

东方量化成长灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	66

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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 盈利投资者数量占比	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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	70
10.8 其他重大事件	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
§ 12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东方量化成长灵活配置混合	
基金主代码	005616	
前端交易代码	005616	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 21 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	77,093,215.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
下属分级基金的交 易代码	005616	020126
报告期末下属分级 基金的份额总额	72,681,650.98 份	4,411,564.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	运用量化投资策略持续挖掘具有良好成长性和收益特征的投资标的，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金结合我国宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、证券市场行情因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，动态调整基金资产在权益类资产和固定收益类资产等大类资产间的配置比例，同时基于量化模型在权益类资产内部对不同风格的股票资产进行优化配置和动态调整。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李景岩	王小飞
	联系电话	010-66295888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	021-60637228
传真		010-66578700	021-60635778
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100073	100033
法定代表人	崔伟	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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)	
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
本期已实现收益	12,184,096.95	1,241,205.29
本期利润	16,755,870.86	1,695,248.69
加权平均基金份 额本期利润	0.2335	0.3047
本期加权平均净 值利润率	12.61%	12.34%
本期基金份额净 值增长率	16.09%	15.79%
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	68,623,015.65	7,012,088.85
期末可供分配基 金份额利润	0.9442	1.5895
期末基金资产净 值	141,304,666.63	11,423,653.60
期末基金份额净 值	1.9442	2.5895

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	160.54%	66.50%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化成长灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.57%	1.49%	7.43%	1.54%	5.14%	-0.05%
过去六个月	16.09%	1.53%	8.72%	1.60%	7.37%	-0.07%
过去一年	37.85%	1.30%	27.67%	1.35%	10.18%	-0.05%
过去三年	82.40%	1.72%	33.43%	1.74%	48.97%	-0.02%
过去五年	71.06%	1.51%	26.20%	1.42%	44.86%	0.09%
过去七年	171.42%	1.45%	55.51%	1.27%	115.91%	0.18%
自基金合同生效起至今	160.54%	1.41%	40.46%	1.23%	120.08%	0.18%

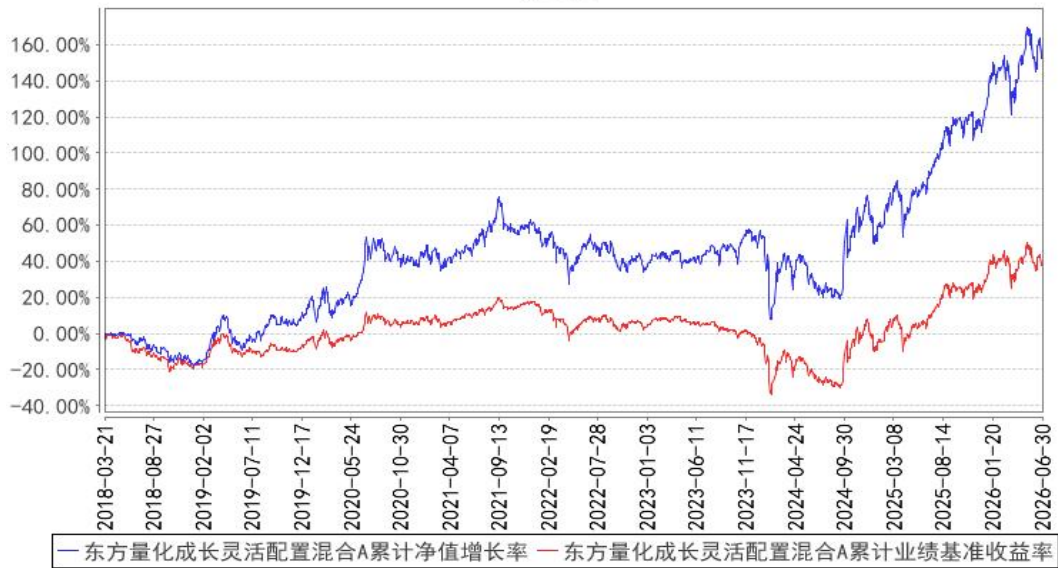
东方量化成长灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.43%	1.49%	7.43%	1.54%	5.00%	-0.05%
过去六个月	15.79%	1.52%	8.72%	1.60%	7.07%	-0.08%
过去一年	37.16%	1.30%	27.67%	1.35%	9.49%	-0.05%

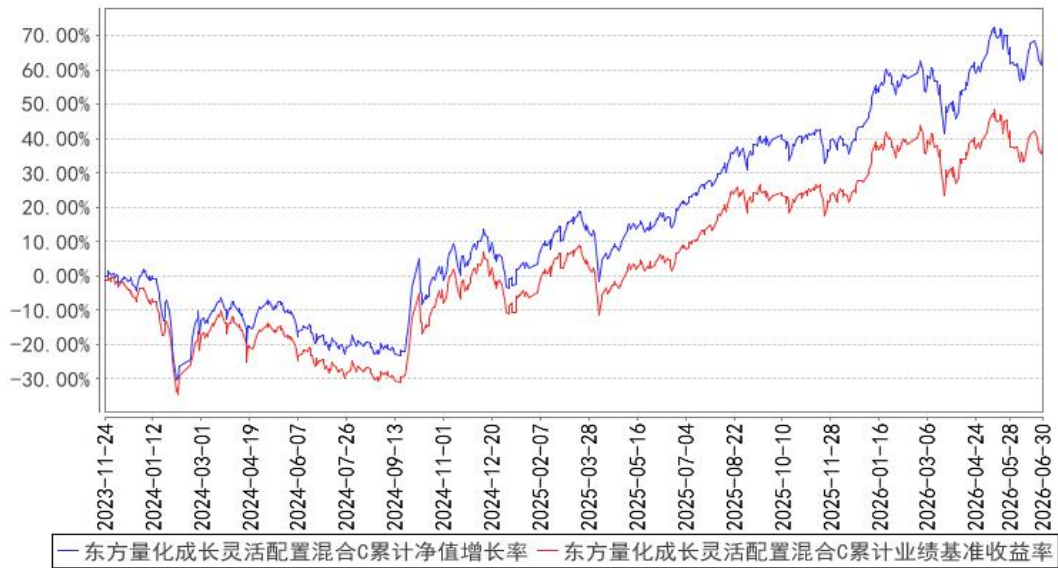
自基金合同 生效起至今	66.50%	1.81%	38.66%	1.86%	27.84%	-0.05%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 2000 指数属于小微盘，小微盘经过连续多年强势后，今年表现逊色，可能与市场注意力转向科技成长行情有关。

