

东方量化多策略混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方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	32,262,278.26 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	29,999,851.03 份	2,262,427.23 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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com
基金中期报告置备地点	本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
本期已实现收益	4,275,864.71	374,074.21
本期利润	6,814,564.34	540,894.72
加权平均基金份 额本期利润	0.2285	0.2082
本期加权平均净 值利润率	20.66%	18.93%
本期基金份额净 值增长率	23.35%	23.34%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	6,512,061.50	-136,672.91
期末可供分配基 金份额利润	0.2171	-0.0604
期末基金资产净 值	36,511,912.53	2,740,623.25
期末基金份额净 值	1.2171	1.2114
3.1.3 累计期	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

末指标		
基金份额累计净值增长率	21.71%	22.98%

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	19.07%	1.47%	14.83%	1.53%	4.24%	-0.06%
过去六个月	23.35%	1.49%	15.23%	1.54%	8.12%	-0.05%
过去一年	48.37%	1.28%	36.53%	1.31%	11.84%	-0.03%
过去三年	53.58%	1.47%	43.88%	1.54%	9.70%	-0.07%
过去五年	5.28%	1.35%	21.04%	1.35%	-15.76%	0.00%
过去七年	27.61%	1.38%	55.69%	1.27%	-28.08%	0.11%
自基金合同生效起至今	21.71%	1.35%	63.21%	1.27%	-41.50%	0.08%

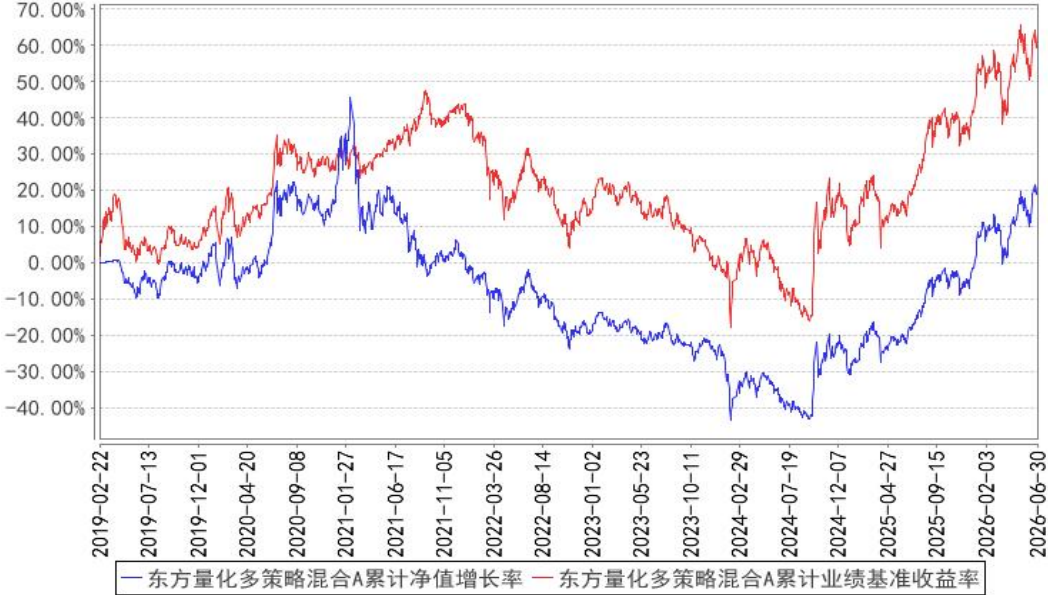
东方量化多策略混合 C

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	19.06%	1.47%	14.83%	1.53%	4.23%	-0.06%
过去六个月	23.34%	1.49%	15.23%	1.54%	8.11%	-0.05%
过去一年	48.36%	1.28%	36.53%	1.31%	11.83%	-0.03%
过去三年	52.94%	1.47%	43.88%	1.54%	9.06%	-0.07%

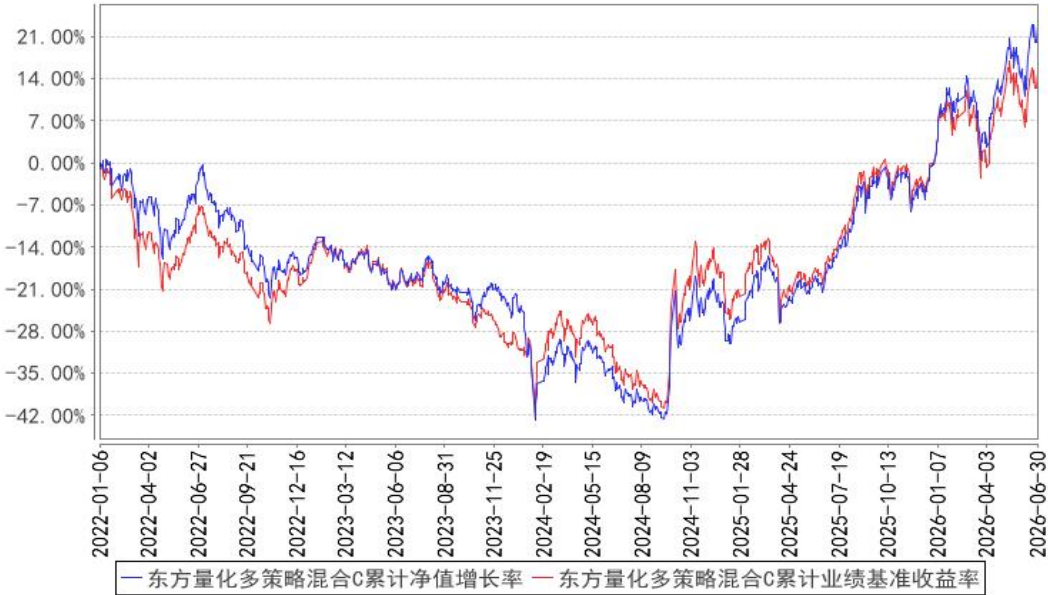
自基金合同 生效起至今	22.98%	1.36%	15.08%	1.41%	7.90%	-0.05%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证

监基金字[2004]80 号”批复，于 2004 年 6 月 11 日成立。

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

截止 2026 年 6 月 30 日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强

型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金、东方招益债券型证券投资基金、东方低碳经济混合型证券投资基金、东方养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金、东方和煦 30 天持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王怀勋	本基金基金经理	2022 年 5 月 17 日	-	11 年	中国人民大学金融专业硕士，11 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

第 10 页 共 67 页

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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，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。

Alpha 端：今年上半年市场风格持续以高 BETA、高成长、低流动性为主要 barra 风格特征，进入二季度后长动量迅速抬头，风格极为鲜明，且风格的持续性较强。从行业表现上也能得到印证，领涨的电子、通信行业本就是过去一两年里的强势行业（动量风格特征），同时也是高成长性、高 beta 的代表行业。总体来讲，上半年风格延续性好，市场波动率大，流动性充分，技术面与基本面互相共振，给量化提供了较好的超额环境，因此本期本基金也获得了一定的正超额收益。

