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,300,431.60	7,401.75	1,309,751.75	1,918.40

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,355,392.83	7,401.75	21,073,485.49	-289,309.09

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	74.39	0.13
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	41,488.36	41,332.95
其中：交易所市场	41,488.36	41,332.95
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	5,095.47	33,468.75
合计	46,658.22	74,801.83

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化多策略混合 A

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	29,691,168.91	29,691,168.91

本期申购	3,101,770.30	3,101,770.30
本期赎回（以“-”号填列）	-3,533,243.73	-3,533,243.73
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,259,695.48	29,259,695.48

东方量化多策略混合 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	40,013.84	40,013.84
本期申购	48,889,803.65	48,889,803.65
本期赎回（以“-”号填列）	-46,621,892.00	-46,621,892.00
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	2,307,925.49	2,307,925.49

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

东方量化多策略混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,233,789.99	-3,628,235.75	-7,862,025.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,233,789.99	-3,628,235.75	-7,862,025.74
本期利润	7,832,505.45	-347,406.34	7,485,099.11
本期基金份额交易产生的变动数	-5,788.74	-5,464.60	-11,253.34
其中：基金申购款	-43,654.47	-475,903.58	-519,558.05
基金赎回款	37,865.73	470,438.98	508,304.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,592,926.72	-3,981,106.69	-388,179.97

东方量化多策略混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,696.62	7,964.71	-10,731.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-18,696.62	7,964.71	-10,731.91
本期利润	594,525.43	481,760.99	1,076,286.42
本期基金份额交易产生的变动数	-1,044,579.90	-62,148.71	-1,106,728.61
其中：基金申购款	-18,477,475.33	7,210,864.89	-11,266,610.44
基金赎回款	17,432,895.43	-7,273,013.60	10,159,881.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-468,751.09	427,576.99	-41,174.10

7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	8,764.02	8,026.03
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	429.64	2,244.48
其他	43.95	345.43
合计	9,237.61	10,615.94

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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,247,999.02	-1,244,059.95
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	8,247,999.02	-1,244,059.95

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	185,881,731.49	189,737,621.58

额		
减：卖出股票成本总额	177,350,783.58	190,600,596.09
减：交易费用	282,948.89	381,085.44
买卖股票差价收入	8,247,999.02	-1,244,059.95

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	19,883.19	23,486.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-175.25	-1,656.40
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	19,707.94	21,830.19

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	1,916,751.86	2,952,108.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,899,580.25	2,902,921.40
减：应计利息总额	17,346.86	50,843.05
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-175.25	-1,656.40

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。

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	304,801.36	277,092.84
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	304,801.36	277,092.84

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	134,354.65	146,658.48
股票投资	133,825.40	145,299.08
债券投资	529.25	1,359.40
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	134,354.65	146,658.48

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	上年度可比期间 2024年1月1日至2024
----	--------------------------	---------------------------

	31 日	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	133,161.74	3,741.60
基金转换费收入	800.22	826.16
合计	133,961.96	4,567.76

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	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
审计费用	5,095.47	9,562.00
信息披露费	-	23,906.75
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,710.14	5,190.73
账户维护费	-	9,000.00
合计	9,805.61	47,659.48

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人主动承担部分固定费用，如审计费用、信息披露费等。

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
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
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

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

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

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。

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	229,674.02	161,958.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,691.76	12,103.36
应支付基金管理人的净管理费	201,982.26	149,855.52

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	43,063.83	30,367.23

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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		
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	3.85	3.85
合计	-	3.85	3.85
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		
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：计提标准：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 类基金份额基金资产净值的 0.01% 年费率计提。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：本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③自 2022 年 8 月 16 日起 C 类基金实行销售服务费率优惠调整，费率由 0.40% 调整至 0.01%，截止本报告期末优惠方案未结束。

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

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.53%	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日（2019年2月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	83.30%	-

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

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

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
中国农业银行股份有限公司	652,008.03	8,764.02	1,396,901.00	8,026.03

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 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。

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，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，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 400,176.40 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	652,008.03	-	-	-	652,008.03
结算备付金	90,151.85	-	-	-	90,151.85
存出保证金	15,701.91	-	-	-	15,701.91
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	29,198,275.35	29,198,275.35
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,717,426.14	-	-	-	1,717,426.14
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	-	-	-	1,602.25	1,602.25
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,475,287.93	-	-	29,199,877.60	31,675,165.53
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	400,176.40	-	-	-	400,176.40
应付清算款	-	-	-	150.80	150.80
应付赎回款	-	-	-	65,486.84	65,486.84
应付管理人报酬	-	-	-	20,553.74	20,553.74

应付托管费	-	-	-	3,853.82	3,853.82
应付销售服务费	-	-	-	18.81	18.81
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	-	-	-	46,658.22	46,658.22
负债总计	400,176.40	-	-	136,722.23	536,898.63
利率敏感度缺口	2,075,111.53	-	-	29,063,155.37	31,138,266.90
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	1,396,901.00	-	-	-	1,396,901.00
结算备付金	73,681.68	-	-	-	73,681.68
存出保证金	13,145.57	-	-	-	13,145.57
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	19,763,733.74	19,763,733.74
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,309,751.75	-	-	-	1,309,751.75
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	50,332.32	50,332.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	0.99	0.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,793,480.00	-	-	19,814,067.05	22,607,547.05
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	600,213.50	-	-	-	600,213.50
应付清算款	-	-	-	55,507.90	55,507.90
应付赎回款	-	-	-	108.97	108.97
应付管理人报酬	-	-	-	15,570.06	15,570.06
应付托管费	-	-	-	2,919.38	2,919.38
应付销售服务费	-	-	-	0.31	0.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	74,801.83
负债总计	600,213.50	-	-	148,908.45
利率敏感度缺口	2,193,266.50	-	-	19,665,158.60

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%	-572.29	-1,900.93
	市场利率下调0.25%	572.29	1,900.93

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	29,198,275.35	93.77	19,763,733.74	90.42

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,717,426.14	5.52	1,309,751.75	5.99
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	30,915,701.49	99.29	21,073,485.49	96.41

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%	1,607,792.89	1,205,109.60
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,607,792.89	-1,205,109.60

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	29,198,275.35	19,742,719.34
第二层次	1,717,426.14	1,330,766.15
第三层次	-	-
合计	30,915,701.49	21,073,485.49

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	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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	-	-	-

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	
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			
期初余额	-	302,191.37	302,191.37
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	245,070.70	245,070.70
当期利得或损失总额	-	-57,120.67	-57,120.67
其中：计入损益的利得或损失	-	-57,120.67	-57,120.67
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

