

东方量化多策略混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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，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 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
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	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方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	30,132,787.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方量化多策略混合 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	30,100,974.93 份	31,812.35 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。

注：本基金从 2024 年 1 月 24 日起变更业绩比较基准，相关公告已于 2024 年 1 月 23 日在中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》和本公司网站上进行披露。

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 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100073	100031
法定代表人	崔伟	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金中期报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 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	-3,233,900.99	-16,002.99
本期利润	-4,455,660.08	-29,710.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1480	-0.4135
本期加权平均净值利润率	-22.01%	-61.54%
本期基金份额净值增长率	-19.28%	-19.29%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-11,451,473.61	-17,079.57
期末可供分配基金份额利润	-0.3804	-0.5369
期末基金资产净	18,649,501.32	19,616.98

值		
期末基金份额净值	0.6196	0.6166
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-38.04%	-37.40%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化多策略混合 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
过去一个月	-7.47%	1.22%	-8.15%	1.36%	0.68%	-0.14%
过去三个月	-8.03%	1.35%	-9.51%	1.42%	1.48%	-0.07%
过去六个月	-19.28%	1.69%	-8.67%	1.78%	-10.61%	-0.09%
过去一年	-21.82%	1.33%	-17.96%	1.37%	-3.86%	-0.04%
过去三年	-46.41%	1.20%	-30.99%	1.15%	-15.42%	0.05%
自基金合同生效起至今	-38.04%	1.28%	-6.94%	1.12%	-31.10%	0.16%

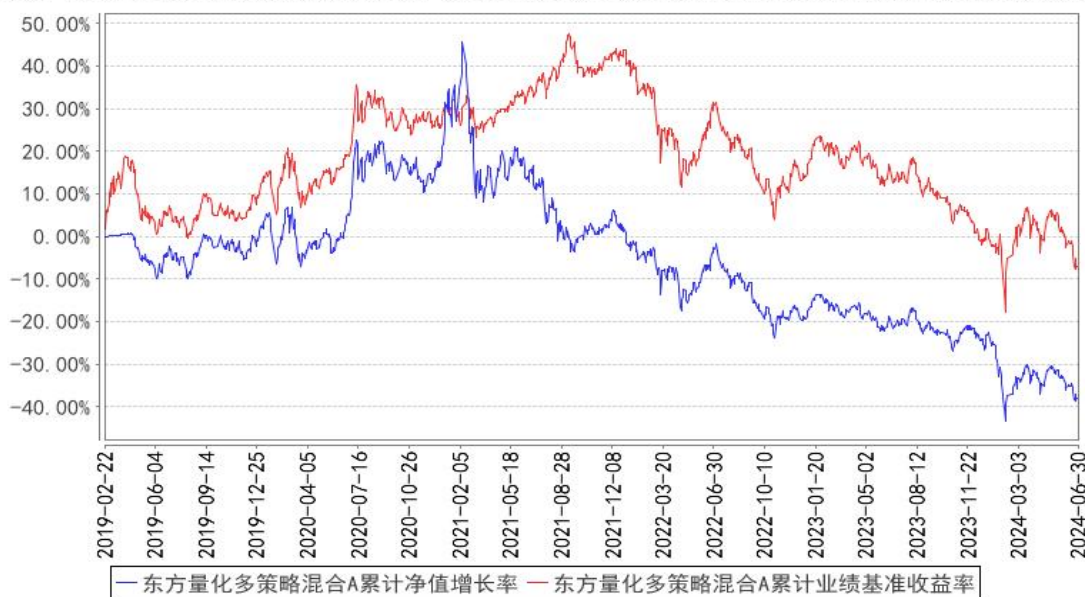
东方量化多策略混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.49%	1.22%	-8.15%	1.36%	0.66%	-0.14%

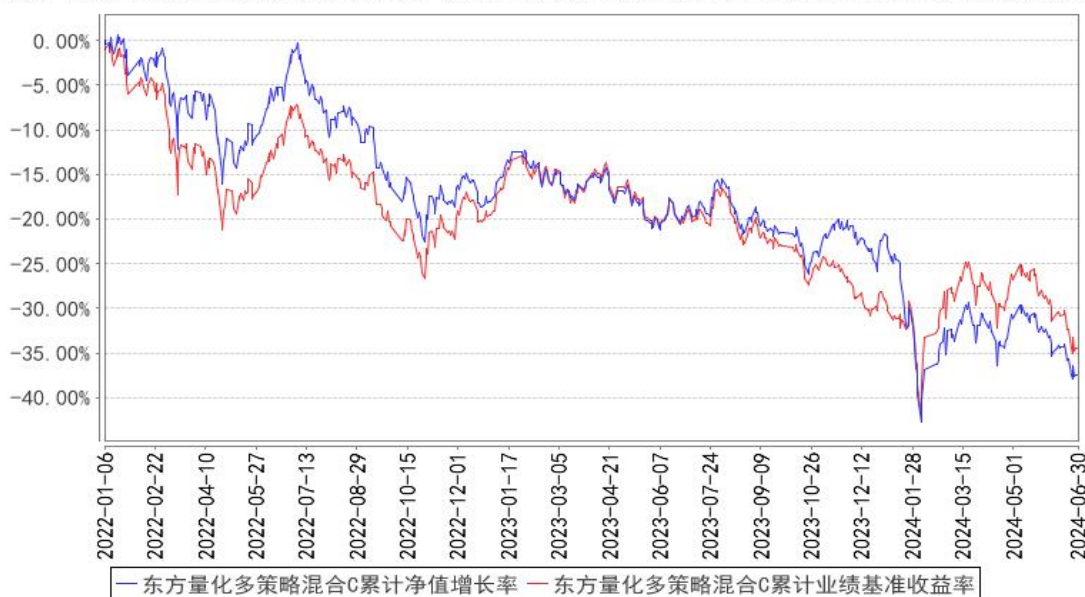
过去三个月	-8.05%	1.35%	-9.51%	1.42%	1.46%	-0.07%
过去六个月	-19.29%	1.69%	-8.67%	1.78%	-10.62%	-0.09%
过去一年	-22.16%	1.33%	-17.96%	1.37%	-4.20%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-37.40%	1.19%	-34.38%	1.22%	-3.02%	-0.03%

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2024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2024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、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方

恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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。

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		
盛泽	本基金基金经理、量化投资部总经理、资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员	2019 年 2 月 22 日	-	9 年	量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，9 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，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，现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合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、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。
王怀勋	本基金基金经理	2022 年 5 月 17 日	-	9 年	中国人民大学金融专业硕士，9 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。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况

进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金继续以小微市值股票为主要投资方向，以中高频调仓的多因子选股策略为主要投资策略。

今年 1 季度，小市值因子经历了大幅的回撤，ALPHA 因子表现呈现大起大落的形态，1 季度产品相对于基准的超额收益也波动较大。进入 2 季度，市场整体处于逐步修复的过程中，部分因子表现开始逐渐从之前的大回撤中修复、爬升，甚至突破新高，但很快由于投资者对小微股票退市风险的担忧，市场又引入了新的扰动，导致因子表现再度出现一定波动。