Beta 端：今年以来，从涨幅来看，中证 500>中证 1000>沪深 300>中证 2000，市值风格呈现非线性，中盘表现好于大盘和小盘，本基金对标的中证 1000 指数属于小盘偏中盘，表现尚可。

未来在产品的配置方向上，将延续一直以来的严格纪律，在风格上也仍将继续保持与指数的低偏离，谨慎暴露风格，控制好跟踪误差。在尽可能减少交易成本和风险暴露的情况下，最大化利用好模型给出的信号进行选股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 23.35%，业绩比较基准收益率为 15.23%，高于业绩比较基准 8.12%；本基金 C 类净值增长率为 23.34%，业绩比较基准收益率为 15.23%，高于业绩比较基准 8.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，我国经济运行总体保持平稳，国家统计局数据显示，上半年 GDP 同比增长 4.7%，经济运行处于合理区间。宏观政策持续发力，内需潜力逐步释放，制造业升级、新能源、数字经济等新动能延续较快成长，经济结构继续优化。展望下半年，随着稳增长政策效应进一步显现，市场预期有望温和改善，资本市场或在流动性合理充裕、产业趋势深化的背景下呈现结构性机会。行业方面，科技创新、高端制造、绿色低碳及消费服务等方向仍值得持续关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

1. 委员会主任

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

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

⑤负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

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

4. 合规法务部、风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,457,595.57	652,008.03
结算备付金		11,366.64	90,151.85
存出保证金		5,318.69	15,701.91
交易性金融资产	6.4.7.2	37,466,287.22	30,915,701.49
其中：股票投资		35,243,636.53	29,198,275.35
基金投资		-	-
债券投资		2,222,650.69	1,717,426.14

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,722.04	1,602.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		39,954,290.16	31,675,165.53
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		500,183.69	400,176.40
应付清算款		61.32	150.80
应付赎回款		119,874.03	65,486.84
应付管理人报酬		24,721.46	20,553.74
应付托管费		4,635.26	3,853.82
应付销售服务费		23.84	18.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		63.13	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	52,191.65	46,658.22
负债合计		701,754.38	536,898.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	32,262,278.26	31,567,620.97
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	6,990,257.52	-429,354.07
净资产合计		39,252,535.78	31,138,266.90
负债和净资产总计		39,954,290.16	31,675,165.53

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 32,262,278.26 份，其中东方量化多策略混合 A 基金份额净值 1.2171 元，份额总额 29,999,851.03 份；东方量化多策略混合 C 基金份额净值

1. 2114 元，份额总额 2,262,427.23 份。

6.2 利润表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,528,218.66	3,394,608.91
1. 利息收入		2,790.11	6,343.18
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,790.11	6,343.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		4,807,359.41	2,976,234.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	4,634,806.68	2,735,585.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	15,630.88	9,411.81
资产支持证券投 资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	156,921.85	231,237.20
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,705,520.14	285,636.06
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	12,549.00	126,395.38
减：二、营业总支出		172,759.60	137,899.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	141,862.64	108,836.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,599.23	20,406.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	141.88	220.39

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1, 538. 80	1, 662. 38
其中：卖出回购金融资产支出		1, 538. 80	1, 662. 38
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		37. 42	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	2, 579. 63	6, 774. 20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7, 355, 459. 06	3, 256, 709. 19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7, 355, 459. 06	3, 256, 709. 19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7, 355, 459. 06	3, 256, 709. 19

6.3 净资产变动表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	31, 567, 620. 97	-	-429, 354. 07	31, 138, 266. 90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31, 567, 620. 97	-	-429, 354. 07	31, 138, 266. 90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	694, 657. 29	-	7, 419, 611. 59	8, 114, 268. 88
（一）、综合收益总额	-	-	7, 355, 459. 06	7, 355, 459. 06
（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）	694, 657. 29	-	64, 152. 53	758, 809. 82
其中：1. 基金申	5, 345, 584. 69	-	575, 145. 67	5, 920, 730. 36

购款				
2. 基金赎回款	-4,650,927.40	-	-510,993.14	-5,161,920.54
(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	32,262,278.26	-	6,990,257.52	39,252,535.78
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	5,918,625.05	-	1,442,361.38	7,360,986.43
(一)、综合收益总额	-	-	3,256,709.19	3,256,709.19
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	5,918,625.05	-	-1,814,347.81	4,104,277.24
其中：1. 基金申购款	45,414,537.58	-	-11,264,447.72	34,150,089.86
2. 基金赎回款	-39,495,912.53	-	9,450,099.91	-30,045,812.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	35,649,807.80	-	-6,430,396.27	29,219,411.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏

基金管理人负责人

刘鸿鹏

主管会计工作负责人

王丹丹

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方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）。

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。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款		2,457,595.57
等于：本金		2,457,402.80
加：应计利息		192.77
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		2,457,595.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,693,465.83	-	35,243,636.53	2,550,170.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,200,865.00	21,390.69	2,222,650.69	395.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,200,865.00	21,390.69	2,222,650.69	395.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	34,894,330.83	21,390.69	37,466,287.22	2,550,565.70
----	---------------	-----------	---------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	45.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,146.42
其中：交易所市场	52,146.42
银行间市场	-
应付利息	-
合计	52,191.65

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化多策略混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,259,695.48	29,259,695.48
本期申购	3,107,876.55	3,107,876.55
本期赎回（以“-”号填列）	-2,367,721.00	-2,367,721.00
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	29,999,851.03	29,999,851.03

东方量化多策略混合 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,307,925.49	2,307,925.49
本期申购	2,237,708.14	2,237,708.14
本期赎回（以“-”号填列）	-2,283,206.40	-2,283,206.40
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	2,262,427.23	2,262,427.23

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方量化多策略混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,592,926.72	-3,981,106.69	-388,179.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,592,926.72	-3,981,106.69	-388,179.97
本期利润	4,275,864.71	2,538,699.63	6,814,564.34
本期基金份额交易产生的变动数	117,691.41	-32,014.28	85,677.13
其中：基金申购款	514,688.60	-168,494.56	346,194.04
基金赎回款	-396,997.19	136,480.28	-260,516.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,986,482.84	-1,474,421.34	6,512,061.50

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	-468,751.09	427,576.99	-41,174.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-468,751.09	427,576.99	-41,174.10
本期利润	374,074.21	166,820.51	540,894.72
本期基金份额交易产生的变动数	-41,996.03	20,471.43	-21,524.60

其中：基金申购款	-359,105.46	588,057.09	228,951.63
基金赎回款	317,109.43	-567,585.66	-250,476.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-136,672.91	614,868.93	478,196.02

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,676.19
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	95.77
其他	18.15
合计	2,790.11

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,634,806.68
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	4,634,806.68

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	68,667,923.53
减：卖出股票成本总额	63,929,449.65
减：交易费用	103,667.20
买卖股票差价收入	4,634,806.68

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,243.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	2,387.65

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	15,630.88

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,415,704.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,397,388.35
减：应计利息总额	15,928.54
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	2,387.65