本基金本报告期末及上年度末无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。

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	29,198,275.35	92.18
	其中：股票	29,198,275.35	92.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,717,426.14	5.42
	其中：债券	1,717,426.14	5.42
	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	742,159.88	2.34
8	其他各项资产	17,304.16	0.05
9	合计	31,675,165.53	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	178,152.00	0.57
B	采矿业	833,334.00	2.68
C	制造业	19,420,115.59	62.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	679,000.00	2.18
E	建筑业	166,941.00	0.54
F	批发和零售业	758,652.00	2.44
G	交通运输、仓储和邮政业	793,854.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,644,847.90	11.71
J	金融业	452,949.00	1.45
K	房地产业	632,903.00	2.03
L	租赁和商务服务业	350,944.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	648,007.86	2.08
N	水利、环境和公共设施管理业	66,934.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	121,722.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	449,919.00	1.44
S	综合	-	-
	合计	29,198,275.35	93.77

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	300352	北信源	58,300	357,379.00	1.15
2	688498	源杰科技	400	256,796.00	0.82
3	300672	国科微	2,300	247,526.00	0.79
4	001203	大中矿业	7,600	232,940.00	0.75
5	600783	鲁信创投	9,200	227,516.00	0.73
6	000629	钒钛股份	71,500	221,650.00	0.71
7	300759	康龙化成	6,600	187,638.00	0.60
8	300291	百纳千成	25,000	187,250.00	0.60
9	300548	长芯博创	1,300	184,600.00	0.59
10	603505	金石资源	9,800	183,064.00	0.59
11	600064	南京高科	20,700	179,676.00	0.58
12	688262	国芯科技	5,676	172,266.60	0.55
13	601107	四川成渝	26,800	162,944.00	0.52
14	002402	和而泰	4,000	156,480.00	0.50
15	600406	国电南瑞	6,900	155,112.00	0.50
16	688029	南微医学	1,828	149,091.68	0.48
17	003816	中国广核	39,300	147,768.00	0.47
18	301031	中熔电气	1,300	145,847.00	0.47
19	002701	奥瑞金	24,500	145,775.00	0.47
20	600850	电科数字	4,900	145,236.00	0.47
21	600690	海尔智家	5,500	143,495.00	0.46
22	002292	奥飞娱乐	16,200	143,370.00	0.46
23	002244	滨江集团	14,200	142,710.00	0.46
24	002368	太极股份	5,800	142,042.00	0.46
25	600572	康恩贝	31,400	140,044.00	0.45
26	600645	中源协和	5,500	138,600.00	0.45
27	002668	TCL 智家	13,300	138,054.00	0.44
28	603766	隆鑫通用	8,500	136,935.00	0.44
29	002970	锐明技术	2,800	135,800.00	0.44
30	601799	星宇股份	1,100	135,707.00	0.44
31	300101	振芯科技	4,700	133,621.00	0.43
32	300045	华力创通	4,600	132,986.00	0.43
33	600388	龙净环保	8,100	132,111.00	0.42
34	600739	辽宁成大	11,800	131,924.00	0.42
35	002151	北斗星通	2,900	131,747.00	0.42
36	002100	天康生物	17,800	131,186.00	0.42
37	300475	香农芯创	900	129,906.00	0.42

38	300451	创业慧康	26,700	129,228.00	0.42
39	000630	铜陵有色	21,500	129,215.00	0.41
40	300012	华测检测	9,400	127,370.00	0.41
41	600757	长江传媒	14,300	126,984.00	0.41
42	002539	云图控股	10,600	125,292.00	0.40
43	002258	利尔化学	9,600	125,280.00	0.40
44	000657	中钨高新	4,500	124,695.00	0.40
45	600057	厦门象屿	14,500	123,540.00	0.40
46	002335	科华数据	2,200	122,166.00	0.39
47	300618	寒锐钴业	2,700	122,067.00	0.39
48	600320	振华重工	23,700	122,055.00	0.39
49	603083	剑桥科技	900	120,942.00	0.39
50	002097	山河智能	9,700	120,377.00	0.39
51	600556	天下秀	19,700	119,579.00	0.38
52	002487	大金重工	2,300	119,439.00	0.38
53	002906	华阳集团	3,900	119,262.00	0.38
54	002222	福晶科技	2,100	118,314.00	0.38
55	603279	景津装备	7,000	118,090.00	0.38
56	002273	水晶光电	4,700	118,064.00	0.38
57	688548	广钢气体	7,948	115,563.92	0.37
58	002396	星网锐捷	3,800	115,140.00	0.37
59	600869	远东股份	14,300	115,115.00	0.37
60	300416	苏试试验	6,400	114,176.00	0.37
61	688343	云天励飞	1,496	113,815.68	0.37
62	300134	大富科技	9,100	113,750.00	0.37
63	603516	淳中科技	500	111,750.00	0.36
64	688380	中微半导	3,457	111,142.55	0.36
65	688347	华虹公司	1,027	110,782.49	0.36
66	688037	芯源微	743	110,342.93	0.35
67	688106	金宏气体	5,612	109,939.08	0.35
68	688503	聚和材料	1,794	109,434.00	0.35
69	603565	中谷物流	10,800	108,432.00	0.35
70	002314	南山控股	37,900	108,015.00	0.35
71	688543	国科军工	1,736	107,753.52	0.35
72	002493	荣盛石化	9,200	107,732.00	0.35
73	688601	力芯微	2,498	106,389.82	0.34
74	603127	昭衍新药	3,000	105,030.00	0.34
75	300415	伊之密	4,000	104,240.00	0.33
76	300009	安科生物	10,800	103,356.00	0.33
77	002506	协鑫集成	36,800	103,040.00	0.33
78	603130	云中马	1,800	101,970.00	0.33
79	002497	雅化集团	4,100	101,475.00	0.33
79	002545	东方铁塔	5,500	101,475.00	0.33