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 16.09%，业绩比较基准收益率为 8.72%，高于业绩比较基准 7.37%；本基金 C 类净值增长率为 15.79%，业绩比较基准收益率为 8.72%，高于业绩比较基准 7.07%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值

低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方量化成长灵活配置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	9,114,762.53	3,416,989.30
结算备付金		2,821,566.20	3,036,488.17
存出保证金		27,960.50	33,573.16
交易性金融资产	6.4.7.2	147,460,143.86	107,605,194.77
其中：股票投资		138,886,181.64	101,347,476.42
基金投资		-	-
债券投资		8,573,962.22	6,257,718.35
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		101,747.25	94,608.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		159,526,180.34	114,186,853.99
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		3,501,290.15	4,001,764.40
应付清算款		-	159.08
应付赎回款		2,760,974.35	1,313,853.71
应付管理人报酬		150,432.09	111,964.98
应付托管费		25,072.03	18,660.85
应付销售服务费		5,575.93	5,001.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		234.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	354,280.61	287,414.66
负债合计		6,797,860.11	5,738,818.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	77,093,215.73	63,056,094.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	75,635,104.50	45,391,940.92
净资产合计		152,728,320.23	108,448,035.29
负债和净资产总计		159,526,180.34	114,186,853.99

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 77,093,215.73 份，其中东方量化成长灵活配置混合 A 基金份额净值 1.9442 元，份额总额 72,681,650.98 份；东方量化成长灵活配置混合 C 基金份额净值 2.5895 元，份额总额 4,411,564.75 份。

6.2 利润表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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		19,612,866.31	11,790,845.83
1. 利息收入		24,332.46	15,071.45
其中：存款利息收入	6.4.7.10	24,332.46	15,071.45
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）		14,454,587.33	10,785,010.30
其中：股票投资收益	6.4.7.11	13,788,646.21	10,080,820.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	51,747.48	23,663.92
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	-	242,068.25
股利收益	6.4.7.16	614,193.64	438,457.64
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	5,025,817.31	913,617.18
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	108,129.21	77,146.90
减：二、营业总支出		1,161,746.76	577,078.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	870,529.21	404,199.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	145,088.25	67,366.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	34,049.78	19,548.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		18,948.62	12,642.67
其中：卖出回购金融资产 支出		18,948.62	12,642.67

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		86. 28	872. 39
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	93, 044. 62	72, 448. 06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18, 451, 119. 55	11, 213, 767. 52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18, 451, 119. 55	11, 213, 767. 52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18, 451, 119. 55	11, 213, 767. 52

6.3 净资产变动表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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	63, 056, 094. 37	-	45, 391, 940. 92	108, 448, 035. 29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	63, 056, 094. 37	-	45, 391, 940. 92	108, 448, 035. 29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14, 037, 121. 36	-	30, 243, 163. 58	44, 280, 284. 94
（一）、综合收益总额	-	-	18, 451, 119. 55	18, 451, 119. 55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	14, 037, 121. 36	-	11, 792, 044. 03	25, 829, 165. 39
其中：1. 基金申购款	42, 102, 559. 58	-	41, 370, 782. 25	83, 473, 341. 83
2. 基金赎回款	-28, 065, 438. 22	-	-29, 578, 738. 22	-57, 644, 176. 44
（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	77,093,215.73	-	75,635,104.50	152,728,320.23
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	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,572,263.65	-	14,412,806.60	22,985,070.25
（一）、综合收益总额	-	-	11,213,767.52	11,213,767.52
（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）	8,572,263.65	-	3,199,039.08	11,771,302.73
其中：1. 基金申购款	30,577,026.49	-	12,934,232.67	43,511,259.16
2. 基金赎回款	-22,004,762.84	-	-9,735,193.59	-31,739,956.43
（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	56,795,644.04	-	25,410,283.50	82,205,927.54

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

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

本基金自 2023 年 11 月 24 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，此前已持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额指在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，从本类别基金资产中不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；C 类基金份额指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。两级基金份额分别设置基金代码，分别计算基金份额净值并单独公告。详情请见本公司于 2023 年 11 月 23 日发布的《关于东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额、变更业绩比较基准并修改《基金合同》等法律文件的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基

第 19 页 共 78 页

金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可交换债券、可转换债券、分离交易的可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

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	9,114,762.53
等于：本金	9,113,941.33
加：应计利息	821.20
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	9,114,762.53

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	138,182,091.94	-	138,886,181.64	704,089.70

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,503,605.00	67,922.22	8,573,962.22	2,435.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,503,605.00	67,922.22	8,573,962.22	2,435.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		146,685,696.94	67,922.22	147,460,143.86	706,524.70

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	981.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	270,907.62
其中：交易所市场	270,907.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,391.88
合计	354,280.61

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	本期	
	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	57,994,126.78	57,994,126.78
本期申购	33,591,402.78	33,591,402.78
本期赎回（以“-”号填列）	-18,903,878.58	-18,903,878.58
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	72,681,650.98	72,681,650.98

东方量化成长灵活配置混合 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	5,061,967.59	5,061,967.59
本期申购	8,511,156.80	8,511,156.80
本期赎回（以“-”号填列）	-9,161,559.64	-9,161,559.64
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	4,411,564.75	4,411,564.75

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

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	58,495,696.62	-19,361,675.60	39,134,021.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	58,495,696.62	-19,361,675.60	39,134,021.02
本期利润	12,184,096.95	4,571,773.91	16,755,870.86
本期基金份额交易产生的变动数	14,761,307.82	-2,028,184.05	12,733,123.77
其中：基金申购款	35,702,839.76	-6,786,552.94	28,916,286.82
基金赎回款	-20,941,531.94	4,758,368.89	-16,183,163.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,441,101.39	-16,818,085.74	68,623,015.65

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,851,498.15	-1,593,578.25	6,257,919.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,851,498.15	-1,593,578.25	6,257,919.90
本期利润	1,241,205.29	454,043.40	1,695,248.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,295,210.39	354,130.65	-941,079.74
其中：基金申购款	13,998,277.50	-1,543,782.07	12,454,495.43
基金赎回款	-15,293,487.89	1,897,912.72	-13,395,575.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,797,493.05	-785,404.20	7,012,088.85

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	10,976.81
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	13,305.35
其他	50.30
合计	24,332.46

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	13,788,646.21
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	13,788,646.21