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	156,921.85
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	156,921.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	2,705,520.14
股票投资	2,707,572.79
债券投资	-2,052.65
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	2,705,520.14

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,458.75
基金转换费收入	90.25
合计	12,549.00

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,579.63
合计	2,579.63

注：本报告期，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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	141,862.64	108,836.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,078.69	15,047.61
应支付基金管理人的净管理费	126,783.95	93,788.42

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,599.23	20,406.72

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化多策略混合 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	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化多策略混合 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
合计	-	3.85	3.85

合计	-	3.85	3.85
----	---	------	------

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.01% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 22 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	82.44%	—
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 22 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	83.80%	—

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,457,595.57	2,676.19	755,240.50	5,887.06

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金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 500,183.69 元，于 2026 年 7 月 2 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/或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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风控部门组成的风险管理组织体系，对风险进行管理控制。本基

金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人严密监控基金申购赎回情况，预留充足可用现金头寸与之相匹配。本基金所持资产大部分可在证券交易所或银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告（期末本基金持有的流通受限证券）的列示。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,457,595.57	-	-	-	2,457,595.57
结算备付金	11,366.64	-	-	-	11,366.64
存出保证金	5,318.69	-	-	-	5,318.69
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	35,243,636.53	35,243,636.53
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,222,650.69	-	-	-	2,222,650.69
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	-	-	-	13,722.04	13,722.04
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,696,931.59	-	-	35,257,358.57	39,954,290.16
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	500,183.69	-	-	-	500,183.69
应付清算款	-	-	-	61.32	61.32
应付赎回款	-	-	-	119,874.03	119,874.03
应付管理人报酬	-	-	-	24,721.46	24,721.46
应付托管费	-	-	-	4,635.26	4,635.26
应付销售服务费	-	-	-	23.84	23.84
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	63.13	63.13
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	52,191.65	52,191.65
负债总计	500,183.69	-	-	201,570.69	701,754.38
利率敏感度缺口	4,196,747.90	-	-	35,055,787.88	39,252,535.78
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-1,596.29	-572.29
	市场利率下调 0.25%	1,596.29	572.29

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	35,243,636.53	89.79	29,198,275.35	93.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,222,650.69	5.66	1,717,426.14	5.52
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	37,466,287.22	95.45	30,915,701.49	99.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	2,330,679.21	1,607,792.89
	沪深 300 指数下跌 5%	-2,330,679.21	-1,607,792.89

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	35,243,636.53	29,198,275.35
第二层次	2,222,650.69	1,717,426.14
第三层次	—	—
合计	37,466,287.22	30,915,701.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	35,243,636.53	88.21
	其中：股票	35,243,636.53	88.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,222,650.69	5.56
	其中：债券	2,222,650.69	5.56
	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	2,468,962.21	6.18
8	其他各项资产	19,040.73	0.05
9	合计	39,954,290.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	27,816.60	0.07
B	采矿业	1,082,702.40	2.76
C	制造业	26,597,401.19	67.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	825,961.00	2.10
E	建筑业	315,190.00	0.80
F	批发和零售业	1,034,899.00	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	436,781.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,914,069.01	7.42
J	金融业	248,840.00	0.63
K	房地产业	290,475.00	0.74
L	租赁和商务服务业	293,979.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	722,296.33	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	241,542.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	24,090.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	187,594.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	35,243,636.53	89.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	290	546,940.00	1.39
2	001309	德明利	400	377,160.00	0.96
3	300666	江丰电子	900	331,740.00	0.85
4	600105	永鼎股份	4,600	310,408.00	0.79
5	688630	芯碁微装	516	283,485.24	0.72
6	301526	国际复材	6,000	280,020.00	0.71
7	002484	江海股份	2,600	273,000.00	0.70
8	300475	香农芯创	900	270,000.00	0.69
9	688200	华峰测控	496	260,449.60	0.66
10	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.64
11	603083	剑桥科技	900	229,383.00	0.58
12	688536	思瑞浦	620	225,735.80	0.58
13	300672	国科微	700	206,500.00	0.53
14	300568	星源材质	11,000	205,920.00	0.52
15	300655	晶瑞电材	9,300	199,206.00	0.51
16	000636	风华高科	2,700	195,048.00	0.50
17	688110	东芯股份	957	194,940.90	0.50
18	000895	双汇发展	8,700	194,880.00	0.50
19	002428	云南锗业	1,600	192,288.00	0.49
20	301511	德福科技	1,300	187,005.00	0.48
21	000831	中国稀土	3,300	183,117.00	0.47
22	301029	怡合达	6,700	180,967.00	0.46
23	300429	强力新材	10,000	177,200.00	0.45
24	603087	甘李药业	3,100	175,956.00	0.45
25	300199	翰宇药业	7,900	174,432.00	0.44
26	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.42
27	300260	新莱应材	1,600	160,736.00	0.41
28	300613	富瀚微	2,000	160,160.00	0.41
29	300438	鹏辉能源	1,900	157,415.00	0.40
30	002134	天津普林	5,100	155,142.00	0.40
31	002245	蔚蓝锂芯	8,040	150,428.40	0.38
32	688049	炬芯科技	3,167	148,563.97	0.38

33	300602	飞荣达	2,900	148,480.00	0.38
34	300811	铂科新材	1,540	146,130.60	0.37
35	688652	京仪装备	719	143,922.23	0.37
36	688147	微导纳米	868	140,511.84	0.36
37	600023	浙能电力	26,500	139,390.00	0.36
38	300870	欧陆通	400	138,276.00	0.35
39	300031	宝通科技	4,800	137,136.00	0.35
40	688343	云天励飞	1,673	136,617.18	0.35
41	002993	奥海科技	1,900	136,059.00	0.35
42	000596	古井贡酒	1,700	135,660.00	0.35
43	605376	博迁新材	500	135,650.00	0.35
44	301205	联特科技	400	133,640.00	0.34
45	301091	深城交	8,600	133,300.00	0.34
46	000034	神州数码	4,800	133,200.00	0.34
47	300124	汇川技术	2,000	132,660.00	0.34
48	301396	宏景科技	400	132,640.00	0.34
49	600237	铜峰电子	9,500	132,525.00	0.34
50	600259	中稀有色	1,300	132,093.00	0.34
51	001203	大中矿业	4,400	131,780.00	0.34
52	600060	海信视像	4,700	130,989.00	0.33
53	688432	有研硅	3,270	130,701.90	0.33
54	603588	高能环境	6,800	130,560.00	0.33
55	300416	苏试试验	6,400	130,432.00	0.33
56	688361	中科飞测	301	129,430.00	0.33
57	601888	中国中免	2,400	128,904.00	0.33
58	688187	时代电气	1,876	128,806.16	0.33
59	688518	联赢激光	4,139	127,895.10	0.33
60	301018	申菱环境	1,100	127,171.00	0.32
61	603063	禾望电气	2,400	126,936.00	0.32
62	300726	宏达电子	1,500	126,855.00	0.32
63	000661	长春高新	1,900	126,540.00	0.32
64	688332	中科蓝讯	800	126,000.00	0.32
65	300558	贝达药业	1,900	123,633.00	0.31
66	002304	洋河股份	3,200	122,080.00	0.31
67	688386	泛亚微透	1,358	122,002.72	0.31
68	002487	大金重工	2,100	121,737.00	0.31
69	300910	瑞丰新材	4,300	120,572.00	0.31
70	301307	美利信	1,600	120,464.00	0.31
71	300803	指南针	1,300	119,171.00	0.30
72	003006	百亚股份	7,900	114,629.00	0.29
73	002001	新和成	4,000	113,680.00	0.29
74	301265	华新科技	4,100	112,955.00	0.29
75	688503	聚和材料	848	112,529.60	0.29