虽然本基金在 2 季度最终仍超越业绩比较基准，但目前因子表现仍未恢复到正常水平，加上当前市场成交低迷造成的冲击成本放大，我们认为后续还需继续保持相对谨慎保守的操作思路，力争保持超额收益的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-19.28%，业绩比较基准收益率为-8.67%，低于业绩比较基准 10.61%；本基金 C 类净值增长率为-19.29%，业绩比较基准收益率为-8.67%，低于业绩比较基准 10.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总的来说，2024 年上半年中国宏观经济展现出了韧性和活力。5.0% 的 GDP 增长率在全球经济背景下是一个相对强劲的表现。新动能的崛起、服务消费的增长以及制造业投资的支撑作用是上半年经济亮点。然而，增速放缓的趋势也值得关注，可能需要进一步的财政、货币政策以及加强创新等措施来维持经济的稳定增长。这虽然面临一些挑战，但我们对经济前景保持信心。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

1. 委员会主任

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

2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

(5) 负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

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

4. 合规法务部、风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值

（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,278,120.03	397,894.21
结算备付金		191,532.46	348,163.83
存出保证金		18,282.23	31,686.29
交易性金融资产	6.4.7.2	17,316,397.51	23,067,861.17
其中：股票投资		16,197,134.03	21,742,757.61
基金投资		-	-
债券投资		1,119,263.48	1,325,103.56
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		213,361.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,002.51	2,184.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,022,695.91	23,847,790.23
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		226,212.76	293,464.07
应付赎回款		-	3,972.63

应付管理人报酬		12,712.41	15,670.17
应付托管费		2,383.58	2,938.16
应付销售服务费		0.30	0.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	112,268.56	352,002.81
负债合计		353,577.61	668,048.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	30,132,787.28	30,198,046.83
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	-11,463,668.98	-7,018,305.06
净资产合计		18,669,118.30	23,179,741.77
负债和净资产总计		19,022,695.91	23,847,790.23

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，东方量化多策略混合 A 基金份额净值 0.6196 元，基金份额总额 30,100,974.93 份；东方量化多策略混合 C 基金份额净值 0.6166 元，基金份额总额 31,812.35 份。东方量化多策略混合份额总额合计 30,132,787.28 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,344,095.71	-1,288,611.16
1. 利息收入		4,619.85	15,530.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	4,619.85	15,530.51
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）		-3,115,033.37	-8,010,772.14
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-3,346,470.57	-9,590,223.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	13,504.59	48,688.91
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
投资收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	217,932.61	1,530,762.31
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	-1,235,466.60	6,692,661.53
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	1,784.41	13,968.94
减：二、营业总支出		141,274.87	604,188.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	80,524.39	427,743.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,098.33	80,201.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2.77	3,711.50
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	45,649.38	92,531.58
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-4,485,370.58	-1,892,799.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-4,485,370.58	-1,892,799.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,485,370.58	-1,892,799.79

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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,198,046.83	-	-7,018,305.06	23,179,741.77

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,198,046.83	-	-7,018,305.06	23,179,741.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-65,259.55	-	-4,445,363.92	-4,510,623.47
(一)、综合收益总额	-	-	-4,485,370.58	-4,485,370.58
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-65,259.55	-	40,006.66	-25,252.89
其中：1. 基金申购款	668,218.84	-	-220,052.35	448,166.49
2. 基金赎回款	-733,478.39	-	260,059.01	-473,419.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	30,132,787.28	-	-11,463,668.98	18,669,118.30
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	151,592,240.01	-	-29,222,668.42	122,369,571.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	151,592,240.01	-	-29,222,668.42	122,369,571.59

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	29,685,669.99	-	-8,451,011.89	21,234,658.10
(一)、综合收益总额	-	-	-1,892,799.79	-1,892,799.79
(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)	29,685,669.99	-	-6,558,212.10	23,127,457.89
其中：1. 基金申购款	154,431,724.18	-	-25,858,448.86	128,573,275.32
2. 基金赎回款	-124,746,054.19	-	19,300,236.76	-105,445,817.43
(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	181,277,910.00	-	-37,673,680.31	143,604,229.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方量化多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 7 月 10 日中国证监会《关于准予东方量化多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1093 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 1 月 7 日至 2019 年 2 月 15 日公开募集设立。

本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 329,903,665.65 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2019]第 01210017 号”验资报告验证。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、分离交易的可转换债券）、银行存款、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税

的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(2) 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。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(4) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算

缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,278,120.03
等于：本金	1,277,893.41
加：应计利息	226.62
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	1,278,120.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	17,869,354.65	-	16,197,134.03	-1,672,220.62	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,101,943.55	16,533.48	1,119,263.48	786.45
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,101,943.55	16,533.48	1,119,263.48	786.45
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	18,971,298.20	16,533.48	17,316,397.51	-1,671,434.17	

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	78,799.81
其中：交易所市场	78,799.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	33,468.75
合计	112,268.56

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,086,567.35	30,086,567.35
本期申购	241,965.41	241,965.41
本期赎回（以“-”号填列）	-227,557.83	-227,557.83
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	30,100,974.93	30,100,974.93

东方量化多策略混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	111,479.48	111,479.48
本期申购	426,253.43	426,253.43
本期赎回 (以“-”号填列)	-505,920.56	-505,920.56
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	31,812.35	31,812.35

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	-3,157,432.44	-3,834,559.62	-6,991,992.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,157,432.44	-3,834,559.62	-6,991,992.06
本期利润	-3,233,900.99	-1,221,759.09	-4,455,660.08
本期基金份额交易产生的变动数	-4,953.46	1,131.99	-3,821.47
其中：基金申购款	-50,755.57	-28,965.08	-79,720.65
基金赎回款	45,802.11	30,097.07	75,899.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,396,286.89	-5,055,186.72	-11,451,473.61

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	-47,920.33	21,607.33	-26,313.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-47,920.33	21,607.33	-26,313.00
本期利润	-16,002.99	-13,707.51	-29,710.50
本期基金份额交易产生的变动数	46,843.75	-3,015.62	43,828.13
其中：基金申购款	-220,172.67	79,840.97	-140,331.70
基金赎回款	267,016.42	-82,856.59	184,159.83
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-17,079.57	4,884.20	-12,195.37
-----	------------	----------	------------

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		3,116.34
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,262.78
其他		240.73
合计		4,619.85

注：其他为结算保证金利息收入。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-3,346,470.57
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		-3,346,470.57

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		96,201,265.03
减：卖出股票成本总额		99,308,808.25
减：交易费用		238,927.35
买卖股票差价收入		-3,346,470.57

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		13,212.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		292.55
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	13,504.59

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,427,418.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,399,957.45
减：应计利息总额	27,168.31
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	292.55

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	217,932.61
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	217,932.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,235,466.60
股票投资	-1,235,694.05

债券投资	227.45
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,235,466.60

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	967.55
基金转换费收入	816.86
合计	1,784.41