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	361,908,317.31
减：卖出股票成本总额	347,561,411.23
减：交易费用	558,259.87

买卖股票差价收入	13,788,646.21
----------	---------------

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	52,865.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,118.00
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	51,747.48

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	5,773,855.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,701,621.00
减：应计利息总额	73,352.82
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,118.00

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	614,193.64

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	614,193.64

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	5,025,817.31
股票投资	5,024,688.31
债券投资	1,129.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,025,817.31

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	105,869.31
基金转换费收入	2,259.90
合计	108,129.21

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	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,052.74
账户维护费	18,600.00
合计	93,044.62

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
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
东北证券股份有限 公司	2,756,081.47	0.37	120,569,418.73	27.04

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
东北证券股份有限公 司	200,246.00	1.46	398,716.00	4.86

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
东北证券股份有限 公司	4,000,000.00	12.12	6,000,000.00	28.04

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东北证券股份有 限公司	1,228.86	0.37	50.64	0.02
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 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东北证券股份有 限公司	53,761.96	27.55	11,488.59	12.85

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

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	870,529.21	404,199.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	349,821.64	138,866.70
应支付基金管理人的净管理费	520,707.57	265,333.09

注：①计提标准：本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。管理费
的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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	145,088.25	67,366.73

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	154.37	154.37
合计	-	154.37	154.37
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		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计

东方基金管理股份有限公司	-	117.10	117.10
合计	-	117.10	117.10

注：①本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；

本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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
中国建设银行股份有限公司	9,114,762.53	10,976.81	6,304,870.22	6,019.73

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.77	31	868.00	860.87	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	2,203	22,272.33	22,272.33	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	5,142	51,985.62	51,985.62	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	25.28	652	5,098.64	16,482.56	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	18.20	54	992.52	982.80	-

001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	36.79	157	4,268.83	5,776.03	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	48.48	108	3,281.04	5,235.84	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	35.24	870	8,804.40	30,658.80	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	63.44	97	2,586.02	6,153.68	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	66.90	173	2,300.90	11,573.70	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	40.66	185	2,573.35	7,522.10	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	37.52	333	2,357.64	12,494.16	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.13	50	2,900.00	5,606.50	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	69.66	159.94	149	10,379.34	23,831.06	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	129.27	35	2,743.30	4,524.45	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	76.74	94	2,061.42	7,213.56	-
301696	三	2026	6个月	新股	24.68	104.80	92	2,270.56	9,641.60	-

	瑞智能	年3月31日		流通受限						
--	-----	--------	--	------	--	--	--	--	--	--

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
603722	阿科力	2026年6月29日	重大事项停牌	39.60	2026年7月6日	43.56	2,300	88,832.81	91,080.00	-

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 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 3,501,290.15 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 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：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	9,114,762.53	-	-	-	9,114,762.53
结算备付金	2,821,566.20	-	-	-	2,821,566.20
存出保证金	27,960.50	-	-	-	27,960.50
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-138,886,181.64	138,886,181.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	8,573,962.22	-	-	-	8,573,962.22
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	-	-	-	101,747.25	101,747.25
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,538,251.45	-	-	-138,987,928.89	159,526,180.34
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	3,501,290.15	-	-	-	3,501,290.15
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,760,974.35	2,760,974.35
应付管理人报酬	-	-	-	150,432.09	150,432.09
应付托管费	-	-	-	25,072.03	25,072.03
应付销售服务费	-	-	-	5,575.93	5,575.93
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	234.95	234.95
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	354,280.61	354,280.61
负债总计	3,501,290.15	-	-	3,296,569.96	6,797,860.11
利率敏感度缺口	17,036,961.30	-	-	-135,691,358.93	152,728,320.23
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	3,416,989.30	-	-	-	3,416,989.30
结算备付金	3,036,488.17	-	-	-	3,036,488.17
存出保证金	33,573.16	-	-	-	33,573.16
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-101,347,476.42	101,347,476.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,257,718.35	-	-	-	6,257,718.35
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	94,608.59	94,608.59
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,744,768.98	-	-	-101,442,085.01	114,186,853.99
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	4,001,764.40	-	-	-	4,001,764.40
应付清算款	-	-	-	159.08	159.08
应付赎回款	-	-	-	1,313,853.71	1,313,853.71

应付管理人报酬	-	-	-	111,964.98	111,964.98
应付托管费	-	-	-	18,660.85	18,660.85
应付销售服务费	-	-	-	5,001.02	5,001.02
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	287,414.66	287,414.66
负债总计	4,001,764.40	-	-	1,737,054.30	5,738,818.70
利率敏感度缺口	8,743,004.58	-	-	99,705,030.71	108,448,035.29

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%	-8,279.15	-5,326.00
	市场利率下调 0.25%	8,279.15	5,326.00

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	138,886,181.64	90.94	101,347,476.42	93.45
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,573,962.22	5.61	6,257,718.35	5.77
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	147,460,143.86	96.55	107,605,194.77	99.22

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%	7,769,022.49	4,524,810.25
	沪深 300 指数下跌 5%	-7,769,022.49	-4,524,810.25

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	138,572,285.98	101,229,851.02
第二层次	8,739,300.17	6,266,980.35
第三层次	148,557.71	108,363.40
合计	147,460,143.86	107,605,194.77

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	138,886,181.64	87.06
	其中：股票	138,886,181.64	87.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,573,962.22	5.37
	其中：债券	8,573,962.22	5.37
	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	11,936,328.73	7.48
8	其他各项资产	129,707.75	0.08
9	合计	159,526,180.34	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	695,519.30	0.46
B	采矿业	1,156,984.86	0.76
C	制造业	112,265,935.53	73.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,373,822.95	1.55
E	建筑业	1,449,649.00	0.95
F	批发和零售业	2,118,937.51	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	787,297.87	0.52
H	住宿和餐饮业	64,549.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,102,443.19	6.61
J	金融业	6,622.00	0.00
K	房地产业	516,391.00	0.34
L	租赁和商务服务业	715,695.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	3,285,306.97	2.15
N	水利、环境和公共设施管理业	2,539,013.06	1.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	157,064.00	0.10
Q	卫生和社会工作	310,609.40	0.20
R	文化、体育和娱乐业	340,341.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	138,886,181.64	90.94