76	301568	思泰克	1,000	111,600.00	0.28
77	603270	金帝股份	3,300	110,583.00	0.28
78	300684	中石科技	1,800	109,800.00	0.28
79	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.28
80	600970	中材国际	15,300	109,089.00	0.28
81	002338	奥普光电	1,900	108,680.00	0.28
82	300005	探路者	4,800	108,480.00	0.28
83	300435	中泰股份	4,000	108,280.00	0.28
84	688300	联瑞新材	441	107,780.40	0.27
85	002947	恒铭达	1,400	106,470.00	0.27
86	603256	宏和科技	400	106,132.00	0.27
87	300593	新雷能	3,500	105,210.00	0.27
88	301566	达利凯普	2,800	103,824.00	0.26
89	002119	康强电子	2,600	103,792.00	0.26
90	688331	荣昌生物	794	103,426.44	0.26
91	000922	佳电股份	7,400	103,304.00	0.26
92	688313	仕佳光子	555	102,480.75	0.26
93	301238	瑞泰新材	4,200	102,480.00	0.26
94	300346	南大光电	1,100	101,915.00	0.26
95	300408	三环集团	600	100,140.00	0.26
96	688382	益方生物	5,559	100,062.00	0.25
97	605111	新洁能	1,000	99,140.00	0.25
98	002468	申通快递	6,800	99,008.00	0.25
99	300001	特锐德	2,600	98,358.00	0.25
100	300033	同花顺	400	96,400.00	0.25
101	000301	东方盛虹	8,400	96,180.00	0.25
102	002039	黔源电力	5,100	95,982.00	0.24
103	002497	雅化集团	4,700	95,739.00	0.24
104	002380	科远智慧	2,800	95,704.00	0.24
105	300567	精测电子	300	95,280.00	0.24
106	000887	中鼎股份	5,300	94,817.00	0.24
107	002396	星网锐捷	4,940	94,699.80	0.24
108	688700	东威科技	1,059	94,674.60	0.24
109	300855	图南股份	3,000	93,780.00	0.24
110	603997	继峰股份	7,900	93,457.00	0.24
111	002624	完美世界	7,500	93,150.00	0.24
112	600113	浙江东日	2,800	92,904.00	0.24
113	000975	山金国际	5,400	91,800.00	0.23
114	688351	微电生理	4,037	91,478.42	0.23
115	003022	联泓新科	3,500	90,650.00	0.23
116	688131	皓元医药	954	90,248.40	0.23
117	000408	藏格矿业	1,300	90,116.00	0.23
118	301536	星辰科技	700	90,097.00	0.23

119	300323	华灿光电	4,400	89,760.00	0.23
120	300618	寒锐钴业	2,500	89,250.00	0.23
121	002273	水晶光电	2,500	88,700.00	0.23
122	600993	马应龙	4,100	88,642.00	0.23
123	600489	中金黄金	4,900	88,445.00	0.23
124	301150	中一科技	1,400	88,354.00	0.23
125	300676	华大基因	2,500	87,650.00	0.22
126	300872	天阳科技	5,500	86,900.00	0.22
127	002085	万丰奥威	7,800	86,502.00	0.22
128	301603	乔锋智能	600	86,280.00	0.22
129	301297	富乐德	1,400	85,736.00	0.22
130	600895	张江高科	2,300	85,675.00	0.22
131	605020	永和股份	2,100	85,512.00	0.22
132	301550	斯菱智驱	935	85,487.05	0.22
133	300451	创业慧康	26,700	85,440.00	0.22
134	300206	理邦仪器	6,900	84,387.00	0.21
135	688352	硕中科技	3,461	83,686.98	0.21
136	600188	兖矿能源	4,700	83,519.00	0.21
137	002706	良信股份	7,500	81,825.00	0.21
138	001287	中电港	2,600	80,990.00	0.21
139	300184	力源信息	4,600	80,730.00	0.21
140	002364	中恒电气	1,500	80,700.00	0.21
141	301165	锐捷网络	1,000	80,450.00	0.20
142	300745	欣锐科技	1,900	80,218.00	0.20
143	002536	飞龙股份	1,700	80,206.00	0.20
144	600129	太极集团	5,900	80,063.00	0.20
145	600301	华锡有色	1,300	79,716.00	0.20
146	688050	爱博医疗	2,168	79,023.60	0.20
147	301101	明月镜片	2,900	78,996.00	0.20
148	000719	中原传媒	6,900	78,867.00	0.20
149	002416	爱施德	8,800	78,848.00	0.20
150	600446	金证股份	7,800	78,468.00	0.20
151	301261	恒工精密	1,000	78,100.00	0.20
152	300976	达瑞电子	980	78,057.00	0.20
153	601677	明泰铝业	4,700	78,020.00	0.20
154	301373	凌玮科技	500	77,750.00	0.20
155	300740	水羊股份	4,200	77,322.00	0.20
156	300779	惠城环保	1,540	77,308.00	0.20
157	002913	奥士康	1,200	76,728.00	0.20
158	300413	芒果超媒	5,200	76,076.00	0.19
159	301458	钧崴电子	1,300	75,998.00	0.19
160	002311	海大集团	1,700	75,837.00	0.19
161	001212	中旗新材	1,600	75,808.00	0.19