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	9,562.00
信息披露费	23,906.75
证券出借违约金	-
银行费用	3,180.63
账户维护费	9,000.00
合计	45,649.38

注：自2024年6月24日起，本基金审计费用、信息披露费用由本基金管理人承担。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、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

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	80,524.39	427,743.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,101.10	16,419.85
应支付基金管理人的净管理费	74,423.29	411,323.76

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,098.33	80,201.94

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	3,330.83	3,330.83
合计	-	3,330.83	3,330.83

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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	0.00	-
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	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
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	82.16%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	0.00	-
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	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
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	13.64%	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,278,120.03	3,116.34	4,700,765.66	12,669.46

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2024 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024 年 5 月 6 日	重大事项停牌	12.35	-	-	1,300	22,669.00	16,055.00	-

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 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风控部门组成的风险管理组织体系，对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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。

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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，除在本报告（期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。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 2024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	1,278,120.03	-	-	-	1,278,120.03
结算备付金	191,532.46	-	-	-	191,532.46
存出保证金	18,282.23	-	-	-	18,282.23
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	16,197,134.03	16,197,134.03
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,119,263.48	-	-	-	1,119,263.48
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	-	-	-	213,361.17	213,361.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,002.51	5,002.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,607,198.20	-	-	16,415,497.71	19,022,695.91

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	226,212.76	226,212.76
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	12,712.41	12,712.41
应付托管费	-	-	-	2,383.58	2,383.58
应付销售服务费	-	-	-	0.30	0.30
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	-	-	-	112,268.56	112,268.56
负债总计	-	-	-	353,577.61	353,577.61
利率敏感度缺口	2,607,198.20	-	-	16,061,920.10	18,669,118.30
上年度末 2023 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	397,894.21	-	-	-	397,894.21
结算备付金	348,163.83	-	-	-	348,163.83
存出保证金	31,686.29	-	-	-	31,686.29
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	21,742,757.61	21,742,757.61
交易性金融资产-债券投资	1,325,103.56	-	-	-	1,325,103.56
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	-	-	-	2,184.73	2,184.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,102,847.89	-	-	21,744,942.34	23,847,790.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	293,464.07	293,464.07
应付赎回款	-	-	-	3,972.63	3,972.63

应付管理人报酬	-	-	-	15,670.17	15,670.17
应付托管费	-	-	-	2,938.16	2,938.16
应付销售服务费	-	-	-	0.62	0.62
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	-	-	-	352,002.81	352,002.81
负债总计	-	-	-	668,048.46	668,048.46
利率敏感度缺口	2,102,847.89	-	-	21,076,893.88	23,179,741.77

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-972.23	-265.38
	市场利率下调 0.25%	972.23	265.38

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	16,197,134.03	86.76	21,742,757.61	93.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,119,263.48	6.00	1,325,103.56	5.72
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	17,316,397.51	92.75	23,067,861.17	99.52

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(2024 年 6 月 30 日)	上年度末(2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上涨 5%	1,325,818.12	982,690.83
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,325,818.12	-982,690.83

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	16,181,079.03	21,440,566.24
第二层次	1,135,318.48	1,325,103.56
第三层次	-	302,191.37
合计	17,316,397.51	23,067,861.17

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	16,197,134.03	85.15
	其中：股票	16,197,134.03	85.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,119,263.48	5.88
	其中：债券	1,119,263.48	5.88
	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	1,469,652.49	7.73
8	其他各项资产	236,645.91	1.24
9	合计	19,022,695.91	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	169,840.00	0.91
B	采矿业	303,016.00	1.62
C	制造业	10,757,709.55	57.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	621,609.00	3.33
E	建筑业	296,354.00	1.59
F	批发和零售业	285,907.00	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	170,321.40	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,727,895.94	9.26
J	金融业	752,141.00	4.03
K	房地产业	56,777.00	0.30
L	租赁和商务服务业	212,008.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	241,322.14	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	422,527.00	2.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,524.00	0.05
Q	卫生和社会工作	13,958.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	157,224.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	16,197,134.03	86.76

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	002449	国星光电	46,800	333,216.00	1.78
2	601222	林洋能源	52,100	326,667.00	1.75
3	300595	欧普康视	20,200	316,736.00	1.70
4	601108	财通证券	47,700	315,297.00	1.69
5	002500	山西证券	66,100	310,670.00	1.66
6	002065	东华软件	67,800	306,456.00	1.64
7	300070	碧水源	64,600	270,674.00	1.45
8	000591	太阳能	53,400	251,514.00	1.35
9	600967	内蒙一机	34,800	250,560.00	1.34
10	000810	创维数字	25,500	218,790.00	1.17
11	002372	伟星新材	13,400	206,628.00	1.11
12	300679	电连技术	4,800	193,104.00	1.03
13	002461	珠江啤酒	26,000	192,920.00	1.03
14	002346	柘中股份	25,300	192,786.00	1.03
15	603689	皖天然气	22,200	182,484.00	0.98
16	600057	厦门象屿	26,000	176,800.00	0.95
17	688596	正帆科技	5,186	171,138.00	0.92
18	000811	冰轮环境	17,400	167,910.00	0.90
19	000156	华数传媒	23,100	145,068.00	0.78
20	600699	均胜电子	9,400	139,308.00	0.75
21	002573	清新环境	35,700	138,159.00	0.74
22	300384	三联虹普	10,300	135,136.00	0.72
23	002405	四维图新	21,000	130,620.00	0.70
24	603299	苏盐井神	13,600	129,200.00	0.69
25	000960	锡业股份	8,100	125,469.00	0.67
26	600664	哈药股份	46,700	123,288.00	0.66
27	001323	慕思股份	4,100	117,957.00	0.63
28	605589	圣泉集团	5,700	115,653.00	0.62
29	000998	隆平高科	11,600	114,028.00	0.61
30	300002	神州泰岳	13,800	112,056.00	0.60
31	688401	路维光电	4,139	108,441.80	0.58
32	300024	机器人	11,000	107,140.00	0.57
33	300476	胜宏科技	3,300	106,458.00	0.57
34	600966	博汇纸业	22,200	106,116.00	0.57
35	688595	芯海科技	3,457	103,710.00	0.56
36	002061	浙江交科	28,200	102,930.00	0.55
37	300558	贝达药业	3,100	100,905.00	0.54