80	603615	茶花股份	4,300	100,534.00	0.32
81	601083	锦江航运	9,000	100,440.00	0.32
82	600996	贵广网络	10,000	100,400.00	0.32
83	002091	江苏国泰	11,000	99,330.00	0.32
84	600971	恒源煤电	15,900	99,216.00	0.32
85	002446	盛路通信	9,400	98,606.00	0.32
86	300244	迪安诊断	6,200	98,270.00	0.32
87	300035	中科电气	4,600	97,934.00	0.31
88	002400	省广集团	11,000	97,570.00	0.31
89	002023	海特高新	7,200	97,488.00	0.31
90	002326	永太科技	3,900	97,188.00	0.31
91	600195	中牧股份	12,300	96,801.00	0.31
92	600452	涪陵电力	10,300	96,511.00	0.31
93	600497	驰宏锌锗	13,200	96,492.00	0.31
94	688200	华峰测控	507	96,431.40	0.31
95	002428	云南锗业	3,000	95,250.00	0.31
96	002270	华明装备	3,800	95,152.00	0.31
97	300850	新强联	2,300	95,151.00	0.31
98	688019	安集科技	434	94,577.28	0.30
99	300772	运达股份	4,900	93,394.00	0.30
100	688698	伟创电气	937	92,650.56	0.30
101	000818	航锦科技	4,800	92,640.00	0.30
102	002488	金固股份	10,500	92,295.00	0.30
103	300785	值得买	2,100	92,022.00	0.30
104	300666	江丰电子	1,000	92,000.00	0.30
105	600595	中孚实业	11,500	90,275.00	0.29
106	000422	湖北宜化	6,300	89,523.00	0.29
107	301511	德福科技	2,500	89,475.00	0.29
108	000555	神州信息	5,400	89,370.00	0.29
109	002036	联创电子	8,100	89,262.00	0.29
110	688066	航天宏图	2,732	88,953.92	0.29
111	688088	虹软科技	1,796	88,902.00	0.29
112	002500	山西证券	14,700	88,053.00	0.28
113	688390	固德威	1,411	87,665.43	0.28
114	688331	荣昌生物	1,126	87,591.54	0.28
115	600055	万东医疗	5,600	87,248.00	0.28
116	002145	钛能化学	17,700	86,730.00	0.28
117	600025	华能水电	9,500	86,260.00	0.28
118	002544	普天科技	2,500	86,225.00	0.28
119	000685	中山公用	7,400	86,210.00	0.28
120	000821	ST京机	6,400	86,208.00	0.28
121	688018	乐鑫科技	505	85,850.00	0.28
122	300253	卫宁健康	9,700	85,554.00	0.27

123	300438	鹏辉能源	1,600	85,152.00	0.27
124	603444	吉比特	200	84,770.00	0.27
125	002204	大连重工	11,000	84,150.00	0.27
126	603319	美湖股份	2,300	84,134.00	0.27
127	300953	震裕科技	500	84,010.00	0.27
128	600490	鹏欣资源	10,800	83,484.00	0.27
129	301550	斯菱智驱	600	83,220.00	0.27
130	603997	继峰股份	5,900	82,010.00	0.26
131	688403	汇成股份	4,997	81,850.86	0.26
132	002706	良信股份	7,500	80,850.00	0.26
133	002378	章源钨业	5,700	80,826.00	0.26
134	002045	国光电器	5,700	80,769.00	0.26
135	000603	盛达资源	2,600	80,496.00	0.26
136	600380	健康元	6,900	79,695.00	0.26
137	300068	南都电源	5,100	79,254.00	0.25
138	002006	精工科技	3,400	78,744.00	0.25
139	603737	三棵树	1,700	78,659.00	0.25
140	002546	新联电子	11,100	77,589.00	0.25
141	300170	汉得信息	4,100	77,572.00	0.25
142	603920	世运电路	1,600	77,456.00	0.25
143	688484	南芯科技	1,900	77,254.00	0.25
144	603171	税友股份	1,400	77,182.00	0.25
145	002839	张家港行	16,600	75,862.00	0.24
146	002955	鸿合科技	2,500	75,675.00	0.24
147	000735	罗牛山	8,300	75,032.00	0.24
148	300158	振东制药	12,900	74,949.00	0.24
149	688549	中巨芯	8,172	74,528.64	0.24
150	688123	聚辰股份	584	73,338.72	0.24
151	300903	科翔股份	3,800	73,302.00	0.24
152	300113	顺网科技	3,600	72,864.00	0.23
153	300008	天海防务	9,100	71,799.00	0.23
154	688475	萤石网络	2,377	71,571.47	0.23
155	301316	慧博云通	1,600	71,488.00	0.23
156	600961	株冶集团	4,400	70,840.00	0.23
157	002182	宝武镁业	4,600	70,380.00	0.23
158	300747	锐科激光	2,600	70,278.00	0.23
158	600478	科力远	10,200	70,278.00	0.23
159	688266	泽璟制药	751	69,617.70	0.22
160	601677	明泰铝业	4,700	69,513.00	0.22
161	603119	浙江荣泰	600	69,402.00	0.22
162	688048	长光华芯	553	69,318.55	0.22
163	601126	四方股份	2,300	69,184.00	0.22
164	002698	博实股份	4,100	68,921.00	0.22

165	603866	桃李面包	13,100	68,906.00	0.22
166	000990	诚志股份	8,700	68,904.00	0.22
167	002484	江海股份	2,300	68,310.00	0.22
168	002518	科士达	1,400	67,928.00	0.22
169	688516	奥特维	1,500	67,890.00	0.22
170	002386	天原股份	12,500	67,875.00	0.22
171	300087	荃银高科	5,800	67,744.00	0.22
172	603833	欧派家居	1,300	67,717.00	0.22
173	600461	洪城环境	7,300	67,671.00	0.22
174	002171	楚江新材	5,100	67,626.00	0.22
175	002139	拓邦股份	4,900	67,522.00	0.22
176	300775	三角防务	2,200	66,880.00	0.21
177	300088	长信科技	11,000	66,660.00	0.21
178	600967	内蒙一机	3,900	65,520.00	0.21
179	300206	理邦仪器	5,100	65,229.00	0.21
180	300638	广和通	2,200	65,208.00	0.21
181	600027	华电国际	13,000	64,480.00	0.21
181	600094	大名城	15,500	64,480.00	0.21
182	688007	光峰科技	3,471	64,456.47	0.21
183	300292	吴通控股	14,100	63,591.00	0.20
184	688372	伟测科技	582	63,490.38	0.20
185	300432	富临精工	3,800	63,460.00	0.20
186	600531	豫光金铅	5,400	63,450.00	0.20
187	002320	海峡股份	5,200	63,284.00	0.20
188	300252	金信诺	4,300	62,866.00	0.20
189	002351	漫步者	5,200	62,712.00	0.20
190	002324	普利特	3,900	62,361.00	0.20
191	002192	融捷股份	1,200	62,100.00	0.20
192	688433	华曙高科	936	61,935.12	0.20
193	600259	中稀有色	1,100	61,886.00	0.20
194	301217	铜冠铜箔	1,800	61,704.00	0.20
195	001339	智微智能	1,200	61,332.00	0.20
196	002993	奥海科技	1,400	61,194.00	0.20
197	300394	天孚通信	300	60,909.00	0.20
198	688371	菲沃泰	3,282	60,618.54	0.19
199	688636	智明达	1,400	59,976.00	0.19
200	600416	湘电股份	3,800	59,964.00	0.19
201	601137	博威合金	2,800	59,836.00	0.19
202	002019	亿帆医药	5,000	59,800.00	0.19
203	001287	中电港	2,600	58,916.00	0.19
204	600446	金证股份	3,700	58,904.00	0.19
205	300620	光库科技	400	58,820.00	0.19
206	002160	常铝股份	11,200	58,240.00	0.19