162	300951	博硕科技	1,500	75,750.00	0.19
163	600511	国药股份	2,900	75,516.00	0.19
164	600418	江淮汽车	2,900	74,907.00	0.19
165	688123	聚辰股份	352	74,835.20	0.19
166	300677	英科医疗	1,900	74,423.00	0.19
167	688387	信科移动	3,737	74,142.08	0.19
168	300398	飞凯材料	1,200	74,100.00	0.19
169	301362	民爆光电	400	73,568.00	0.19
170	300990	同飞股份	700	73,549.00	0.19
171	688629	华丰科技	386	72,378.86	0.18
172	300820	英杰电气	800	72,184.00	0.18
173	300679	电连技术	1,200	71,988.00	0.18
174	688717	艾罗能源	871	71,918.47	0.18
175	001872	招商港口	3,700	71,891.00	0.18
176	603236	移远通信	1,400	71,638.00	0.18
177	000970	中科三环	4,700	71,393.00	0.18
178	301095	广立微	600	70,830.00	0.18
179	605287	德才股份	1,700	70,533.00	0.18
180	600331	宏达股份	6,400	70,336.00	0.18
181	300888	稳健医疗	2,500	69,975.00	0.18
182	301389	隆扬电子	800	69,432.00	0.18
183	000708	中信特钢	5,500	69,410.00	0.18
184	688266	泽璟制药	593	69,179.38	0.18
185	002841	视源股份	2,000	69,060.00	0.18
186	688676	金盘科技	811	68,643.04	0.17
187	300084	海默科技	5,700	68,571.00	0.17
188	300762	上海瀚讯	1,500	68,475.00	0.17
189	300821	东岳硅材	3,300	67,848.00	0.17
190	600570	恒生电子	3,200	67,808.00	0.17
191	601156	东航物流	4,200	67,704.00	0.17
192	300720	海川智能	700	67,340.00	0.17
193	300166	东方国信	3,800	67,298.00	0.17
194	002405	四维图新	10,400	67,288.00	0.17
195	603185	弘元绿能	4,000	66,760.00	0.17
196	300482	万孚生物	4,000	66,440.00	0.17
197	000683	博源化工	11,500	66,240.00	0.17
198	688182	灿勤科技	1,534	66,069.38	0.17
199	000426	兴业银锡	2,000	65,920.00	0.17
200	000933	神火股份	3,100	65,720.00	0.17
201	688499	利元亨	1,241	65,214.55	0.17
202	688800	瑞可达	679	65,163.63	0.17
203	688690	纳微科技	1,473	64,959.30	0.17
204	300229	拓尔思	4,700	64,954.00	0.17

205	000685	中山公用	5,800	64,728.00	0.16
206	688321	微芯生物	2,455	64,640.15	0.16
207	002518	科士达	1,200	64,308.00	0.16
208	301127	武汉天源	3,100	64,232.00	0.16
209	301050	雷电微力	1,900	63,536.00	0.16
210	301306	西测测试	400	63,396.00	0.16
211	300465	高伟达	5,800	63,394.00	0.16
212	001965	招商公路	6,900	63,204.00	0.16
213	002174	游族网络	5,000	63,050.00	0.16
214	300102	乾照光电	2,400	62,496.00	0.16
215	301171	易点天下	1,840	62,486.40	0.16
216	000959	首钢股份	17,800	62,478.00	0.16
217	603876	鼎胜新材	2,400	62,424.00	0.16
218	603259	药明康德	500	62,255.00	0.16
219	300505	川金诺	2,700	61,965.00	0.16
220	002768	国恩股份	1,184	61,639.04	0.16
221	688020	方邦股份	245	61,152.00	0.16
222	002965	祥鑫科技	1,200	61,140.00	0.16
223	300007	汉威科技	1,600	61,120.00	0.16
224	600416	湘电股份	6,200	60,760.00	0.15
225	002150	正泰电源	2,400	60,696.00	0.15
226	002379	宏桥控股	4,100	60,557.00	0.15
227	002929	润建股份	900	60,192.00	0.15
228	603605	珀莱雅	1,000	59,920.00	0.15
229	000905	厦门港务	7,700	59,752.00	0.15
230	300856	科思股份	5,600	59,696.00	0.15
231	605018	长华集团	4,000	59,640.00	0.15
232	301189	奥尼电子	1,000	58,930.00	0.15
233	300687	赛意信息	1,900	58,900.00	0.15
234	600498	烽火通信	800	58,880.00	0.15
235	688433	华曙高科	687	58,807.20	0.15
236	688601	力芯微	966	58,491.30	0.15
237	002895	川恒股份	2,000	58,400.00	0.15
238	002980	华盛昌	500	58,270.00	0.15
239	301312	智立方	500	58,005.00	0.15
240	600027	华电国际	13,000	57,850.00	0.15
241	603663	三祥新材	600	57,780.00	0.15
242	601126	四方股份	900	56,880.00	0.14
243	300957	贝泰妮	1,800	56,718.00	0.14
244	002432	九安医疗	800	56,544.00	0.14
245	603158	腾龙股份	4,600	56,258.00	0.14
246	002891	中宠股份	2,100	56,112.00	0.14
247	300806	斯迪克	500	56,000.00	0.14

248	300579	数字认证	2,700	55,890.00	0.14
249	600988	赤峰黄金	2,100	55,272.00	0.14
250	000032	深桑达 A	2,200	54,890.00	0.14
251	000543	皖能电力	7,200	54,504.00	0.14
252	301479	弘景光电	900	54,180.00	0.14
253	600363	联创光电	1,500	53,670.00	0.14
254	605222	起帆电缆	2,300	53,636.00	0.14
255	001311	多利科技	3,300	53,229.00	0.14
256	688169	石头科技	560	53,183.20	0.14
257	002796	世嘉科技	1,300	53,014.00	0.14
258	688390	固德威	488	52,952.88	0.13
259	000058	深赛格	8,600	52,804.00	0.13
260	300351	永贵电器	3,200	52,800.00	0.13
261	688561	奇安信	2,198	52,708.04	0.13
262	600094	大名城	15,200	52,592.00	0.13
263	300731	科创新源	900	52,524.00	0.13
264	300790	宇瞳光学	2,000	52,220.00	0.13
265	605196	华通线缆	2,000	52,200.00	0.13
266	688090	瑞松科技	490	52,160.50	0.13
267	300170	汉得信息	3,400	51,816.00	0.13
268	300304	云意电气	2,900	51,765.00	0.13
269	603915	国茂股份	3,600	51,084.00	0.13
270	000733	振华科技	900	50,976.00	0.13
271	600595	中孚实业	9,000	50,580.00	0.13
272	300997	欢乐家	3,700	50,135.00	0.13
273	688456	有研粉材	358	49,976.80	0.13
274	688400	凌云光	752	49,782.40	0.13
275	300331	苏大维格	700	49,777.00	0.13
276	300724	捷佳伟创	700	49,420.00	0.13
277	000065	北方国际	5,000	49,150.00	0.13
278	603728	鸣志电器	800	48,736.00	0.12
279	688523	航天环宇	929	48,679.60	0.12
280	600961	株冶集团	1,500	48,585.00	0.12
281	300327	中颖电子	1,500	48,075.00	0.12
282	301510	固高科技	1,500	47,895.00	0.12
283	600596	新安股份	3,000	47,880.00	0.12
284	002946	新乳业	3,400	47,872.00	0.12
285	000837	秦川机床	4,300	47,773.00	0.12
286	002865	钧达股份	800	47,744.00	0.12
287	002832	比音勒芬	2,300	47,472.00	0.12
288	300660	江苏雷利	1,700	47,362.00	0.12
289	688505	复旦张江	6,391	47,165.58	0.12
290	002324	普利特	3,900	47,073.00	0.12