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	002134	天津普林	33,600	1,022,112.00	0.67
2	300489	光智科技	3,000	935,850.00	0.61
3	002993	奥海科技	12,500	895,125.00	0.59
4	300731	科创新源	14,380	839,216.80	0.55
5	300853	申昊科技	26,500	818,585.00	0.54
6	301566	达利凯普	22,000	815,760.00	0.53
7	300566	激智科技	21,400	790,730.00	0.52
8	002119	康强电子	19,300	770,456.00	0.50
9	300835	龙磁科技	3,300	757,317.00	0.50
10	300435	中泰股份	27,700	749,839.00	0.49
11	688518	联赢激光	24,250	749,325.00	0.49
12	300749	顶固集创	27,000	724,950.00	0.47
13	688090	瑞松科技	6,404	681,705.80	0.45
14	301360	荣旗科技	9,900	678,051.00	0.44
15	301526	国际复材	14,400	672,048.00	0.44
16	688525	佰维存储	1,355	670,359.15	0.44
17	000922	佳电股份	47,900	668,684.00	0.44
18	301235	华康洁净	8,900	667,589.00	0.44
19	300948	冠中生态	24,500	652,435.00	0.43
20	300483	首华燃气	36,300	638,154.00	0.42
21	002039	黔源电力	33,900	637,998.00	0.42
22	002832	比音勒芬	30,800	635,712.00	0.42
23	300416	苏试试验	31,100	633,818.00	0.41
24	301328	维峰电子	8,880	632,256.00	0.41
25	300790	宇瞳光学	23,980	626,117.80	0.41
26	688386	泛亚微透	6,922	621,872.48	0.41
27	300976	达瑞电子	7,780	619,677.00	0.41
28	300843	胜蓝股份	3,900	609,375.00	0.40
29	301265	华新科技	22,100	608,855.00	0.40
30	688181	八亿时空	9,718	608,346.80	0.40
31	300819	聚杰微纤	8,100	599,562.00	0.39
32	301246	宏源药业	22,200	597,180.00	0.39
33	301603	乔锋智能	4,100	589,580.00	0.39
34	300031	宝通科技	20,300	579,971.00	0.38
35	003010	若羽臣	23,540	572,022.00	0.37
36	300740	水羊股份	30,900	568,869.00	0.37
37	002955	鸿合科技	15,900	568,425.00	0.37

38	301087	可孚医疗	11,900	567,035.00	0.37
39	301321	翰博高新	12,800	565,120.00	0.37
40	300656	民德电子	14,700	559,923.00	0.37
41	300715	凯伦股份	33,600	553,056.00	0.36
42	603938	三孚股份	7,700	551,705.00	0.36
43	300508	维宏股份	9,600	551,328.00	0.36
44	301307	美利信	7,300	549,617.00	0.36
45	300964	本川智能	6,320	544,594.40	0.36
46	002810	山东赫达	21,500	531,050.00	0.35
47	688381	帝奥微	9,836	526,226.00	0.34
48	688786	悦安新材	11,343	522,685.44	0.34
49	300429	强力新材	29,400	520,968.00	0.34
50	301369	联动科技	2,120	519,400.00	0.34
51	688677	海泰新光	5,077	513,437.01	0.34
52	301568	思泰克	4,600	513,360.00	0.34
53	300069	金利华电	16,000	509,280.00	0.33
54	688598	金博股份	10,297	509,186.65	0.33
55	301382	蜂助手	11,000	506,000.00	0.33
56	301528	多浦乐	6,080	497,952.00	0.33
57	301529	福赛科技	5,160	497,217.60	0.33
58	002655	共达电声	10,800	496,800.00	0.33
59	301281	科源制药	9,900	488,070.00	0.32
60	300382	斯莱克	21,100	487,621.00	0.32
61	603931	格林达	8,100	481,140.00	0.32
62	301607	富特科技	9,200	480,700.00	0.31
63	002150	正泰电源	19,000	480,510.00	0.31
64	301349	信德新材	6,500	478,400.00	0.31
65	300596	利安隆	9,100	477,568.00	0.31
66	301021	英诺激光	3,900	475,410.00	0.31
67	603078	江化微	9,600	474,432.00	0.31
68	605208	永茂泰	29,500	470,525.00	0.31
69	301091	深城交	30,100	466,550.00	0.31
70	300222	科大智能	33,600	465,360.00	0.30
71	301387	光大同创	5,000	462,100.00	0.30
72	300590	移为通信	32,000	459,200.00	0.30
73	300486	东杰智能	21,300	454,755.00	0.30
74	300745	欣锐科技	10,600	447,532.00	0.29
75	605018	长华集团	29,900	445,809.00	0.29
76	688041	海光信息	1,200	444,360.00	0.29
77	300540	蜀道装备	11,700	443,430.00	0.29
78	002891	中宠股份	16,300	435,536.00	0.29
79	688233	神工股份	2,003	429,483.26	0.28
80	300997	欢乐家	31,300	424,115.00	0.28

81	300991	创益通	11,900	418,999.00	0.27
82	301479	弘景光电	6,960	418,992.00	0.27
83	301051	信濠光电	21,560	418,264.00	0.27
84	300998	宁波方正	14,900	414,667.00	0.27
85	000593	德龙汇能	19,300	412,634.00	0.27
86	301251	威尔高	7,660	408,124.80	0.27
87	002380	科远智慧	11,900	406,742.00	0.27
88	688351	微电生理	17,711	401,331.26	0.26
89	301282	金禄电子	13,500	398,115.00	0.26
90	301189	奥尼电子	6,720	396,009.60	0.26
91	300984	金沃股份	7,300	392,229.00	0.26
92	300863	卡倍亿	5,040	386,215.20	0.25
93	300959	线上线下	2,600	384,306.00	0.25
94	301191	菲菱科思	3,380	383,799.00	0.25
95	301323	新莱福	4,700	383,473.00	0.25
96	601330	绿色动力	55,000	383,350.00	0.25
97	688551	科威尔	5,406	379,879.62	0.25
98	300041	回天新材	24,400	379,176.00	0.25
99	688418	震有科技	7,841	376,995.28	0.25
100	301252	同星科技	9,300	376,929.00	0.25
101	001317	三羊马	9,500	376,010.00	0.25
102	300687	赛意信息	12,100	375,100.00	0.25
103	000510	新金路	15,100	375,084.00	0.25
103	603010	万盛股份	20,700	375,084.00	0.25
104	603936	博敏电子	14,000	373,940.00	0.24
105	300563	神宇股份	13,100	371,909.00	0.24
106	301571	国科天成	5,700	371,526.00	0.24
107	301172	君逸数码	14,100	365,895.00	0.24
108	300263	隆华科技	22,400	365,120.00	0.24
109	600714	金瑞矿业	17,600	361,328.00	0.24
110	605287	德才股份	8,700	360,963.00	0.24
111	688191	智洋创新	10,010	357,357.00	0.23
112	688156	路德科技	11,766	355,921.50	0.23
113	301273	瑞晨环保	11,280	355,432.80	0.23
114	300617	安靠智电	6,700	355,033.00	0.23
115	300121	阳谷华泰	28,000	352,800.00	0.23
116	300467	迅游科技	9,400	349,492.00	0.23
117	002597	金禾实业	17,800	348,880.00	0.23
118	301117	佳缘科技	14,900	347,915.00	0.23
119	300518	新迅达	10,500	347,025.00	0.23
120	003019	宸展光电	10,600	345,030.00	0.23
121	688620	安凯微	21,135	342,387.00	0.22
122	002903	宇环数控	7,500	340,650.00	0.22