207	301526	国际复材	8,100	56,700.00	0.18
208	600782	新钢股份	14,600	56,648.00	0.18
209	600428	中远海特	7,900	56,090.00	0.18
210	688766	普冉股份	439	55,845.19	0.18
211	688233	神工股份	795	55,673.85	0.18
212	603048	浙江黎明	2,600	54,964.00	0.18
213	605555	德昌股份	3,000	54,900.00	0.18
214	688505	复旦张江	6,600	54,780.00	0.18
215	301326	捷邦科技	500	54,580.00	0.18
216	688205	德科立	396	54,442.08	0.17
217	000049	德赛电池	2,000	53,760.00	0.17
218	603893	瑞芯微	300	53,484.00	0.17
219	300459	汤姆猫	11,600	53,244.00	0.17
220	603063	禾望电气	1,600	52,912.00	0.17
221	002859	洁美科技	1,900	52,440.00	0.17
222	300493	润欣科技	2,600	52,234.00	0.17
223	688146	中船特气	1,287	51,994.80	0.17
224	603218	日月股份	3,900	51,675.00	0.17
225	688028	沃尔德	798	51,502.92	0.17
226	001301	尚太科技	600	51,486.00	0.17
227	601208	东材科技	1,900	51,471.00	0.17
228	002626	金达威	2,600	51,246.00	0.16
229	300718	长盛轴承	600	51,216.00	0.16
230	301093	华兰股份	1,000	51,100.00	0.16
231	601016	节能风电	17,200	50,740.00	0.16
232	301205	联特科技	300	50,553.00	0.16
233	300315	掌趣科技	10,200	50,388.00	0.16
234	002532	天山铝业	3,100	50,158.00	0.16
235	600717	天津港	11,200	50,064.00	0.16
236	000762	西藏矿业	1,900	49,913.00	0.16
237	300624	万兴科技	700	49,455.00	0.16
238	000680	山推股份	4,100	49,077.00	0.16
239	300682	朗新科技	3,200	48,672.00	0.16
240	301155	海力风电	600	48,558.00	0.16
241	600649	城投控股	10,800	48,060.00	0.15
242	002895	川恒股份	1,300	47,658.00	0.15
243	601222	林洋能源	8,700	47,589.00	0.15
244	300580	贝斯特	1,800	47,322.00	0.15
245	688098	申联生物	5,284	46,921.92	0.15
246	600827	百联股份	5,200	46,748.00	0.15
247	000938	紫光股份	1,900	46,740.00	0.15
248	603341	龙旗科技	1,100	46,486.00	0.15
249	300596	利安隆	1,100	46,431.00	0.15

250	300570	太辰光	400	46,220.00	0.15
251	688016	心脉医疗	500	45,830.00	0.15
252	605376	博迁新材	700	45,780.00	0.15
253	688116	天奈科技	960	45,264.00	0.15
254	600586	金晶科技	7,700	43,351.00	0.14
255	000058	深赛格	4,600	43,240.00	0.14
256	600667	太极实业	5,400	43,038.00	0.14
257	300811	铂科新材	600	42,786.00	0.14
258	000550	江铃汽车	2,300	42,780.00	0.14
259	688630	芯碁微装	316	42,511.48	0.14
260	600266	城建发展	8,200	41,574.00	0.13
261	600141	兴发集团	1,200	41,496.00	0.13
262	301016	雷尔伟	1,800	40,644.00	0.13
263	300634	彩讯股份	1,600	40,368.00	0.13
264	002020	京新药业	2,100	39,858.00	0.13
265	688063	派能科技	690	39,205.80	0.13
266	000581	威孚高科	1,900	39,178.00	0.13
267	300674	宇信科技	1,600	38,816.00	0.12
268	601975	招商南油	12,800	38,656.00	0.12
269	600552	凯盛科技	3,100	38,440.00	0.12
270	300925	法本信息	1,800	38,232.00	0.12
271	688408	中信博	900	37,899.00	0.12
272	600596	新安股份	3,300	37,851.00	0.12
273	000089	深圳机场	5,400	37,746.00	0.12
274	300769	德方纳米	857	37,716.57	0.12
275	002075	沙钢股份	6,500	37,375.00	0.12
276	002003	伟星股份	3,500	37,100.00	0.12
277	600623	华谊集团	4,800	37,008.00	0.12
278	002315	焦点科技	800	36,608.00	0.12
279	300457	赢合科技	1,300	36,205.00	0.12
280	300119	瑞普生物	1,900	35,663.00	0.11
281	688700	东威科技	1,000	35,280.00	0.11
282	603707	健友股份	3,900	35,217.00	0.11
283	002334	英威腾	3,900	35,178.00	0.11
284	000869	张裕A	1,700	34,986.00	0.11
285	002886	沃特股份	1,600	34,752.00	0.11
286	688536	思瑞浦	217	34,693.96	0.11
287	601669	中国电建	6,600	34,320.00	0.11
288	300357	我武生物	1,200	34,020.00	0.11
289	600031	三一重工	1,600	33,808.00	0.11
290	300723	一品红	1,000	33,550.00	0.11
291	600916	中国黄金	4,100	33,415.00	0.11
292	688091	上海谊众	692	32,524.00	0.10