291	600055	万东医疗	4,600	47,012.00	0.12
292	001301	尚太科技	500	46,755.00	0.12
293	002317	众生药业	1,900	46,683.00	0.12
294	300337	银邦股份	4,000	46,640.00	0.12
295	002668	TCL 智家	4,200	46,536.00	0.12
296	601595	上海电影	2,800	46,480.00	0.12
297	600458	时代新材	2,800	46,340.00	0.12
298	603048	浙江黎明	2,600	46,124.00	0.12
299	601330	绿色动力	6,600	46,002.00	0.12
300	301571	国科天成	700	45,626.00	0.12
301	002544	普天科技	2,500	45,550.00	0.12
302	000762	西藏矿业	1,700	45,390.00	0.12
303	605318	法狮龙	400	45,144.00	0.12
304	000810	创维数字	3,400	45,050.00	0.11
305	600064	南京高科	6,300	44,919.00	0.11
306	601107	四川成渝	9,200	44,896.00	0.11
307	688279	峰昭科技	200	44,888.00	0.11
308	002979	雷赛智能	800	44,624.00	0.11
309	301522	上大股份	1,700	44,489.00	0.11
310	300418	昆仑万维	1,100	44,396.00	0.11
311	000935	四川双马	1,700	44,353.00	0.11
312	002249	大洋电机	5,900	44,250.00	0.11
313	600955	维远股份	3,000	44,160.00	0.11
314	605277	新亚电子	2,300	43,838.00	0.11
315	002048	宁波华翔	1,900	43,700.00	0.11
316	000338	潍柴动力	1,600	43,600.00	0.11
317	600728	佳都科技	10,200	43,452.00	0.11
318	300257	开山股份	1,500	43,020.00	0.11
319	000628	高新发展	900	42,660.00	0.11
320	000155	川能动力	3,500	41,930.00	0.11
321	301086	鸿富瀚	200	41,856.00	0.11
322	301035	润丰股份	900	41,760.00	0.11
323	300975	商络电子	800	41,400.00	0.11
323	301382	蜂助手	900	41,400.00	0.11
324	003010	若羽臣	1,700	41,310.00	0.11
325	002738	中矿资源	700	41,293.00	0.11
326	002597	金禾实业	2,100	41,160.00	0.10
327	600452	涪陵电力	4,400	41,052.00	0.10
328	600116	三峡水利	7,300	40,880.00	0.10
329	301323	新莱福	500	40,795.00	0.10
330	300638	广和通	2,200	40,722.00	0.10
331	001286	陕西能源	4,000	40,560.00	0.10
332	600422	昆药集团	5,100	39,831.00	0.10

333	688568	中科星图	960	39,811.20	0.10
334	002643	万润股份	1,900	39,805.00	0.10
335	300085	银之杰	1,137	39,760.89	0.10
336	300378	鼎捷数智	1,100	39,710.00	0.10
337	002056	横店东磁	1,300	39,624.00	0.10
338	300777	中简科技	1,500	39,420.00	0.10
339	300134	大富科技	4,600	39,330.00	0.10
340	601225	陕西煤业	1,924	39,153.40	0.10
341	002389	航天彩虹	2,200	39,094.00	0.10
342	300693	盛弘股份	800	39,000.00	0.10
343	300483	首华燃气	2,200	38,676.00	0.10
344	600827	百联股份	5,200	38,532.00	0.10
345	002265	建设工业	2,200	38,280.00	0.10
346	300322	硕贝德	1,500	37,800.00	0.10
347	300723	一品红	1,000	37,280.00	0.09
347	600201	生物股份	3,200	37,280.00	0.09
348	600649	城投控股	10,800	37,260.00	0.09
349	002537	海联金汇	7,000	37,030.00	0.09
350	601609	金田股份	3,400	36,720.00	0.09
351	301021	英诺激光	300	36,570.00	0.09
352	002541	鸿路钢构	2,100	36,372.00	0.09
353	301085	亚康股份	600	36,366.00	0.09
354	600556	天下秀	8,200	36,244.00	0.09
355	603010	万盛股份	2,000	36,240.00	0.09
356	000801	四川九洲	2,800	36,232.00	0.09
357	002997	瑞鹄模具	1,300	35,828.00	0.09
358	003019	宸展光电	1,100	35,805.00	0.09
359	002192	融捷股份	400	35,760.00	0.09
360	300363	博腾股份	2,200	35,728.00	0.09
361	600323	瀚蓝环境	1,300	35,698.00	0.09
362	002326	永太科技	1,500	35,475.00	0.09
363	300589	江龙船艇	3,000	35,400.00	0.09
364	000029	深深房 A	1,600	35,280.00	0.09
365	301016	雷尔伟	2,520	35,204.40	0.09
366	600529	山东药玻	1,900	35,055.00	0.09
367	301630	同宇新材	140	35,022.40	0.09
368	688380	中微半导	531	34,998.21	0.09
369	301246	宏源药业	1,300	34,970.00	0.09
370	600066	宇通客车	1,300	34,853.00	0.09
371	600773	西藏城投	2,700	34,749.00	0.09
372	603737	三棵树	1,440	34,704.00	0.09
373	000950	重药控股	6,700	33,567.00	0.09
374	688102	斯瑞新材	706	33,309.08	0.08

375	002532	天山铝业	3,100	33,263.00	0.08
376	600750	华润江中	1,500	33,105.00	0.08
377	688636	智明达	911	33,005.53	0.08
378	002320	海峡股份	5,200	32,604.00	0.08
379	300328	宜安科技	2,300	32,292.00	0.08
380	688381	帝奥微	600	32,100.00	0.08
381	300415	伊之密	1,600	31,856.00	0.08
382	300274	阳光电源	200	31,804.00	0.08
383	600151	航天机电	2,800	31,416.00	0.08
384	601918	新集能源	3,600	30,924.00	0.08
385	002670	国盛证券	2,800	30,800.00	0.08
386	300772	运达股份	2,500	30,750.00	0.08
387	600428	中远海特	3,900	30,459.00	0.08
388	600739	辽宁成大	3,000	30,330.00	0.08
389	603279	景津装备	2,500	30,000.00	0.08
390	000593	德龙汇能	1,400	29,932.00	0.08
391	300409	道氏技术	1,500	29,895.00	0.08
392	600903	贵州燃气	4,500	29,880.00	0.08
393	603078	江化微	600	29,652.00	0.08
394	300959	线上线下	200	29,562.00	0.08
395	688116	天奈科技	766	29,261.20	0.07
396	300529	健帆生物	1,900	29,260.00	0.07
397	301529	福赛科技	300	28,908.00	0.07
398	000422	湖北宜化	2,000	28,100.00	0.07
399	603171	税友股份	700	27,895.00	0.07
400	603118	共进股份	2,300	27,853.00	0.07
401	002458	益生股份	3,580	27,816.60	0.07
402	300545	联得装备	600	27,720.00	0.07
403	002626	金达威	2,100	27,678.00	0.07
404	600409	三友化工	4,500	27,495.00	0.07
405	002020	京新药业	2,200	27,478.00	0.07
406	000967	盈峰环境	2,600	27,378.00	0.07
407	600216	浙江医药	2,400	27,360.00	0.07
408	002378	章源钨业	800	26,784.00	0.07
409	600348	华阳股份	3,500	26,775.00	0.07
410	301031	中熔电气	224	26,756.80	0.07
411	688698	伟创电气	507	26,592.15	0.07
412	002943	宇晶股份	600	26,538.00	0.07
413	688170	德龙激光	274	26,306.74	0.07
414	002276	万马股份	2,600	26,286.00	0.07
415	600651	飞乐音响	4,700	26,273.00	0.07
416	002091	江苏国泰	3,600	26,028.00	0.07
417	600328	中盐化工	4,300	25,800.00	0.07