38	002414	高德红外	16,700	98,363.00	0.53
39	002746	仙坛股份	16,400	93,972.00	0.50
40	601700	风范股份	20,700	90,873.00	0.49
41	688380	中微半导	5,311	88,799.92	0.48
42	000878	云南铜业	7,000	87,220.00	0.47
43	600497	驰宏锌锗	16,000	85,440.00	0.46
44	600846	同济科技	12,400	84,692.00	0.45
45	002011	盾安环境	8,400	82,572.00	0.44
46	002380	科远智慧	4,500	82,350.00	0.44
47	002838	道恩股份	8,900	80,634.00	0.43
48	002064	华峰化学	11,200	80,304.00	0.43
49	300363	博腾股份	6,700	80,065.00	0.43
50	300142	沃森生物	7,000	79,660.00	0.43
51	688327	云从科技	6,891	77,937.21	0.42
52	002913	奥士康	2,900	77,749.00	0.42
53	002797	第一创业	14,900	75,841.00	0.41
54	003031	中瓷电子	1,640	75,833.60	0.41
55	300378	鼎捷软件	4,500	73,215.00	0.39
56	002158	汉钟精机	4,200	70,224.00	0.38
57	300298	三诺生物	2,700	68,418.00	0.37
58	600125	铁龙物流	11,100	66,267.00	0.35
59	300224	正海磁材	7,100	65,746.00	0.35
60	000719	中原传媒	6,500	65,715.00	0.35
61	300573	兴齐眼药	400	65,600.00	0.35
62	002498	汉缆股份	19,600	64,484.00	0.35
63	002126	银轮股份	3,700	64,417.00	0.35
64	688336	三生国健	3,149	64,082.15	0.34
65	002568	百润股份	3,800	63,954.00	0.34
66	002941	新疆交建	6,200	61,876.00	0.33
67	000852	石化机械	10,900	58,424.00	0.31
68	002456	欧菲光	7,400	57,794.00	0.31
69	300792	壹网壹创	3,800	57,190.00	0.31
70	002063	远光软件	10,800	56,592.00	0.30
71	000883	湖北能源	9,300	55,893.00	0.30
72	300382	斯莱克	9,400	55,554.00	0.30
73	000528	柳工	4,900	54,831.00	0.29
74	600602	云赛智联	4,900	54,096.00	0.29
75	600366	宁波韵升	10,300	53,766.00	0.29
76	603466	风语筑	6,200	52,948.00	0.28
77	603328	依顿电子	6,700	52,662.00	0.28
78	002130	沃尔核材	3,600	50,832.00	0.27
79	002925	盈趣科技	4,000	50,680.00	0.27
80	002519	银河电子	10,300	50,573.00	0.27

81	300082	奥克股份	11,800	50,268.00	0.27
82	002169	智光电气	11,200	49,392.00	0.26
83	002472	双环传动	2,200	48,444.00	0.26
84	002340	格林美	7,500	47,775.00	0.26
85	002276	万马股份	6,500	46,605.00	0.25
86	600531	豫光金铅	7,200	46,368.00	0.25
87	601975	招商南油	12,900	46,311.00	0.25
88	603339	四方科技	5,000	45,350.00	0.24
89	002396	星网锐捷	3,400	44,914.00	0.24
90	600351	亚宝药业	8,000	44,880.00	0.24
91	002006	精工科技	3,300	44,286.00	0.24
92	600963	岳阳林纸	11,800	43,306.00	0.23
93	002648	卫星化学	2,400	43,152.00	0.23
94	688017	绿的谐波	522	42,856.20	0.23
95	600201	生物股份	5,900	42,539.00	0.23
96	000818	航锦科技	1,900	41,952.00	0.22
97	600458	时代新材	4,100	41,410.00	0.22
98	300327	中颖电子	2,100	41,328.00	0.22
99	300315	掌趣科技	9,900	41,283.00	0.22
100	300136	信维通信	2,100	41,118.00	0.22
101	600742	一汽富维	5,500	40,975.00	0.22
102	601311	骆驼股份	5,100	40,902.00	0.22
103	600446	金证股份	4,100	40,713.00	0.22
104	000598	兴蓉环境	5,400	40,608.00	0.22
105	600271	航天信息	5,500	40,480.00	0.22
106	002312	川发龙蟒	6,000	40,380.00	0.22
107	002697	红旗连锁	8,300	38,429.00	0.21
108	002282	博深股份	6,000	38,340.00	0.21
109	000688	国城矿业	4,000	38,080.00	0.20
110	002048	宁波华翔	2,900	37,526.00	0.20
111	002436	兴森科技	3,600	37,152.00	0.20
112	688128	中国电研	2,155	37,087.55	0.20
113	603087	甘李药业	800	37,056.00	0.20
114	600875	东方电气	2,000	36,900.00	0.20
115	002254	泰和新材	4,100	36,285.00	0.19
116	600529	山东药玻	1,400	35,476.00	0.19
117	600976	健民集团	700	35,350.00	0.19
118	002004	华邦健康	9,300	35,340.00	0.19
119	688088	虹软科技	1,216	35,093.76	0.19
120	300048	合康新能	7,500	34,725.00	0.19
121	002444	巨星科技	1,400	34,580.00	0.19
122	600058	五矿发展	5,200	34,320.00	0.18
123	002469	三维化学	6,000	34,200.00	0.18

124	000825	太钢不锈	10,000	33,800.00	0.18
125	300765	新诺威	1,300	32,799.00	0.18
126	688209	英集芯	2,630	32,638.30	0.17
127	000550	江铃汽车	1,500	32,565.00	0.17
128	601069	西部黄金	2,800	32,564.00	0.17
129	601216	君正集团	8,800	32,472.00	0.17
130	601877	正泰电器	1,700	32,402.00	0.17
131	002407	多氟多	2,600	31,798.00	0.17
132	688578	艾力斯	491	31,296.34	0.17
133	688116	天奈科技	1,345	31,042.60	0.17
134	000541	佛山照明	6,300	30,681.00	0.16
135	300775	三角防务	1,000	30,600.00	0.16
136	300653	正海生物	1,500	30,525.00	0.16
137	601369	陕鼓动力	3,800	30,476.00	0.16
138	002736	国信证券	3,500	30,415.00	0.16
139	601918	新集能源	3,100	30,225.00	0.16
140	300109	新开源	2,550	29,529.00	0.16
141	688126	沪硅产业	2,083	28,766.23	0.15
142	002283	天润工业	6,700	28,743.00	0.15
143	300346	南大光电	1,000	28,590.00	0.15
144	002093	国脉科技	4,700	28,529.00	0.15
145	301308	江波龙	300	28,422.00	0.15
146	002429	兆驰股份	5,900	28,379.00	0.15
147	688001	华兴源创	1,252	28,270.16	0.15
148	603993	洛阳钼业	3,300	28,050.00	0.15
149	300428	立中集团	1,500	27,885.00	0.15
150	603181	皇马科技	3,100	27,869.00	0.15
151	600371	万向德农	4,000	27,680.00	0.15
152	002563	森马服饰	4,700	27,307.00	0.15
153	601117	中国化学	3,300	27,192.00	0.15
154	300258	精锻科技	3,300	26,829.00	0.14
155	000707	双环科技	3,900	26,676.00	0.14
156	002446	盛路通信	4,700	26,555.00	0.14
157	300672	国科微	500	26,420.00	0.14
158	688321	微芯生物	1,498	26,364.80	0.14
159	300910	瑞丰新材	600	26,232.00	0.14
160	003035	南网能源	5,800	25,520.00	0.14
161	600583	海油工程	4,300	25,413.00	0.14
162	002409	雅克科技	400	25,164.00	0.13
163	300413	芒果超媒	1,200	25,080.00	0.13
164	300121	阳谷华泰	3,200	24,960.00	0.13
165	000597	东北制药	6,400	24,768.00	0.13
166	688213	思特威	508	24,638.00	0.13