293	301071	力量钻石	900	32,256.00	0.10
294	001260	坤泰股份	1,600	32,192.00	0.10
295	300355	蒙草生态	7,900	31,916.00	0.10
296	603345	安井食品	400	31,712.00	0.10
297	603858	步长制药	2,000	31,280.00	0.10
298	000099	中信海直	1,500	31,125.00	0.10
299	600284	浦东建设	3,700	31,080.00	0.10
300	001914	招商积余	2,900	30,972.00	0.10
300	688690	纳微科技	1,200	30,972.00	0.10
301	688258	卓易信息	400	30,628.00	0.10
302	002434	万里扬	3,200	30,496.00	0.10
303	002714	牧原股份	600	30,348.00	0.10
304	600120	浙江东方	4,900	30,233.00	0.10
305	002064	华峰化学	2,700	29,700.00	0.10
306	300633	开立医疗	1,100	29,062.00	0.09
307	002534	西子洁能	1,700	28,509.00	0.09
308	300232	洲明科技	4,000	28,360.00	0.09
309	600210	紫江企业	3,800	27,930.00	0.09
310	688206	概伦电子	801	27,898.83	0.09
311	603323	苏农银行	5,500	27,775.00	0.09
312	300043	星辉娱乐	4,900	27,685.00	0.09
313	688049	炬芯科技	522	27,457.20	0.09
314	300652	雷迪克	500	27,430.00	0.09
315	603267	鸿远电子	500	27,215.00	0.09
316	688219	会通股份	2,190	27,199.80	0.09
317	600710	苏美达	2,500	27,025.00	0.09
318	000030	富奥股份	4,700	26,978.00	0.09
319	002941	新疆交建	1,700	26,945.00	0.09
320	002468	申通快递	2,000	26,840.00	0.09
321	603229	奥翔药业	2,700	26,784.00	0.09
322	000927	中国铁物	10,200	26,622.00	0.09
323	000156	华数传媒	3,500	26,495.00	0.09
324	600339	中油工程	7,900	26,465.00	0.08
325	002068	黑猫股份	3,000	26,460.00	0.08
326	603118	共进股份	2,300	26,450.00	0.08
327	600859	王府井	1,700	26,401.00	0.08
328	688190	云路股份	270	26,298.00	0.08
329	000589	贵州轮胎	5,000	25,900.00	0.08
330	603305	旭升集团	1,600	25,888.00	0.08
331	601298	青岛港	3,100	25,854.00	0.08
332	300319	麦捷科技	2,200	25,718.00	0.08
333	002125	湘潭电化	1,800	25,488.00	0.08
334	600750	华润江中	1,100	25,487.00	0.08

335	301391	卡莱特	300	25,455.00	0.08
336	000623	吉林敖东	1,300	25,389.00	0.08
337	002004	华邦健康	5,300	25,334.00	0.08
338	688349	三一重能	1,000	25,280.00	0.08
339	300687	赛意信息	1,100	25,267.00	0.08
340	605055	迎丰股份	2,600	25,246.00	0.08
341	002866	传艺科技	1,400	25,214.00	0.08
342	603989	艾华集团	1,500	25,170.00	0.08
343	600814	杭州解百	3,100	25,110.00	0.08
344	000652	泰达股份	6,000	24,960.00	0.08
345	300776	帝尔激光	400	24,856.00	0.08
346	688556	高测股份	2,168	24,758.56	0.08
347	300224	正海磁材	1,600	24,736.00	0.08
348	688155	先惠技术	409	24,724.05	0.08
349	601949	中国出版	3,800	24,510.00	0.08
350	301238	瑞泰新材	1,200	24,480.00	0.08
351	605020	永和股份	900	24,201.00	0.08
352	688185	康希诺	384	24,134.40	0.08
353	688261	东微半导	294	24,110.94	0.08
354	002943	宇晶股份	600	23,760.00	0.08
355	601858	中国科传	1,300	23,595.00	0.08
356	000059	华锦股份	4,400	23,540.00	0.08
357	688326	经纬恒润	200	23,500.00	0.08
358	300725	药石科技	600	23,136.00	0.07
359	688598	金博股份	788	23,135.68	0.07
360	600017	日照港	7,700	23,100.00	0.07
361	301239	普瑞眼科	700	23,023.00	0.07
362	688127	蓝特光学	589	22,670.61	0.07
363	600562	国睿科技	800	22,608.00	0.07
364	601801	皖新传媒	3,400	22,372.00	0.07
365	688711	宏微科技	692	21,957.16	0.07
366	601515	衢州东峰	5,100	21,930.00	0.07
367	688225	亚信安全	1,128	21,883.20	0.07
368	600997	开滦股份	3,800	21,850.00	0.07
369	688552	航天南湖	600	21,792.00	0.07
370	600817	宇通重工	1,900	21,603.00	0.07
371	605056	咸亨国际	1,300	21,450.00	0.07
372	300048	合康新能	3,600	21,420.00	0.07
373	603368	柳药集团	1,200	21,384.00	0.07
374	300915	海融科技	900	21,375.00	0.07
375	002254	泰和新材	2,100	21,042.00	0.07
376	600486	扬农化工	300	20,817.00	0.07
377	000930	中粮科技	3,600	20,772.00	0.07

378	600633	浙数文化	1,600	20,576.00	0.07
379	002847	盐津铺子	300	20,493.00	0.07
380	002965	祥鑫科技	500	20,340.00	0.07
381	001212	中旗新材	400	20,280.00	0.07
382	601958	金钼股份	1,300	20,254.00	0.07
383	301325	曼恩斯特	400	20,220.00	0.06
384	300435	中泰股份	900	19,998.00	0.06
385	600888	新疆众和	2,400	19,656.00	0.06
386	000028	国药一致	800	19,648.00	0.06
387	300341	麦克奥迪	1,200	19,608.00	0.06
388	300905	宝丽迪	600	19,338.00	0.06
389	300693	盛弘股份	500	19,140.00	0.06
390	601233	桐昆股份	1,100	18,931.00	0.06
391	002127	南极电商	5,600	18,872.00	0.06
392	300709	精研科技	400	18,864.00	0.06
393	000719	中原传媒	1,600	18,816.00	0.06
394	002997	瑞鹄模具	500	18,700.00	0.06
395	002010	传化智联	3,200	18,592.00	0.06
396	688707	振华新材	1,324	18,337.40	0.06
397	688425	铁建重工	3,600	18,252.00	0.06
398	300790	宇瞳光学	600	17,946.00	0.06
399	688083	中望软件	261	17,776.71	0.06
400	002801	微光股份	500	17,705.00	0.06
401	002416	爱施德	1,400	17,612.00	0.06
402	301327	华宝新能	300	17,301.00	0.06
403	301120	新特电气	1,000	17,270.00	0.06
404	603809	豪能股份	1,200	17,220.00	0.06
405	300413	芒果超媒	700	17,094.00	0.05
406	603035	常熟汽饰	1,100	17,017.00	0.05
407	300129	泰胜风能	1,600	16,736.00	0.05
407	688278	特宝生物	200	16,736.00	0.05
408	000682	东方电子	1,400	16,604.00	0.05
409	688236	春立医疗	724	16,565.12	0.05
410	300702	天宇股份	700	16,520.00	0.05
411	301589	诺瓦星云	100	16,455.00	0.05
412	002815	崇达技术	1,200	16,392.00	0.05
413	600422	昆药集团	1,300	16,328.00	0.05
414	600020	中原高速	3,800	16,188.00	0.05
415	688519	南亚新材	200	16,172.00	0.05
416	002121	科陆电子	2,100	16,170.00	0.05
417	601900	南方传媒	1,200	16,092.00	0.05
418	600893	航发动力	400	16,012.00	0.05
419	300663	科蓝软件	900	15,876.00	0.05