418	002064	华峰化学	2,700	25,623.00	0.07
419	688777	中控技术	217	25,497.50	0.06
420	300634	彩讯股份	1,300	25,441.00	0.06
421	603119	浙江荣泰	380	25,209.20	0.06
422	001260	坤泰股份	1,600	25,040.00	0.06
423	000060	中金岭南	3,300	24,981.00	0.06
424	688586	江航装备	2,132	24,923.08	0.06
425	301109	军信股份	2,000	24,920.00	0.06
426	002539	云图控股	2,200	24,904.00	0.06
427	301517	陕西华达	500	24,815.00	0.06
428	301153	中科江南	1,500	24,435.00	0.06
429	002043	兔宝宝	2,200	24,376.00	0.06
430	301123	奕东电子	200	24,144.00	0.06
431	301293	三博脑科	500	24,090.00	0.06
432	300179	四方达	400	23,772.00	0.06
433	601678	滨化股份	3,600	23,724.00	0.06
434	603267	鸿远电子	300	23,244.00	0.06
435	688126	沪硅产业	580	23,136.20	0.06
436	600459	贵研铂业	800	23,104.00	0.06
437	000938	紫光股份	800	23,088.00	0.06
438	000623	吉林敖东	1,300	23,049.00	0.06
439	002025	航天电器	300	22,866.00	0.06
440	002139	拓邦股份	2,400	22,848.00	0.06
441	300682	朗新科技	2,300	22,770.00	0.06
442	301365	矩阵股份	600	22,746.00	0.06
443	301191	菲菱科思	200	22,710.00	0.06
444	002534	西子洁能	1,200	22,260.00	0.06
445	688512	慧智微	1,391	22,214.27	0.06
446	002075	沙钢股份	6,500	22,100.00	0.06
447	601069	西部黄金	1,000	22,000.00	0.06
448	300401	花园生物	1,000	21,890.00	0.06
449	600629	华建集团	1,800	21,798.00	0.06
450	000555	神州信息	2,100	21,630.00	0.06
451	300443	金雷股份	1,000	21,580.00	0.05
452	300827	上能电气	700	21,553.00	0.05
453	300455	航天智装	1,000	21,540.00	0.05
454	300080	易成新能	5,700	21,432.00	0.05
455	600633	浙数文化	2,100	21,378.00	0.05
456	688516	奥特维	371	21,291.69	0.05
457	300617	安靠智电	400	21,196.00	0.05
458	601001	晋控煤业	1,200	20,868.00	0.05
459	600971	恒源煤电	3,000	20,700.00	0.05
460	000589	贵州轮胎	5,000	20,300.00	0.05

461	600559	老白干酒	1,800	20,160.00	0.05
462	688653	康希通信	1,120	19,465.60	0.05
463	002434	万里扬	3,200	19,360.00	0.05
464	002443	金洲管道	2,000	19,060.00	0.05
465	688757	胜科纳米	284	18,942.80	0.05
466	600814	杭州解百	3,100	18,910.00	0.05
467	002204	大连重工	3,500	18,480.00	0.05
468	688035	德邦科技	200	18,360.00	0.05
469	002203	海亮股份	800	18,280.00	0.05
470	688707	振华新材	1,417	18,208.45	0.05
471	002307	北新路桥	6,300	18,144.00	0.05
472	600284	浦东建设	3,700	17,982.00	0.05
473	600963	岳阳林纸	5,800	17,632.00	0.04
474	301219	腾远钴业	320	17,536.00	0.04
475	300918	南山智尚	1,600	17,152.00	0.04
476	600100	同方股份	2,500	17,125.00	0.04
477	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.04
478	300291	百纳千成	3,500	16,905.00	0.04
479	601801	皖新传媒	3,400	16,762.00	0.04
480	600817	宇通重工	1,900	16,720.00	0.04
481	688556	高测股份	1,256	16,679.68	0.04
482	300277	汽轮科技	1,100	16,544.00	0.04
483	301363	美好医疗	900	16,497.00	0.04
484	301196	唯科科技	130	16,304.60	0.04
485	301338	凯格精机	100	16,289.00	0.04
486	603897	长城科技	500	16,230.00	0.04
487	301292	海科新源	200	15,946.00	0.04
488	301607	富特科技	300	15,675.00	0.04
489	600872	中炬高新	900	15,624.00	0.04
490	600859	王府井	1,700	15,606.00	0.04
491	600640	国脉文化	1,600	15,472.00	0.04
492	300766	每日互动	700	14,980.00	0.04
493	002730	电光科技	500	14,955.00	0.04
494	688103	国力电子	200	14,882.00	0.04
495	300819	聚杰微纤	200	14,804.00	0.04
496	002127	南极电商	5,400	14,796.00	0.04
497	002272	川润股份	600	14,718.00	0.04
498	002121	科陆电子	2,700	14,715.00	0.04
499	601619	嘉泽新能	3,400	14,620.00	0.04
500	300286	安科瑞	600	14,490.00	0.04
501	301327	华宝新能	300	14,421.00	0.04
502	301328	维峰电子	200	14,240.00	0.04
503	300128	锦富技术	2,400	14,208.00	0.04

504	601882	海天精工	700	14,161.00	0.04
505	600020	中原高速	3,800	14,022.00	0.04
506	603936	博敏电子	500	13,355.00	0.03
507	300516	久之洋	400	13,104.00	0.03
508	301155	海力风电	300	12,870.00	0.03
509	600714	金瑞矿业	600	12,318.00	0.03
510	688371	菲沃泰	306	11,930.94	0.03
511	300009	安科生物	1,500	11,775.00	0.03
512	002063	远光软件	2,300	11,730.00	0.03
513	300348	长亮科技	1,300	11,440.00	0.03
514	688658	悦康药业	878	11,291.08	0.03
515	688552	航天南湖	400	11,252.00	0.03
516	601949	中国出版	2,400	11,160.00	0.03
517	600035	楚天高速	3,300	11,121.00	0.03
518	920493	并行科技	100	11,066.00	0.03
519	688408	中信博	339	10,898.85	0.03
520	600557	康缘药业	900	10,593.00	0.03
521	300045	华力创通	600	10,344.00	0.03
522	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.03
523	601311	骆驼股份	1,300	10,127.00	0.03
524	600158	中体产业	1,500	10,110.00	0.03
525	002406	远东传动	1,500	9,840.00	0.03
526	002511	中顺洁柔	1,400	9,310.00	0.02
527	300319	麦捷科技	300	8,889.00	0.02
528	000519	中兵红箭	400	8,428.00	0.02
529	603678	火炬电子	100	8,300.00	0.02
530	000921	海信家电	300	8,196.00	0.02
531	002678	珠江钢琴	1,900	8,037.00	0.02
532	002465	海格通信	600	7,662.00	0.02
533	600572	康恩贝	1,900	7,448.00	0.02
534	600757	长江传媒	1,000	7,310.00	0.02
535	600449	宁夏建材	600	6,708.00	0.02
536	000877	天山股份	1,600	5,808.00	0.01
537	688315	诺禾致源	463	5,792.13	0.01
538	601606	长城军工	200	5,498.00	0.01
539	300406	九强生物	500	5,465.00	0.01
540	002507	涪陵榨菜	500	5,400.00	0.01
541	600123	兰花科创	1,000	5,340.00	0.01
542	300320	海达股份	500	4,770.00	0.01
543	000869	张裕 A	300	4,674.00	0.01
544	600138	中青旅	700	4,571.00	0.01
545	688349	三一重能	300	4,554.00	0.01
546	601827	三峰环境	600	4,362.00	0.01