123	301045	天禄科技	3,800	338,504.00	0.22
124	300473	德尔股份	11,100	337,440.00	0.22
125	301026	浩通科技	16,640	336,460.80	0.22
126	002937	兴瑞科技	7,600	333,868.00	0.22
127	688456	有研粉材	2,386	333,085.60	0.22
128	301195	北路智控	12,200	330,620.00	0.22
129	300616	尚品宅配	31,700	330,314.00	0.22
130	301488	豪恩汽电	2,600	329,732.00	0.22
131	603181	皇马科技	20,200	327,644.00	0.21
132	301373	凌玮科技	2,100	326,550.00	0.21
133	300363	博腾股份	20,100	326,424.00	0.21
134	688720	艾森股份	3,229	326,129.00	0.21
135	300378	鼎捷数智	9,000	324,900.00	0.21
136	300445	康斯特	15,600	324,792.00	0.21
137	300499	高澜股份	8,200	317,340.00	0.21
138	688733	壹石通	7,550	312,192.50	0.20
139	600458	时代新材	18,800	311,140.00	0.20
140	688218	江苏北人	5,643	310,139.28	0.20
141	688663	新风光	3,504	309,963.84	0.20
142	300286	安科瑞	12,800	309,120.00	0.20
143	002870	香山股份	8,000	308,320.00	0.20
144	300951	博硕科技	6,100	308,050.00	0.20
145	002293	罗莱生活	31,100	307,579.00	0.20
146	688050	爱博医疗	8,407	306,435.15	0.20
147	002272	川润股份	12,400	304,172.00	0.20
148	301081	严牌股份	22,200	303,696.00	0.20
149	300825	阿尔特	21,100	301,308.00	0.20
150	301629	矽电股份	700	301,280.00	0.20
151	301041	金百泽	8,900	300,375.00	0.20
152	301072	中捷精工	7,300	299,373.00	0.20
153	600386	北巴传媒	95,800	298,896.00	0.20
154	600184	光电股份	9,300	297,693.00	0.19
155	300939	秋田微	4,300	297,560.00	0.19
156	688049	炬芯科技	6,295	295,298.45	0.19
157	300421	力星股份	15,900	294,309.00	0.19
158	001311	多利科技	18,070	291,469.10	0.19
159	301115	联检科技	8,300	290,998.00	0.19
160	300932	三友联众	27,320	289,592.00	0.19
161	688499	利元亨	5,498	288,919.90	0.19
162	300720	海川智能	3,000	288,600.00	0.19
163	300206	理邦仪器	23,200	283,736.00	0.19
164	605168	三人行	5,600	283,584.00	0.19
165	605056	咸亨国际	17,700	283,200.00	0.19

166	300721	怡达股份	7,500	282,375.00	0.18
167	605318	法狮龙	2,500	282,150.00	0.18
168	600237	铜峰电子	20,200	281,790.00	0.18
169	300219	鸿利智汇	27,000	281,610.00	0.18
170	301085	亚康股份	4,600	278,806.00	0.18
171	300868	杰美特	1,900	278,749.00	0.18
172	300319	麦捷科技	9,400	278,522.00	0.18
173	688535	华海诚科	1,486	277,882.00	0.18
174	603158	腾龙股份	22,500	275,175.00	0.18
175	003023	彩虹集团	14,100	274,104.00	0.18
176	688231	隆达股份	7,406	272,022.38	0.18
177	300752	隆利科技	20,100	270,747.00	0.18
178	002043	兔宝宝	24,400	270,352.00	0.18
179	301106	骏成科技	13,000	269,620.00	0.18
180	688398	赛特新材	10,307	267,054.37	0.17
181	300328	宜安科技	18,900	265,356.00	0.17
182	603926	铁流股份	15,000	265,350.00	0.17
183	603183	建研院	74,600	264,830.00	0.17
184	301111	粤万年青	10,200	263,976.00	0.17
185	300700	岱勒新材	12,400	263,872.00	0.17
186	300443	金雷股份	12,200	263,276.00	0.17
187	300283	温州宏丰	12,800	263,040.00	0.17
188	301517	陕西华达	5,300	263,039.00	0.17
189	603985	恒润股份	10,900	261,818.00	0.17
190	688707	振华新材	20,371	261,767.35	0.17
191	688261	东微半导	2,468	258,967.24	0.17
192	002322	理工能科	26,500	257,050.00	0.17
193	300955	嘉亨家化	7,000	252,630.00	0.17
194	002772	众兴菌业	22,200	252,192.00	0.17
195	002478	常宝股份	40,400	249,672.00	0.16
196	300840	酷特智能	12,100	249,623.00	0.16
197	301067	显盈科技	6,600	249,612.00	0.16
198	300401	花园生物	11,400	249,546.00	0.16
199	603011	合锻智能	7,500	248,100.00	0.16
200	605305	中际联合	5,900	247,328.00	0.16
201	688653	康希通信	14,149	245,909.62	0.16
202	003025	思进智能	17,300	243,584.00	0.16
203	688382	益方生物	13,531	243,558.00	0.16
204	300881	盛德鑫泰	6,500	243,425.00	0.16
205	688046	药康生物	10,056	243,355.20	0.16
206	002730	电光科技	8,000	239,280.00	0.16
207	300921	南凌科技	11,700	237,627.00	0.16
208	688202	美迪西	2,935	236,883.85	0.16