420	002516	旷达科技	2,400	15,816.00	0.05
421	688360	德马科技	731	15,541.06	0.05
422	601678	滨化股份	3,600	15,264.00	0.05
423	601033	永兴股份	1,000	15,130.00	0.05
424	688275	万润新能	200	15,080.00	0.05
425	301602	超研股份	700	15,078.00	0.05
426	688590	新致软件	800	14,928.00	0.05
427	002461	珠江啤酒	1,600	14,864.00	0.05
428	601330	绿色动力	2,200	14,806.00	0.05
429	603336	宏辉果蔬	1,700	14,552.00	0.05
430	600131	国网信通	900	14,526.00	0.05
431	600285	羚锐制药	700	14,497.00	0.05
432	300841	康华生物	200	14,452.00	0.05
433	002063	远光软件	2,300	13,961.00	0.04
434	300613	富瀚微	300	13,818.00	0.04
435	300788	中信出版	500	13,700.00	0.04
436	688381	帝奥微	600	13,686.00	0.04
437	601882	海天精工	700	13,622.00	0.04
438	002226	江南化工	2,300	13,363.00	0.04
439	002649	博彦科技	1,000	13,190.00	0.04
440	002194	武汉凡谷	1,000	13,050.00	0.04
441	601615	明阳智能	900	13,032.00	0.04
442	603070	万控智造	1,000	12,960.00	0.04
443	600283	钱江水利	1,400	12,810.00	0.04
444	600035	楚天高速	3,300	12,804.00	0.04
445	600557	康缘药业	900	12,699.00	0.04
446	600903	贵州燃气	1,900	12,559.00	0.04
447	600216	浙江医药	900	12,474.00	0.04
448	603056	德邦股份	900	12,303.00	0.04
449	600808	马钢股份	2,900	12,238.00	0.04
450	688103	国力电子	200	12,118.00	0.04
451	300976	达瑞电子	200	12,014.00	0.04
452	600251	冠农股份	1,300	11,999.00	0.04
453	002664	信质集团	500	11,980.00	0.04
454	601311	骆驼股份	1,300	11,921.00	0.04
455	002406	远东传动	1,500	11,910.00	0.04
456	301177	迪阿股份	400	11,548.00	0.04
457	688192	迪哲医药	200	11,520.00	0.04
458	000045	深纺织 A	900	10,998.00	0.04
459	603166	福达股份	700	10,990.00	0.04
460	002469	三维化学	1,300	10,855.00	0.03
461	601800	中国交建	1,300	10,712.00	0.03
462	688046	药康生物	694	10,659.84	0.03

463	301280	珠城科技	200	10,652.00	0.03
464	002179	中航光电	300	10,632.00	0.03
465	600212	绿能慧充	1,300	10,465.00	0.03
466	600578	京能电力	2,000	10,200.00	0.03
467	000006	深振业 A	1,000	9,950.00	0.03
468	603103	横店影视	600	9,948.00	0.03
469	688035	德邦科技	200	9,650.00	0.03
470	688799	华纳药厂	200	9,540.00	0.03
471	002465	海格通信	600	9,450.00	0.03
472	600970	中材国际	900	9,351.00	0.03
473	300354	东华测试	200	9,100.00	0.03
474	301303	真兰仪表	600	9,084.00	0.03
475	600662	外服控股	1,800	9,036.00	0.03
475	688449	联芸科技	200	9,036.00	0.03
476	002216	三全食品	800	9,032.00	0.03
477	002730	电光科技	600	9,024.00	0.03
478	688180	君实生物	264	9,018.24	0.03
479	300990	同飞股份	100	9,015.00	0.03
480	688428	诺诚健华	421	8,638.92	0.03
481	600176	中国巨石	500	8,550.00	0.03
482	000877	天山股份	1,600	8,512.00	0.03
483	002746	仙坛股份	1,400	8,498.00	0.03
484	002038	双鹭药业	1,100	8,107.00	0.03
485	301090	华润材料	1,100	7,744.00	0.02
486	601000	唐山港	2,000	7,680.00	0.02
487	688176	亚虹医药	667	7,677.17	0.02
488	600449	宁夏建材	600	7,416.00	0.02
489	603107	上海汽配	500	7,415.00	0.02
490	000975	山金国际	300	7,299.00	0.02
491	301268	铭利达	400	7,292.00	0.02
492	600123	兰花科创	1,200	7,092.00	0.02
493	002635	安洁科技	500	6,930.00	0.02
494	603367	辰欣药业	400	6,928.00	0.02
495	600138	中青旅	700	6,916.00	0.02
496	600851	海欣股份	1,000	6,830.00	0.02
497	300911	亿田智能	200	6,660.00	0.02
498	002987	京北方	300	6,459.00	0.02
499	002507	涪陵榨菜	500	6,455.00	0.02
500	002823	凯中精密	400	6,424.00	0.02
501	300671	富满微	200	6,378.00	0.02
502	688315	诺禾致源	463	6,148.64	0.02
503	600600	青岛啤酒	100	6,120.00	0.02
504	000498	山东路桥	1,000	6,030.00	0.02

505	000848	承德露露	700	5,950.00	0.02
506	603693	江苏新能	500	5,930.00	0.02
507	002422	科伦药业	200	5,870.00	0.02
508	001872	招商港口	300	5,799.00	0.02
509	002318	久立特材	200	5,790.00	0.02
510	603713	密尔克卫	100	5,577.00	0.02
511	300531	优博讯	300	5,412.00	0.02
512	603270	金帝股份	200	5,406.00	0.02
513	002498	汉缆股份	1,400	5,362.00	0.02
514	601827	三峰环境	600	5,082.00	0.02
515	002458	益生股份	600	5,028.00	0.02
516	300226	上海钢联	200	5,024.00	0.02
517	300138	晨光生物	400	4,964.00	0.02
517	688232	新点软件	200	4,964.00	0.02
518	605599	菜百股份	300	4,911.00	0.02
519	300679	电连技术	100	4,868.00	0.02
520	601921	浙版传媒	600	4,692.00	0.02
521	300558	贝达药业	100	4,669.00	0.01
522	300320	海达股份	500	4,665.00	0.01
523	001286	陕西能源	500	4,655.00	0.01
524	603275	众辰科技	100	4,558.00	0.01
525	688584	上海合晶	200	4,388.00	0.01
526	600874	创业环保	700	4,158.00	0.01
527	002057	中钢天源	400	4,076.00	0.01
528	002327	富安娜	600	4,026.00	0.01
529	001328	登康口腔	100	3,948.00	0.01
530	603855	华荣股份	200	3,870.00	0.01
531	300149	睿智医药	400	3,824.00	0.01
532	603380	易德龙	100	3,800.00	0.01
533	600081	东风科技	300	3,549.00	0.01
534	001322	箭牌家居	400	3,548.00	0.01
535	002423	中粮资本	300	3,510.00	0.01
536	301260	格力博	200	3,410.00	0.01
537	301330	熵基科技	100	3,305.00	0.01
538	600335	国机汽车	500	3,255.00	0.01
539	600166	福田汽车	1,100	3,212.00	0.01
540	600023	浙能电力	600	2,970.00	0.01
540	601618	中国中冶	1,000	2,970.00	0.01
541	600511	国药股份	100	2,875.00	0.01
542	300213	佳讯飞鸿	300	2,856.00	0.01
543	000650	仁和药业	500	2,825.00	0.01
544	000582	北部湾港	300	2,814.00	0.01
545	605050	福然德	200	2,694.00	0.01