547	002078	太阳纸业	300	3,747.00	0.01
548	300138	晨光生物	400	3,600.00	0.01
549	002327	富安娜	600	3,564.00	0.01
550	688232	新点软件	200	3,556.00	0.01
551	002216	三全食品	300	3,459.00	0.01
552	002423	中粮资本	300	2,469.00	0.01
553	600335	国机汽车	500	2,340.00	0.01
554	603393	新天然气	100	2,141.00	0.01
555	001308	康冠科技	100	2,086.00	0.01
556	600959	江苏有线	700	2,023.00	0.01
557	000498	山东路桥	400	1,892.00	0.00
558	605050	福然德	200	1,872.00	0.00
559	002399	海普瑞	100	898.00	0.00
560	002302	西部建设	200	864.00	0.00
561	601952	苏垦农发	100	749.00	0.00
562	002454	松芝股份	140	669.20	0.00
563	002376	新北洋	100	575.00	0.00
564	603111	康尼机电	100	566.00	0.00
565	002206	海利得	100	517.00	0.00
566	002274	华昌化工	100	463.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	002317	众生药业	502,943.00	1.62
2	001309	德明利	443,138.00	1.42
3	300184	力源信息	307,587.00	0.99
4	000034	神州数码	304,459.00	0.98
5	000543	皖能电力	303,046.00	0.97
6	301377	鼎泰高科	283,952.00	0.91
7	002149	西部材料	266,484.00	0.86
8	603087	甘李药业	255,263.00	0.82
9	601606	长城军工	254,719.00	0.82
10	000596	古井贡酒	254,088.00	0.82
11	002484	江海股份	250,761.00	0.81
12	300726	宏达电子	243,878.00	0.78
13	003022	联泓新科	237,442.00	0.76
14	002304	洋河股份	237,345.00	0.76
15	300820	英杰电气	229,172.00	0.74
16	600489	中金黄金	226,824.00	0.73
17	603638	艾迪精密	225,194.00	0.72
18	301078	孩子王	222,156.00	0.71

19	301018	申菱环境	221,696.00	0.71
20	300085	银之杰	220,458.21	0.71

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

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002317	众生药业	472,348.00	1.52
2	300352	ST 信源	437,472.00	1.40
3	688146	中船特气	342,849.87	1.10
4	002149	西部材料	342,286.00	1.10
5	001203	大中矿业	338,706.00	1.09
6	300184	力源信息	315,266.00	1.01
7	002222	福晶科技	303,151.00	0.97
8	300672	国科微	299,922.00	0.96
9	000629	钒钛股份	283,855.00	0.91
10	600869	远东股份	279,254.00	0.90
11	600645	中源协和	277,932.00	0.89
12	002151	北斗星通	275,884.38	0.89
13	688390	固德威	268,741.29	0.86
14	688498	源杰科技	267,852.00	0.86
15	002859	洁美科技	265,522.00	0.85
16	002484	江海股份	257,542.00	0.83
17	000811	冰轮环境	252,690.00	0.81
18	002378	章源钨业	251,356.00	0.81
19	603005	晶方科技	248,788.00	0.80
20	301217	铜冠铜箔	242,892.00	0.78

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	67,267,238.04
卖出股票收入（成交）总额	68,667,923.53

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

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

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，

不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,222,650.69	5.66
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	2,222,650.69	5.66

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	16,000	1,616,787.73	4.12
2	019785	25 国债 13	4,000	405,050.19	1.03
3	019827	26 国债 01	1,000	100,648.19	0.26
4	019835	26 国债 09	1,000	100,164.58	0.26

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,318.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,722.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,040.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东方量化多策略混合 A	728	41,208.59	24,732,161.50	82.44	5,267,689.53	17.56
东方量化多策略混	121	18,697.75	0.00	0.00	2,262,427.23	100.00

合 C						
合计	849	38,000.33	24,732,161.50	76.66	7,530,116.76	23.34

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	80.30

8.3 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	114,627.35	0.38
	东方量化多策略混合 C	0.00	0.00
	合计	114,627.35	0.36

8.4 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	0~10
	东方量化多策略混合 C	0
	合计	0~10
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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日 （2019 年 2 月 22 日） 基金份额总额	330,005,184.34	—
本报告期期初基金份 额总额	29,259,695.48	2,307,925.49
本报告期基金总申购 份额	3,107,876.55	2,237,708.14
减：本报告期基金总 赎回份额	2,367,721.00	2,283,206.40
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份	29,999,851.03	2,262,427.23

额总额		
-----	--	--

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券股份有限公司	2	106,805,739.34	78.57	47,624.76	78.58	-
长江证券股份有限公司	3	16,935,563.76	12.46	7,543.35	12.45	-
国海证券股份有限公司	2	10,435,085.16	7.68	4,653.03	7.68	-
金融街证券股份有限公司	2	1,758,773.31	1.29	784.12	1.29	-
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	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资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格，能够提供高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

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

（3）本报告期内本基金新增交易单元 7 个，分别为国信证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、东北证券股份有限公司上海、深圳交易单元各一个及长江证券股份有限公司北交所交易单元一个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)				的比例 (%)
兴业证 券股份 有限公 司	200,002.00	6.06	1,000,000.00	38.46	-	-
长江证 券股份 有限公 司	100,070.00	3.03	1,200,000.00	46.15	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
金融街 证券股 份有限 公司	3,000,345.00	90.91	400,000.00	15.38	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 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	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

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

	的公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 9 日
11	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 17 日
12	关于增加东莞证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 19 日
13	东方基金管理股份有限公司关于董事长离任及代行董事长职务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 20 日
14	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 21 日
15	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 21 日
16	关于增加招商银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 26 日
17	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 27 日
18	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	2026 年 3 月 31 日

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

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260101 - 20260630	24,732,161.50	0.00	0.00	24,732,161.50	76.66
产品特有风险							
基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。 (1) 当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。 (2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司
2026 年 8 月 31 日