167	002030	达安基因	4,800	24,000.00	0.13
168	688575	亚辉龙	1,019	23,763.08	0.13
169	688166	博瑞医药	676	23,660.00	0.13
170	603556	海兴电力	500	23,415.00	0.13
171	002244	滨江集团	3,200	23,232.00	0.12
172	688003	天准科技	701	22,964.76	0.12
173	300818	耐普矿机	900	22,950.00	0.12
174	002595	豪迈科技	600	22,902.00	0.12
175	688002	睿创微纳	813	22,739.61	0.12
176	002406	远东传动	4,600	22,678.00	0.12
177	002099	海翔药业	4,400	22,484.00	0.12
178	000019	深粮控股	3,900	22,386.00	0.12
179	002649	博彦科技	2,800	22,288.00	0.12
180	002577	雷柏科技	1,800	22,266.00	0.12
181	002643	万润股份	2,200	22,000.00	0.12
182	603000	人民网	1,100	21,989.00	0.12
183	002543	万和电气	2,200	21,912.00	0.12
184	688268	华特气体	423	21,831.03	0.12
185	001301	尚太科技	500	21,610.00	0.12
186	688339	亿华通	719	21,555.62	0.12
187	000157	中联重科	2,800	21,504.00	0.12
188	000060	中金岭南	5,000	21,200.00	0.11
189	000021	深科技	1,400	21,168.00	0.11
190	002101	广东鸿图	2,000	21,060.00	0.11
191	000537	中绿电	2,200	20,966.00	0.11
192	600739	辽宁成大	2,500	20,925.00	0.11
193	300475	香农芯创	700	20,699.00	0.11
194	300339	润和软件	1,000	20,670.00	0.11
195	301177	迪阿股份	1,100	20,460.00	0.11
196	301366	一博科技	600	20,424.00	0.11
197	002516	旷达科技	5,600	20,384.00	0.11
198	603583	捷昌驱动	1,000	20,380.00	0.11
199	688198	佰仁医疗	200	20,298.00	0.11
200	000630	铜陵有色	5,600	20,216.00	0.11
201	603063	禾望电气	1,300	19,929.00	0.11
202	000966	长源电力	4,500	19,845.00	0.11
203	300286	安科瑞	900	19,476.00	0.10
204	002088	鲁阳节能	1,600	19,344.00	0.10
205	603983	丸美股份	700	19,271.00	0.10
206	600141	兴发集团	1,000	19,080.00	0.10
207	002262	恩华药业	800	18,992.00	0.10
208	603033	三维股份	1,600	18,720.00	0.10
209	002544	普天科技	1,000	18,690.00	0.10

210	000917	电广传媒	3,700	18,685.00	0.10
211	600055	万东医疗	1,500	18,525.00	0.10
212	600895	张江高科	1,000	18,480.00	0.10
213	000657	中钨高新	2,000	18,280.00	0.10
214	603055	台华新材	1,800	18,234.00	0.10
215	300068	南都电源	2,200	18,216.00	0.10
216	002851	麦格米特	700	18,088.00	0.10
217	301047	义翘神州	300	17,985.00	0.10
218	300171	东富龙	1,500	17,835.00	0.10
219	600100	同方股份	3,500	17,815.00	0.10
220	688037	芯源微	200	17,800.00	0.10
221	002344	海宁皮城	5,800	17,748.00	0.10
222	600867	通化东宝	2,100	17,577.00	0.09
223	300342	天银机电	1,200	17,556.00	0.09
224	000967	盈峰环境	4,100	17,343.00	0.09
225	300735	光弘科技	800	17,280.00	0.09
226	603477	巨星农牧	600	17,220.00	0.09
227	600123	兰花科创	1,900	17,005.00	0.09
228	000062	深圳华强	1,900	16,910.00	0.09
229	603301	振德医疗	800	16,688.00	0.09
230	600428	中远海特	2,700	16,524.00	0.09
231	301031	中熔电气	200	16,440.00	0.09
232	688289	圣湘生物	931	16,366.98	0.09
233	301382	蜂助手	900	16,281.00	0.09
234	300615	欣天科技	1,700	16,269.00	0.09
235	600395	盘江股份	2,700	16,227.00	0.09
236	000921	海信家电	500	16,120.00	0.09
237	300229	拓尔思	1,200	16,116.00	0.09
238	603728	鸣志电器	400	16,092.00	0.09
239	300630	普利制药	1,300	16,055.00	0.09
240	000403	派林生物	600	15,996.00	0.09
241	002332	仙琚制药	1,400	15,974.00	0.09
242	688318	财富趋势	200	15,782.00	0.08
243	000422	湖北宜化	1,300	15,496.00	0.08
244	600079	人福医药	900	15,453.00	0.08
245	300196	长海股份	1,500	15,195.00	0.08
246	300232	洲明科技	2,900	15,138.00	0.08
247	688180	君实生物	520	15,106.00	0.08
248	002727	一心堂	1,000	15,090.00	0.08
249	601001	晋控煤业	900	14,868.00	0.08
250	300101	振芯科技	1,000	14,770.00	0.08
251	000950	重药控股	3,000	14,610.00	0.08
252	300347	泰格医药	300	14,580.00	0.08

253	301050	雷电微力	300	14,448.00	0.08
254	300702	天宇股份	800	14,264.00	0.08
255	603129	春风动力	100	14,234.00	0.08
256	002393	力生制药	900	14,229.00	0.08
257	601121	宝地矿业	2,500	14,225.00	0.08
258	002408	齐翔腾达	2,500	14,000.00	0.07
259	002318	久立特材	600	13,998.00	0.07
260	000555	神州信息	1,500	13,980.00	0.07
261	002928	华夏航空	2,200	13,948.00	0.07
262	603348	文灿股份	500	13,845.00	0.07
263	300723	一品红	700	13,755.00	0.07
264	002317	众生药业	1,200	13,716.00	0.07
265	300447	全信股份	1,100	13,618.00	0.07
266	300790	宇瞳光学	1,000	13,500.00	0.07
267	301217	铜冠铜箔	1,400	13,440.00	0.07
267	600986	浙文互联	3,200	13,440.00	0.07
268	300725	药石科技	500	13,385.00	0.07
269	000404	长虹华意	2,500	13,325.00	0.07
270	600657	信达地产	4,300	13,115.00	0.07
271	000551	创元科技	1,500	13,095.00	0.07
272	000930	中粮科技	2,600	13,078.00	0.07
273	300997	欢乐家	1,100	13,002.00	0.07
274	300432	富临精工	2,000	12,880.00	0.07
274	601015	陕西黑猫	4,600	12,880.00	0.07
275	000539	粤电力 A	2,500	12,700.00	0.07
276	300236	上海新阳	400	12,456.00	0.07
277	003012	东鹏控股	2,000	12,220.00	0.07
278	688308	欧科亿	625	12,137.50	0.07
279	002724	海洋王	2,700	12,015.00	0.06
280	000801	四川九洲	1,200	12,000.00	0.06
281	002466	天齐锂业	400	11,964.00	0.06
282	300820	英杰电气	300	11,802.00	0.06
283	000822	山东海化	2,000	11,660.00	0.06
284	000795	英洛华	2,100	11,634.00	0.06
285	600378	昊华科技	400	11,560.00	0.06
286	000034	神州数码	500	11,445.00	0.06
287	000751	锌业股份	4,300	11,266.00	0.06
288	601799	星宇股份	100	11,204.00	0.06
289	002164	宁波东力	2,900	11,136.00	0.06
290	000969	安泰科技	1,400	11,102.00	0.06
291	688035	德邦科技	342	11,019.24	0.06
292	600363	联创光电	400	11,008.00	0.06
293	600557	康缘药业	700	10,990.00	0.06