546	688389	普门科技	200	2,596.00	0.01
547	600959	江苏有线	700	2,408.00	0.01
548	600500	中化国际	600	2,352.00	0.01
549	300286	安科瑞	100	2,308.00	0.01
550	603328	依顿电子	200	2,192.00	0.01
551	002393	力生制药	100	2,171.00	0.01
552	001308	康冠科技	100	2,086.00	0.01
553	300353	东土科技	100	2,036.00	0.01
554	603057	紫燕食品	100	2,034.00	0.01
555	002559	亚威股份	200	2,024.00	0.01
556	600007	中国国贸	100	1,982.00	0.01
557	300168	万达信息	300	1,938.00	0.01
558	600963	岳阳林纸	400	1,868.00	0.01
559	603060	国检集团	300	1,824.00	0.01
560	002577	雷柏科技	100	1,781.00	0.01
561	000012	南玻 A	400	1,772.00	0.01
562	688055	龙腾光电	479	1,724.40	0.01
563	600780	通宝能源	300	1,704.00	0.01
564	601965	中国汽研	100	1,660.00	0.01
565	000402	金融街	600	1,650.00	0.01
566	300384	三联虹普	100	1,625.00	0.01
567	601228	广州港	500	1,620.00	0.01
568	601058	赛轮轮胎	100	1,618.00	0.01
569	002085	万丰奥威	100	1,601.00	0.01
570	600663	陆家嘴	200	1,582.00	0.01
571	600790	轻纺城	400	1,532.00	0.00
572	000042	中洲控股	200	1,524.00	0.00
573	300601	康泰生物	100	1,477.00	0.00
574	002408	齐翔腾达	300	1,464.00	0.00
575	000598	兴蓉环境	200	1,434.00	0.00
576	601163	三角轮胎	100	1,429.00	0.00
577	002705	新宝股份	100	1,426.00	0.00
578	000726	鲁泰 A	200	1,424.00	0.00
579	002918	蒙娜丽莎	100	1,423.00	0.00
580	002152	广电运通	100	1,381.00	0.00
581	002572	索菲亚	100	1,361.00	0.00
582	600372	中航机载	100	1,342.00	0.00
582	601811	新华文轩	100	1,342.00	0.00
583	002302	西部建设	200	1,224.00	0.00
584	002030	达安基因	200	1,192.00	0.00
585	002399	海普瑞	100	1,179.00	0.00
586	605018	长华集团	100	1,158.00	0.00
587	600968	海油发展	300	1,152.00	0.00

588	300057	万顺新材	200	1,138.00	0.00
589	002106	莱宝高科	100	1,096.00	0.00
590	002960	青鸟消防	100	1,051.00	0.00
591	601006	大秦铁路	200	1,032.00	0.00
592	002293	罗莱生活	100	1,027.00	0.00
593	600873	梅花生物	100	1,013.00	0.00
594	300825	阿尔特	100	968.00	0.00
595	002437	誉衡药业	300	921.00	0.00
596	601952	苏垦农发	100	912.00	0.00
597	600925	苏能股份	200	908.00	0.00
598	000050	深天马 A	100	903.00	0.00
599	002454	松芝股份	100	871.00	0.00
600	600597	光明乳业	100	809.00	0.00
601	002367	康力电梯	100	806.00	0.00
602	002662	峰璟股份	200	804.00	0.00
603	002376	新北洋	100	772.00	0.00
604	601117	中国化学	100	753.00	0.00
605	600987	航民股份	100	689.00	0.00
606	603111	康尼机电	100	685.00	0.00
607	000928	中钢国际	100	661.00	0.00
608	000791	甘肃能源	100	645.00	0.00
609	002252	上海莱士	100	634.00	0.00
610	002035	华帝股份	100	620.00	0.00
611	600825	新华传媒	100	618.00	0.00
612	000541	佛山照明	100	601.00	0.00
613	002206	海利得	100	585.00	0.00
614	000862	银星能源	100	584.00	0.00
615	600582	天地科技	100	583.00	0.00
616	601339	百隆东方	100	579.00	0.00
617	002274	华昌化工	100	565.00	0.00
618	601199	江南水务	100	557.00	0.00
619	600583	海油工程	100	549.00	0.00
620	601003	柳钢股份	100	503.00	0.00
621	003035	南网能源	100	458.00	0.00
622	300194	福安药业	100	443.00	0.00
623	000539	粤电力 A	100	442.00	0.00
624	002567	唐人神	100	440.00	0.00
625	600982	宁波能源	100	434.00	0.00
626	000516	国际医学	100	429.00	0.00
627	600361	创新新材	100	424.00	0.00
628	600325	华发股份	100	422.00	0.00
629	600425	青松建化	100	416.00	0.00
630	601096	宏盛华源	100	415.00	0.00