209	688020	方邦股份	945	235,872.00	0.15
210	002899	英派斯	10,800	235,440.00	0.15
211	603683	晶华新材	7,600	234,232.00	0.15
212	688182	灿勤科技	5,368	231,199.76	0.15
213	301028	鼎熔岩	14,400	229,824.00	0.15
214	002849	威星智能	13,500	228,420.00	0.15
215	688108	赛诺医疗	12,318	228,252.54	0.15
216	300952	恒辉安防	13,080	227,592.00	0.15
217	688690	纳微科技	5,135	226,453.50	0.15
218	301137	哈焊华通	6,500	223,340.00	0.15
219	301368	丰立智能	5,300	220,639.00	0.14
220	002020	京新药业	17,600	219,824.00	0.14
221	300935	盈建科	7,400	217,116.00	0.14
222	605133	嵘泰股份	5,500	216,535.00	0.14
223	301522	上大股份	8,200	214,594.00	0.14
224	301109	军信股份	17,100	213,066.00	0.14
225	600121	郑州煤电	59,200	211,936.00	0.14
226	301261	恒工精密	2,700	210,870.00	0.14
227	301577	美信科技	2,700	209,358.00	0.14
228	603897	长城科技	6,400	207,744.00	0.14
229	300494	盛天网络	24,000	202,320.00	0.13
230	300420	五洋自控	21,300	201,498.00	0.13
231	600094	大名城	58,200	201,372.00	0.13
232	301379	天山电子	7,060	200,786.40	0.13
233	002077	大港股份	10,400	200,616.00	0.13
234	301555	惠柏新材	4,400	199,804.00	0.13
235	688192	迪哲医药	5,000	199,650.00	0.13
236	002635	安洁科技	9,700	198,365.00	0.13
237	300304	云意电气	11,100	198,135.00	0.13
238	300943	春晖智控	4,400	197,780.00	0.13
239	688285	高铁电气	27,430	196,673.10	0.13
240	301061	匠心家居	5,600	196,392.00	0.13
241	605598	上海港湾	5,100	195,993.00	0.13
242	300854	中兰环保	10,260	195,760.80	0.13
243	600722	金牛化工	24,100	195,692.00	0.13
244	300818	耐普矿机	10,340	195,426.00	0.13
245	300633	开立医疗	10,600	194,934.00	0.13
246	600993	马应龙	9,000	194,580.00	0.13
247	688530	欧莱新材	2,004	194,187.60	0.13
248	002557	洽洽食品	10,800	193,968.00	0.13
249	002438	江苏神通	12,900	192,597.00	0.13
250	002458	益生股份	24,770	192,462.90	0.13
251	002017	东信和平	13,100	191,653.00	0.13

252	301169	零点有数	2,700	190,782.00	0.12
253	300816	艾可蓝	2,600	190,320.00	0.12
254	300582	英飞特	15,600	190,008.00	0.12
255	603216	梦天家居	9,200	189,244.00	0.12
256	300538	同益股份	11,200	186,928.00	0.12
257	688628	优利德	1,881	186,106.14	0.12
258	301608	博实结	3,676	184,755.76	0.12
259	601882	海天精工	9,000	182,070.00	0.12
260	300145	南方泵业	33,400	182,030.00	0.12
261	688636	智明达	5,021	181,910.83	0.12
262	300481	濮阳惠成	9,500	180,690.00	0.12
263	688320	禾川科技	4,347	180,183.15	0.12
264	002577	雷柏科技	9,800	179,928.00	0.12
265	301305	朗坤科技	6,300	179,676.00	0.12
266	002787	华源控股	5,500	177,100.00	0.12
267	600230	沧州大化	13,600	177,072.00	0.12
268	300579	数字认证	8,500	175,950.00	0.12
269	301162	国能日新	4,020	175,875.00	0.12
270	688510	航亚科技	7,337	175,207.56	0.11
271	688337	普源精电	2,334	174,886.62	0.11
272	300161	华中数控	6,000	174,720.00	0.11
273	301193	家联科技	9,400	174,276.00	0.11
274	301198	喜悦智行	13,000	174,200.00	0.11
275	300351	永贵电器	10,500	173,250.00	0.11
276	301295	美硕科技	4,100	172,938.00	0.11
277	688172	燕东微	2,066	172,841.56	0.11
278	003006	百亚股份	11,900	172,669.00	0.11
279	301302	华如科技	6,400	172,288.00	0.11
280	300873	海晨股份	5,100	172,227.00	0.11
281	301327	华宝新能	3,500	168,245.00	0.11
282	603386	骏亚科技	8,500	167,705.00	0.11
283	688328	深科达	1,743	166,805.10	0.11
284	688802	沐曦股份	200	165,660.00	0.11
285	600133	东湖高新	20,900	165,110.00	0.11
286	001229	魅视科技	4,500	163,440.00	0.11
286	301101	明月镜片	6,000	163,440.00	0.11
287	688539	高华科技	5,095	162,428.60	0.11
288	688199	久日新材	4,695	162,118.35	0.11
289	301008	宏昌科技	6,300	161,280.00	0.11
290	300516	久之洋	4,920	161,179.20	0.11
291	301560	众捷汽车	6,000	160,380.00	0.11
292	688581	安杰思	3,091	159,835.61	0.10
293	688299	长阳科技	9,541	159,430.11	0.10