294	003022	联泓新科	800	10,968.00	0.06
295	300079	数码视讯	2,700	10,962.00	0.06
296	002299	圣农发展	800	10,912.00	0.06
297	688266	泽璟制药	200	10,844.00	0.06
298	002236	大华股份	700	10,822.00	0.06
299	002354	天娱数科	3,600	10,764.00	0.06
300	300777	中简科技	500	10,750.00	0.06
301	688432	有研硅	1,103	10,688.07	0.06
302	601137	博威合金	700	10,668.00	0.06
303	003816	中国广核	2,300	10,649.00	0.06
304	300624	万兴科技	200	10,614.00	0.06
305	600633	浙数文化	1,200	10,572.00	0.06
306	301197	工大科雅	800	10,496.00	0.06
307	688676	金盘科技	200	10,430.00	0.06
308	000990	诚志股份	1,400	10,416.00	0.06
309	300193	佳士科技	1,400	10,388.00	0.06
310	300075	数字政通	700	10,325.00	0.06
311	600111	北方稀土	600	10,320.00	0.06
312	688232	新点软件	522	10,293.84	0.06
313	002952	亚世光电	500	10,275.00	0.06
314	600398	海澜之家	1,100	10,164.00	0.05
315	688378	奥来德	433	10,158.18	0.05
316	300738	奥飞数据	1,000	10,120.00	0.05
317	601028	玉龙股份	800	10,000.00	0.05
318	300343	联创股份	2,100	9,996.00	0.05
319	603871	嘉友国际	560	9,906.40	0.05
320	601595	上海电影	500	9,890.00	0.05
321	603237	五芳斋	400	9,864.00	0.05
322	300482	万孚生物	400	9,760.00	0.05
323	300687	赛意信息	700	9,744.00	0.05
324	001380	华纬科技	500	9,720.00	0.05
324	300303	聚飞光电	2,000	9,720.00	0.05
325	688333	铂力特	200	9,690.00	0.05
326	603986	兆易创新	100	9,562.00	0.05
327	300456	赛微电子	600	9,522.00	0.05
328	300253	卫宁健康	1,600	9,440.00	0.05
329	600339	中油工程	3,000	9,360.00	0.05
330	601100	恒立液压	200	9,316.00	0.05
331	688559	海目星	283	9,307.87	0.05
332	002950	奥美医疗	1,400	9,240.00	0.05
333	001286	陕西能源	800	9,224.00	0.05
334	300443	金雷股份	600	9,198.00	0.05
335	300203	聚光科技	900	9,081.00	0.05

336	002527	新时达	1,500	8,985.00	0.05
337	300827	上能电气	400	8,944.00	0.05
338	600155	华创云信	1,500	8,865.00	0.05
339	301162	国能日新	200	8,712.00	0.05
340	688238	和元生物	1,878	8,695.14	0.05
341	002837	英维克	400	8,556.00	0.05
342	605098	行动教育	200	8,524.00	0.05
343	002540	亚太科技	1,600	8,464.00	0.05
344	002880	卫光生物	300	8,406.00	0.05
345	002020	京新药业	800	8,376.00	0.04
346	000733	振华科技	200	8,306.00	0.04
347	002873	新天药业	1,000	8,300.00	0.04
348	301267	华夏眼科	400	8,288.00	0.04
349	603568	伟明环保	400	8,232.00	0.04
350	002605	姚记科技	400	8,168.00	0.04
351	300146	汤臣倍健	600	8,130.00	0.04
352	688720	艾森股份	200	8,108.00	0.04
353	600757	长江传媒	1,000	8,060.00	0.04
354	688661	和林微纳	260	7,969.00	0.04
355	300034	钢研高纳	500	7,945.00	0.04
356	000987	越秀资本	1,600	7,936.00	0.04
357	300633	开立医疗	200	7,916.00	0.04
358	301090	华润材料	1,200	7,896.00	0.04
358	603920	世运电路	400	7,896.00	0.04
359	688590	新致软件	612	7,894.80	0.04
360	688677	海泰新光	200	7,846.00	0.04
361	300188	国投智能	700	7,777.00	0.04
362	002292	奥飞娱乐	1,300	7,774.00	0.04
363	002324	普利特	900	7,695.00	0.04
364	688700	东威科技	293	7,679.53	0.04
365	601921	浙版传媒	1,000	7,640.00	0.04
366	002075	沙钢股份	2,000	7,540.00	0.04
367	002545	东方铁塔	1,100	7,491.00	0.04
368	300389	艾比森	600	7,368.00	0.04
369	000900	现代投资	2,000	7,320.00	0.04
370	600133	东湖高新	700	7,308.00	0.04
371	002400	省广集团	1,500	7,275.00	0.04
372	603737	三棵树	200	7,254.00	0.04
373	600422	昆药集团	400	7,132.00	0.04
374	300866	安克创新	100	7,121.00	0.04
375	688376	美埃科技	226	7,087.36	0.04
376	603733	仙鹤股份	400	7,032.00	0.04
377	000779	甘咨询	1,000	7,010.00	0.04