631	001213	中铁特货	100	405.00	0.00
632	002375	亚厦股份	100	379.00	0.00
633	601568	北元集团	100	372.00	0.00
634	601018	宁波港	100	363.00	0.00
635	002060	广东建工	100	360.00	0.00
636	600300	维维股份	100	351.00	0.00
637	002081	金螳螂	100	342.00	0.00
638	000761	本钢板材	100	335.00	0.00
639	600383	金地集团	100	306.00	0.00
640	000767	晋控电力	100	280.00	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	300739	明阳电路	1,373,438.01	6.28
2	300231	银信科技	1,369,918.00	6.27
3	301128	强瑞技术	1,024,483.00	4.69
4	300814	中富电路	988,966.00	4.52
5	688347	华虹公司	937,883.13	4.29
6	002402	和而泰	885,831.00	4.05
7	000766	通化金马	877,111.00	4.01
8	301255	通力科技	799,670.00	3.66
9	600796	钱江生化	750,721.00	3.43
10	002322	理工能科	684,543.00	3.13
11	002264	新华都	644,036.00	2.95
12	688037	芯源微	629,437.73	2.88
13	002326	永太科技	620,639.00	2.84
14	002497	雅化集团	612,528.00	2.80
15	300035	中科电气	608,482.00	2.78
16	000045	深纺织 A	606,136.00	2.77
17	300968	格林精密	574,653.00	2.63
18	002335	科华数据	530,393.00	2.43
19	300666	江丰电子	526,281.00	2.41
20	300672	国科微	517,753.00	2.37
21	688019	安集科技	514,297.95	2.35
22	300352	北信源	513,153.00	2.35
23	002222	福晶科技	507,773.00	2.32
24	002126	银轮股份	498,720.00	2.28
25	002164	宁波东力	498,068.00	2.28
26	603516	淳中科技	491,618.00	2.25
27	300548	长芯博创	491,019.00	2.25
28	600259	中稀有色	485,860.00	2.22

29	601208	东材科技	455,532.00	2.08
30	301199	迈赫股份	451,990.20	2.07
31	603766	隆鑫通用	450,382.00	2.06
32	300762	上海瀚讯	447,962.00	2.05
33	300475	香农芯创	445,453.00	2.04

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	300739	明阳电路	1,450,114.00	6.63
2	300231	银信科技	1,394,508.00	6.38
3	301128	强瑞技术	1,072,789.60	4.91
4	300814	中富电路	1,013,535.00	4.64
5	688347	华虹公司	1,009,881.26	4.62
6	000766	通化金马	970,623.00	4.44
7	002402	和而泰	863,365.00	3.95
8	301255	通力科技	854,837.00	3.91
9	600796	钱江生化	750,109.00	3.43
10	002322	理工能科	702,863.00	3.22
11	002264	新华都	661,916.00	3.03
12	300968	格林精密	638,425.00	2.92
13	688037	芯源微	629,388.63	2.88
14	002126	银轮股份	624,390.00	2.86
15	000045	深纺织 A	604,172.00	2.76
16	300035	中科电气	588,771.00	2.69
17	002497	雅化集团	549,271.00	2.51
18	300666	江丰电子	547,553.00	2.50
19	002164	宁波东力	547,482.00	2.50
20	300762	上海瀚讯	547,296.00	2.50
21	600259	中稀有金	526,461.00	2.41
22	002222	福晶科技	505,546.00	2.31
23	002326	永太科技	499,191.00	2.28
24	300229	拓尔思	498,636.00	2.28
25	301199	迈赫股份	490,637.00	2.24
26	603876	鼎胜新材	445,282.00	2.04
27	002335	科华数据	444,008.00	2.03
28	603516	淳中科技	438,910.00	2.01
29	002317	众生药业	437,280.00	2.00

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	186,651,499.79
卖出股票收入（成交）总额	185,881,731.49

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

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	1,717,426.14	5.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,717,426.14	5.52

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	019766	25 国债 01	14,000	1,415,617.10	4.55
2	019785	25 国债 13	3,000	301,809.04	0.97

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	15,701.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,602.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,304.16

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
东方量化 多策略混 合 A	510	57,371.95	24,732,161.50	84.53	4,527,533.98	15.47
东方量化 多策略混 合 C	93	24,816.40	0.00	0.00	2,307,925.49	100.00
合计	603	52,350.95	24,732,161.50	78.35	6,835,459.47	21.65

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	东方量化多策略混合 A	742,789.86	2.54
	东方量化多策略混合 C	1.01	0.00
	合计	742,790.87	2.35

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	东方量化多策略混合 A	0
	东方量化多策略混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	东方量化多策略混合 A	0
	东方量化多策略混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日 (2019年2月22日) 基金份额总额	330,005,184.34	-
本报告期期初基金份 额总额	29,691,168.91	40,013.84
本报告期基金总申购 份额	3,101,770.30	48,889,803.65

减：本报告期基金总赎回份额	3,533,243.73	46,621,892.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,259,695.48	2,307,925.49

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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

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 20,000.00 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 (%)	
浙商证券股份有限公司	2	168,164,804.43	45.14	74,986.24	45.14	-
长江证券股份有限公司	2	107,305,023.57	28.80	47,848.67	28.80	-
金融街证券股份有限公司	2	77,570,630.55	20.82	34,590.17	20.82	-
德邦证券股份有限公司	2	19,492,772.73	5.23	8,692.22	5.23	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
------------	--	--	--	--	--	--

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

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格，能够提供高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

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

（3）本报告期内本基金新增交易单元 6 个，分别为金融街证券股份有限公司、首创证券股份有限公司及国海证券股份有限公司上海、深圳交易单元各一个。

（4）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

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

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	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权

		券 成交总额 的比例 (%)		回购成交总 额的比例 (%)		证 成交总额 的比例 (%)
浙商证 券股份 有限公 司	3,296,295.0 0	78.55	2,900,000.00	29.29	-	-
长江证 券股份 有限公 司	699,593.00	16.67	3,700,000.00	37.37	-	-
金融街 证券股 份有限 公司	200,278.00	4.77	3,000,000.00	30.30	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	300,000.00	3.03	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
太平洋 证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

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	东方量化多策略混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 22 日
2	关于增加海通证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 15 日
3	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 29 日
4	东方量化多策略混合型证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 31 日
5	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
6	关于增加华西证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 2 日
7	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
8	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
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	东方量化多策略混合型证券投资基金	基金管理人网站及中国	2025 年 4 月 22 日

	2025 年第 1 季度报告	证监会基金电子披露网站	
11	关于东方基金管理股份有限公司旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司转换补差费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 13 日
12	东方基金管理股份有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 28 日
13	关于增加中邮证券有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 12 日
14	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
15	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
16	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
17	东方量化多策略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
18	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
19	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

		露网站	
20	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
21	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
22	东方量化多策略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
23	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
24	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
25	关于增加招商银行股份有限公司为东方量化多策略混合型证券投资基金销售机构的公告	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 3 日
26	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
27	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
28	东方量化多策略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 9 月 30 日
29	东方量化多策略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 9 月 30 日
30	关于增加北京济安基金销售有限公司	证券时报、证券日报、	2025 年 10 月 16 日

	为公司旗下部分基金销售机构的公告	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	
31	东方量化多策略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
32	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
33	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
34	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 20 日
35	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
36	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
37	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
38	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
39	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	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2025 年 12 月 24 日

	法的提示性公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
40	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
41	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
42	东方量化多策略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 12 月 31 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超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101 - 20251231	24,732,161.50	0.00	0.00	24,732,161.50	78.35
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、《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方量化多策略混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

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