294	688371	菲沃泰	4,084	159,235.16	0.10
295	001287	中电港	5,100	158,865.00	0.10
296	301160	翔楼新材	3,400	158,610.00	0.10
297	301082	久盛电气	17,600	157,696.00	0.10
298	002668	TCL 智家	14,200	157,336.00	0.10
299	605098	行动教育	2,900	157,064.00	0.10
300	300556	丝路视觉	9,000	156,330.00	0.10
301	000026	飞亚达	7,200	155,088.00	0.10
302	300629	新劲刚	7,200	154,512.00	0.10
303	300986	志特新材	9,000	154,350.00	0.10
304	301055	张小泉	3,600	152,892.00	0.10
305	300491	通合科技	4,000	152,760.00	0.10
306	002997	瑞鹄模具	5,500	151,580.00	0.10
307	300668	杰恩股份	2,500	149,875.00	0.10
308	300578	会畅科技	8,600	149,554.00	0.10
309	688170	德龙激光	1,555	149,295.55	0.10
310	300772	运达股份	12,100	148,830.00	0.10
311	920971	天马新材	3,800	147,364.00	0.10
312	300203	聚光科技	10,600	146,598.00	0.10
313	688365	光云科技	9,282	146,377.14	0.10
314	300465	高伟达	13,300	145,369.00	0.10
315	300497	富祥股份	6,500	144,040.00	0.09
316	002208	合肥城建	7,100	143,562.00	0.09
317	300016	北陆药业	18,600	142,662.00	0.09
318	001389	广合科技	600	142,350.00	0.09
319	301317	鑫磊股份	2,500	140,300.00	0.09
320	300552	万集科技	6,100	139,385.00	0.09
321	300872	天阳科技	8,800	139,040.00	0.09
322	688379	华光新材	1,652	138,817.56	0.09
323	688607	康众医疗	2,712	138,312.00	0.09
324	600740	山西焦化	43,300	138,127.00	0.09
325	603916	苏博特	10,000	136,600.00	0.09
326	301631	壹连科技	1,900	136,534.00	0.09
327	600251	冠农股份	15,800	136,512.00	0.09
328	688595	芯海科技	3,109	136,360.74	0.09
329	603915	国茂股份	9,600	136,224.00	0.09
330	301118	恒光股份	5,000	136,150.00	0.09
331	920725	惠丰钻石	1,300	135,746.00	0.09
332	600817	宇通重工	15,400	135,520.00	0.09
333	301108	洁雅股份	5,700	134,463.00	0.09
334	300128	锦富技术	22,700	134,384.00	0.09
335	301398	星源卓镁	3,800	133,418.00	0.09
336	300550	和仁科技	10,000	133,300.00	0.09

337	688216	气派科技	3,172	133,255.72	0.09
338	300916	朗特智能	5,700	133,209.00	0.09
339	300183	东软载波	12,700	132,715.00	0.09
340	301088	戎美股份	11,500	131,790.00	0.09
341	301078	孩子王	19,400	131,144.00	0.09
342	688408	中信博	4,059	130,496.85	0.09
343	300970	华绿生物	7,130	130,336.40	0.09
344	002626	金达威	9,800	129,164.00	0.08
345	301057	汇隆新材	5,600	128,800.00	0.08
346	300321	同大股份	2,000	128,760.00	0.08
347	688319	欧林生物	2,922	128,509.56	0.08
348	688307	中润光学	1,604	128,239.80	0.08
349	002216	三全食品	11,100	127,983.00	0.08
350	002952	亚世光电	5,800	127,774.00	0.08
351	300710	万隆光电	3,700	127,650.00	0.08
352	688552	航天南湖	4,536	127,597.68	0.08
353	688139	海尔生物	4,806	126,974.52	0.08
354	300530	领湃科技	7,400	124,690.00	0.08
355	603798	康普顿	9,000	123,120.00	0.08
356	301257	普蕊斯	2,700	122,526.00	0.08
357	301148	嘉戎技术	2,300	122,498.00	0.08
358	300528	幸福蓝海	9,500	122,075.00	0.08
359	603396	金辰股份	4,600	121,900.00	0.08
360	002328	新朋股份	16,600	121,844.00	0.08
361	688583	思看科技	1,418	121,621.86	0.08
362	002718	友邦吊顶	1,100	121,275.00	0.08
363	002866	传艺科技	7,400	120,990.00	0.08
364	300926	博俊科技	6,800	120,700.00	0.08
365	300189	神农种业	27,900	120,528.00	0.08
366	301096	百诚医药	2,100	120,099.00	0.08
367	603393	新天然气	5,600	119,896.00	0.08
368	688207	格灵深瞳	5,907	118,730.70	0.08
369	300836	佰奥智能	1,600	118,384.00	0.08
370	603270	金帝股份	3,500	117,285.00	0.08
371	600508	上海能源	15,780	116,298.60	0.08
372	688562	航天软件	7,636	114,998.16	0.08
373	002246	北化股份	6,100	114,680.00	0.08
374	688255	凯尔达	4,120	114,536.00	0.07
375	003011	海象新材	6,300	114,471.00	0.07
376	301391	卡莱特	2,000	114,200.00	0.07
377	300624	万兴科技	2,200	114,114.00	0.07
378	300930	屹通新材	4,000	114,000.00	0.07
379	300006	莱美药业	22,200	113,886.00	0.07

380	603790	雅运股份	5,300	113,102.00	0.07
381	688361	中科飞测	263	113,090.00	0.07
382	300812	易天股份	3,840	112,550.40	0.07
383	688619	罗普特	6,895	111,905.85	0.07
384	300592	华凯易佰	6,300	111,510.00	0.07
385	603416	信捷电气	2,100	111,027.00	0.07
386	300553	集智股份	1,800	110,502.00	0.07
387	600191	华资实业	12,100	110,110.00	0.07
388	600697	欧亚集团	11,300	109,836.00	0.07
389	301181	标榜股份	4,740	109,683.60	0.07
390	002882	金龙羽	5,800	109,562.00	0.07
391	002735	王子新材	6,700	108,741.00	0.07
392	688236	春立医疗	7,500	108,450.00	0.07
393	300334	津膜科技	10,400	108,368.00	0.07
394	688737	中自科技	5,651	108,160.14	0.07
395	300221	银禧科技	6,700	107,669.00	0.07
396	002062	宏润建设	15,000	107,400.00	0.07
397	600785	新华百货	10,920	107,016.00	0.07
398	301003	江苏博云	2,000	107,000.00	0.07
399	002706	良信股份	9,800	106,918.00	0.07
400	600020	中原高速	28,900	106,641.00	0.07
401	688697	纽威数控	7,844	106,599.96	0.07
402	301239	普瑞眼科	3,500	106,575.00	0.07
403	300980	祥源新材	3,600	105,876.00	0.07
404	688087	英科再生	3,167	105,841.14	0.07
405	002912	中新赛克	5,700	105,108.00	0.07
406	605286	同力天启	4,100	104,509.00	0.07
407	301468	博盈特焊	2,490	103,857.90	0.07
408	300801	泰和科技	3,200	103,360.00	0.07
409	301155	海力风电	2,400	102,960.00	0.07
410	301226	祥明智能	3,100	102,889.00	0.07
411	603297	永新光学	700	102,865.00	0.07
412	603960	克来机电	5,900	102,719.00	0.07
413	001257	盛龙股份	3,752	102,600.56	0.07
414	300683	海特生物	4,100	102,541.00	0.07
415	300541	先进数通	10,600	102,290.00	0.07
416	300846	首都在线	4,800	101,808.00	0.07
417	600425	青松建化	31,000	101,370.00	0.07
418	301293	三博脑科	2,100	101,178.00	0.07
419	603701	德宏股份	4,600	101,108.00	0.07
420	603013	亚普股份	6,400	101,056.00	0.07
421	601388	怡球资源	35,200	99,616.00	0.07
422	688010	福光股份	2,043	99,351.09	0.07