378	002303	美盈森	2,900	6,989.00	0.04
379	000488	晨鸣纸业	2,000	6,920.00	0.04
380	300663	科蓝软件	700	6,909.00	0.04
381	002378	章源钨业	1,200	6,888.00	0.04
382	601116	三江购物	900	6,849.00	0.04
383	688048	长光华芯	219	6,841.56	0.04
384	002174	游族网络	900	6,831.00	0.04
385	000088	盐田港	1,500	6,795.00	0.04
386	688262	国芯科技	367	6,683.07	0.04
387	300770	新媒股份	200	6,676.00	0.04
388	603392	万泰生物	100	6,588.00	0.04
389	300783	三只松鼠	300	6,561.00	0.04
390	301069	凯盛新材	500	6,555.00	0.04
391	300441	鲍斯股份	1,100	6,523.00	0.03
392	300963	中洲特材	600	6,456.00	0.03
393	300856	科思股份	200	6,402.00	0.03
394	600566	济川药业	200	6,342.00	0.03
395	000913	钱江摩托	400	6,304.00	0.03
396	301205	联特科技	100	6,275.00	0.03
397	688362	甬矽电子	320	6,227.20	0.03
398	603308	应流股份	500	6,210.00	0.03
399	002675	东诚药业	500	6,130.00	0.03
400	300396	迪瑞医疗	300	6,093.00	0.03
401	002983	芯瑞达	360	5,994.00	0.03
402	688110	东芯股份	314	5,987.98	0.03
403	688316	青云科技	200	5,982.00	0.03
404	688567	孚能科技	623	5,980.80	0.03
405	300593	新雷能	600	5,964.00	0.03
406	688322	奥比中光	223	5,956.33	0.03
407	600449	宁夏建材	500	5,875.00	0.03
408	300655	晶瑞电材	800	5,760.00	0.03
409	300316	晶盛机电	200	5,746.00	0.03
410	002044	美年健康	1,500	5,670.00	0.03
411	300973	立高食品	200	5,618.00	0.03
412	301365	矩阵股份	500	5,495.00	0.03
413	000059	华锦股份	1,300	5,447.00	0.03
414	300596	利安隆	200	5,426.00	0.03
415	300677	英科医疗	200	5,362.00	0.03
416	000061	农产品	1,100	5,346.00	0.03
417	002294	信立泰	200	5,326.00	0.03
418	000543	皖能电力	600	5,310.00	0.03
419	300261	雅本化学	1,000	5,300.00	0.03
420	300685	艾德生物	300	5,292.00	0.03

421	300618	寒锐钴业	200	5,290.00	0.03
422	000862	银星能源	1,100	5,247.00	0.03
423	300869	康泰医学	400	5,228.00	0.03
424	688619	罗普特	742	5,216.26	0.03
425	688202	美迪西	200	5,210.00	0.03
426	601609	金田股份	900	5,094.00	0.03
427	000420	吉林化纤	1,600	5,056.00	0.03
428	300180	华峰超纤	1,400	4,942.00	0.03
429	000030	富奥股份	1,000	4,910.00	0.03
430	300662	科锐国际	300	4,839.00	0.03
431	300151	昌红科技	300	4,746.00	0.03
432	002737	葵花药业	200	4,676.00	0.03
433	301273	瑞晨环保	300	4,671.00	0.03
434	600655	豫园股份	900	4,635.00	0.02
435	301026	浩通科技	200	4,592.00	0.02
436	300429	强力新材	400	4,544.00	0.02
437	300602	飞荣达	300	4,533.00	0.02
438	301035	润丰股份	100	4,454.00	0.02
439	300587	天铁股份	1,100	4,444.00	0.02
440	301171	易点天下	300	4,410.00	0.02
441	600810	神马股份	700	4,340.00	0.02
442	301421	波长光电	100	4,323.00	0.02
443	688410	山外山	200	4,260.00	0.02
444	300251	光线传媒	500	4,205.00	0.02
445	300531	优博讯	400	4,168.00	0.02
446	002264	新华都	800	4,088.00	0.02
447	301313	凡拓数创	200	4,070.00	0.02
448	301029	怡合达	200	3,932.00	0.02
449	603298	杭叉集团	200	3,928.00	0.02
450	301033	迈普医学	100	3,911.00	0.02
451	002034	旺能环境	300	3,903.00	0.02
452	600312	平高电气	200	3,890.00	0.02
453	000561	烽火电子	600	3,846.00	0.02
454	300291	百纳千成	900	3,834.00	0.02
454	300453	三鑫医疗	600	3,834.00	0.02
455	300964	本川智能	100	3,750.00	0.02
456	300497	富祥药业	400	3,572.00	0.02
457	600740	山西焦化	900	3,528.00	0.02
458	002353	杰瑞股份	100	3,508.00	0.02
459	301080	百普赛斯	100	3,500.00	0.02
460	002835	同为股份	200	3,378.00	0.02
461	300913	兆龙互连	100	3,322.00	0.02
462	688051	佳华科技	200	3,316.00	0.02

463	300570	太辰光	100	3,266.00	0.02
464	301326	捷邦科技	100	3,254.00	0.02
465	603069	海汽集团	200	3,250.00	0.02
466	300331	苏大维格	200	3,216.00	0.02
467	301338	凯格精机	100	3,213.00	0.02
468	600775	南京熊猫	400	3,200.00	0.02
469	300211	亿通科技	600	3,174.00	0.02
470	601009	南京银行	300	3,117.00	0.02
471	301248	杰创智能	200	3,014.00	0.02
472	000032	深桑达 A	200	2,996.00	0.02
473	301118	恒光股份	200	2,982.00	0.02
474	688329	艾隆科技	200	2,972.00	0.02
475	301089	拓新药业	100	2,967.00	0.02
476	002145	中核钛白	900	2,952.00	0.02
477	301316	慧博云通	200	2,936.00	0.02
478	301188	力诺特玻	200	2,914.00	0.02
479	300905	宝丽迪	100	2,841.00	0.02
480	301041	金百泽	100	2,820.00	0.02
481	300908	仲景食品	100	2,778.00	0.01
482	300605	恒锋信息	300	2,718.00	0.01
483	300664	鹏鹞环保	600	2,670.00	0.01
483	600720	中交设计	300	2,670.00	0.01
484	603678	火炬电子	100	2,469.00	0.01
485	300989	蕾奥规划	200	2,446.00	0.01
486	300505	川金诺	200	2,438.00	0.01
487	300085	银之杰	300	2,424.00	0.01
488	688227	品高股份	200	2,422.00	0.01
489	002984	森麒麟	100	2,409.00	0.01
490	002967	广电计量	200	2,360.00	0.01
491	301281	科源制药	100	2,245.00	0.01
492	002156	通富微电	100	2,239.00	0.01
493	301216	万凯新材	200	2,238.00	0.01
494	600509	天富能源	400	2,204.00	0.01
495	002462	嘉事堂	200	2,188.00	0.01
495	300697	电工合金	200	2,188.00	0.01
496	603355	莱克电气	100	2,160.00	0.01
497	002402	和而泰	200	2,142.00	0.01
498	300314	戴维医疗	200	2,068.00	0.01
499	301052	果麦文化	100	2,050.00	0.01
500	301212	联盛化学	100	2,048.00	0.01
501	603005	晶方科技	100	2,038.00	0.01
502	600782	新钢股份	600	1,992.00	0.01
503	601798	蓝科高新	400	1,980.00	0.01

504	300766	每日互动	200	1,978.00	0.01
505	600325	华发股份	300	1,950.00	0.01
506	600438	通威股份	100	1,911.00	0.01
507	300900	广联航空	100	1,873.00	0.01
508	002895	川恒股份	100	1,831.00	0.01
509	600559	老白干酒	100	1,818.00	0.01
510	300246	宝莱特	300	1,815.00	0.01
511	301126	达嘉维康	200	1,806.00	0.01
512	301059	金三江	200	1,782.00	0.01
513	301148	嘉戎技术	100	1,770.00	0.01
514	301500	飞南资源	100	1,745.00	0.01
515	300921	南凌科技	100	1,732.00	0.01
516	300206	理邦仪器	200	1,718.00	0.01
517	600320	振华重工	500	1,710.00	0.01
518	300654	世纪天鸿	200	1,700.00	0.01
519	300634	彩讯股份	100	1,683.00	0.01
520	300130	新国都	100	1,664.00	0.01
521	300538	同益股份	100	1,626.00	0.01
522	300493	润欣科技	200	1,618.00	0.01
523	002182	宝武镁业	140	1,579.20	0.01
524	605077	华康股份	100	1,525.00	0.01
525	002777	久远银海	100	1,499.00	0.01
526	301238	瑞泰新材	100	1,497.00	0.01
527	605118	力鼎光电	100	1,489.00	0.01
528	300578	会畅通讯	100	1,480.00	0.01
529	300318	博晖创新	300	1,464.00	0.01
530	002190	成飞集成	100	1,412.00	0.01
531	300986	志特新材	200	1,354.00	0.01
532	603169	兰石重装	300	1,350.00	0.01
533	300414	中光防雷	200	1,322.00	0.01
534	002760	凤形股份	100	1,320.00	0.01
535	300402	宝色股份	100	1,298.00	0.01
536	003000	劲仔食品	100	1,205.00	0.01
537	601019	山东出版	100	1,182.00	0.01
538	300674	宇信科技	100	1,108.00	0.01
539	300332	天壕能源	200	1,062.00	0.01
540	603918	金桥信息	100	1,045.00	0.01
541	603997	继峰股份	100	1,023.00	0.01
542	002549	凯美特气	200	1,022.00	0.01
543	600737	中粮糖业	100	959.00	0.01
544	601101	昊华能源	100	919.00	0.00
545	300771	智莱科技	100	879.00	0.00
546	300195	长荣股份	200	838.00	0.00

547	002258	利尔化学	100	802.00	0.00
548	300129	泰胜风能	100	682.00	0.00
549	000503	国新健康	100	667.00	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	000591	太阳能	860,330.00	3.71
2	601222	林洋能源	835,702.00	3.61
3	600967	内蒙一机	725,928.00	3.13
4	600893	航发动力	591,663.00	2.55
5	002065	东华软件	558,557.00	2.41
6	300595	欧普康视	477,840.00	2.06
7	300073	当升科技	464,591.00	2.00
8	601108	财通证券	458,347.00	1.98
9	000636	风华高科	445,067.00	1.92
10	603132	金徽股份	434,579.00	1.87
11	002746	仙坛股份	402,810.00	1.74
12	688596	正帆科技	387,960.02	1.67
13	002449	国星光电	377,804.00	1.63
14	601877	正泰电器	366,953.00	1.58
15	002461	珠江啤酒	332,205.00	1.43
16	300224	正海磁材	328,520.00	1.42
17	301180	万祥科技	323,840.60	1.40
18	300070	碧水源	318,660.00	1.37
19	600573	惠泉啤酒	314,630.00	1.36
20	603689	皖天然气	313,410.00	1.35

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300333	兆日科技	671,841.00	2.90
2	600893	航发动力	624,407.00	2.69
3	002474	榕基软件	623,666.00	2.69
4	002452	长高电新	617,470.00	2.66
5	300046	台基股份	613,845.00	2.65
6	300787	海能实业	553,692.00	2.39
7	000591	太阳能	539,842.00	2.33

8	300073	当升科技	528,586.00	2.28
9	001217	华尔泰	505,749.00	2.18
10	300120	经纬辉开	490,264.00	2.12
11	601222	林洋能源	477,747.00	2.06
12	300610	晨化股份	471,431.00	2.03
13	603122	合富中国	438,830.00	1.89
14	002500	山西证券	436,338.00	1.88
15	603132	金徽股份	431,696.52	1.86
16	600967	内蒙一机	426,972.00	1.84
17	000636	风华高科	423,866.00	1.83
18	300412	迦南科技	408,150.00	1.76
19	002524	光正眼科	388,248.00	1.67
20	600359	新农开发	359,502.00	1.55

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	94,998,878.72
卖出股票收入（成交）总额	96,201,265.03

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,119,263.48	6.00
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	1,119,263.48	6.00

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	019727	23 国债 24	10,000	1,018,190.41	5.45
2	019733	24 国债 02	1,000	101,073.07	0.54

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规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,282.23
2	应收清算款	213,361.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,002.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	236,645.91
---	----	------------

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	541	55,639.51	24,748,192.90	82.22	5,352,782.03	17.78
东方量化多策略混合 C	48	662.76	0.00	0.00	31,812.35	100.00
合计	589	51,159.23	24,748,192.90	82.13	5,384,594.38	17.87

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方量化多策略混合 A	742,789.86	2.47
	东方量化多策略混合 C	1.01	0.00
	合计	742,790.87	2.47

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方量化多策略混合 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	东方量化多策略混合 A	0

本开放式基金	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	30,086,567.35	111,479.48
本报告期基金总申购 份额	241,965.41	426,253.43
减：本报告期基金总 赎回份额	227,557.83	505,920.56
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	30,100,974.93	31,812.35

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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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

本基金于 2024 年 1 月 1 日将为基金提供审计服务的会计师事务所由立信会计师事务所(特
殊普通合伙)变更为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)，该变更事项已经履行了必要

的程序。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
德邦证券股份有限公司	2	191,200,143.75	100.00	178,562.81	100.00	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	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) 本报告期内本基金交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
德邦证券股份有限公司	2,602,370.00	100.00	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

证券股份有限公司						
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	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	2024 年 1 月 2 日
2	东方量化多策略混合型证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 20 日
3	关于东方量化多策略混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同等法律文件的公告	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	2024 年 1 月 23 日
4	东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同（2024 年 1 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 23 日
5	东方量化多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 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	2024 年 1 月 24 日
6	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	2024 年 1 月 24 日
7	关于增加上海大智慧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	2024 年 2 月 5 日
8	东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货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	2024 年 2 月 23 日
9	关于提醒投资者防范不法分子仿冒我	证券时报、证券日报、	2024 年 2 月 23 日

	司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司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	2024 年 2 月 29 日
11	东方中证 500 指数增强型证券投资基金清算报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 5 日
12	关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加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	2024 年 3 月 14 日
13	关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司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	2024 年 3 月 15 日
14	关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构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	2024 年 3 月 27 日
15	东方量化多策略混合型证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 30 日
16	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	2024 年 4 月 2 日
17	东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资上交所股票及相关风险提示的公告	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	2024 年 4 月 10 日
18	东方量化多策略混合型证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 20 日
19	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	2024 年 6 月 27 日

基金产品资料概要更新	证监会基金电子披露网站
------------	-------------

§ 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	20240101 - 20240630	24,732,161.50	-	-	24,732,161.50	82.08
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

2024 年 8 月 31 日