423	688246	嘉和美康	4,834	99,338.70	0.07
424	301076	新瀚新材	3,770	98,698.60	0.06
425	300171	东富龙	8,900	98,434.00	0.06
426	301310	鑫宏业	1,780	98,327.20	0.06
427	300848	美瑞新材	7,000	97,650.00	0.06
428	301050	雷电微力	2,900	96,976.00	0.06
429	300905	宝丽迪	1,900	96,140.00	0.06
430	688579	地纬智能	12,641	95,945.19	0.06
431	300415	伊之密	4,800	95,568.00	0.06
432	300397	天和防务	6,300	95,382.00	0.06
433	300823	建科智能	6,500	94,770.00	0.06
434	301225	恒勃股份	1,200	94,548.00	0.06
435	002075	沙钢股份	27,500	93,500.00	0.06
436	603829	洛凯股份	5,700	93,309.00	0.06
437	001288	运机集团	3,900	92,781.00	0.06
438	301356	天振股份	3,500	91,945.00	0.06
439	603016	新宏泰	2,700	91,152.00	0.06
440	603722	阿科力	2,300	91,080.00	0.06
441	300829	金丹科技	6,600	90,618.00	0.06
442	300820	英杰电气	1,000	90,230.00	0.06
443	603439	三力制药	7,100	89,531.00	0.06
444	301127	武汉天源	4,300	89,096.00	0.06
445	300844	山水比德	4,000	88,840.00	0.06
446	300673	佩蒂股份	6,600	88,770.00	0.06
447	688267	中触媒	4,484	88,334.80	0.06
448	300521	爱司凯	3,200	88,320.00	0.06
449	300537	广信材料	2,600	87,360.00	0.06
450	603238	诺邦股份	7,900	86,900.00	0.06
451	688312	燕麦科技	1,032	86,677.68	0.06
452	002757	南兴股份	4,800	86,640.00	0.06
453	301266	宇邦新材	3,780	86,335.20	0.06
454	300876	蒙泰高新	6,000	85,980.00	0.06
455	301538	骏鼎达	1,700	85,629.00	0.06
456	300407	凯发电气	7,900	85,320.00	0.06
457	605007	五洲特纸	6,300	84,357.00	0.06
458	920981	晶赛科技	1,900	83,695.00	0.05
459	002606	大连电瓷	6,200	83,142.00	0.05
460	300940	南极光	5,500	82,940.00	0.05
461	301135	瑞德智能	4,990	82,185.30	0.05
462	001366	播恩集团	7,500	81,300.00	0.05
463	300619	金银河	2,600	80,886.00	0.05
464	300680	隆盛科技	3,560	80,883.20	0.05
465	300985	致远新能	2,100	80,850.00	0.05

466	603309	维力医疗	7,200	80,784.00	0.05
466	688035	德邦科技	880	80,784.00	0.05
467	600796	钱江生化	17,400	80,736.00	0.05
468	688375	国博电子	774	80,728.20	0.05
469	002169	智光电气	5,500	80,520.00	0.05
470	601678	滨化股份	12,200	80,398.00	0.05
471	301313	凡拓数创	1,600	80,256.00	0.05
472	301322	绿通科技	1,500	80,025.00	0.05
473	688789	宏华数科	1,502	79,861.34	0.05
474	603583	捷昌驱动	3,500	79,800.00	0.05
475	300154	瑞凌股份	10,600	79,712.00	0.05
476	688129	东来技术	3,009	78,805.71	0.05
477	300246	宝莱特	5,600	78,792.00	0.05
478	688758	赛分科技	3,575	78,685.75	0.05
479	300365	恒华科技	17,100	78,318.00	0.05
480	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.05
481	001268	联合精密	2,200	77,924.00	0.05
482	688228	开普云	1,005	77,726.70	0.05
483	301158	德石股份	5,860	77,293.40	0.05
484	002675	东诚药业	6,100	76,555.00	0.05
485	600855	航天长峰	5,500	76,505.00	0.05
486	600966	博汇纸业	16,000	76,480.00	0.05
487	601595	上海电影	4,600	76,360.00	0.05
488	002541	鸿路钢构	4,400	76,208.00	0.05
489	300143	盈康生命	11,260	75,892.40	0.05
490	301365	矩阵股份	2,000	75,820.00	0.05
491	688416	恒烁股份	540	75,600.00	0.05
492	002857	三晖电气	4,300	75,551.00	0.05
493	002845	同兴达	4,600	75,440.00	0.05
494	688710	益诺思	1,117	75,062.40	0.05
495	300918	南山智尚	7,000	75,040.00	0.05
496	605333	沪光股份	4,400	75,020.00	0.05
497	001248	华润新能源	7,345	74,257.95	0.05
498	000601	韶能股份	12,600	73,710.00	0.05
499	688136	科兴制药	3,543	73,375.53	0.05
500	600814	杭州解百	12,000	73,200.00	0.05
501	603040	新坐标	1,160	73,161.20	0.05
502	002452	长高电气	5,700	72,789.00	0.05
503	002695	煌上煌	7,100	72,065.00	0.05
504	002307	北新路桥	24,900	71,712.00	0.05
505	600285	羚锐制药	3,700	71,706.00	0.05
506	603927	中科软	5,600	71,176.00	0.05
507	300787	海能实业	7,800	71,136.00	0.05

508	300878	维康药业	2,200	71,126.00	0.05
509	301231	荣信文化	2,800	71,008.00	0.05
510	688160	步科股份	652	70,918.04	0.05
511	603381	永臻股份	4,600	70,886.00	0.05
512	688186	广大特材	4,660	70,599.00	0.05
513	301458	钧崴电子	1,200	70,152.00	0.05
514	002959	小熊电器	2,200	69,784.00	0.05
515	301326	捷邦科技	500	69,685.00	0.05
516	600367	红星发展	1,100	69,223.00	0.05
517	300234	开尔新材	5,900	69,148.00	0.05
518	301068	大地海洋	2,900	69,020.00	0.05
519	300349	金卡智能	6,200	67,828.00	0.04
520	600686	金龙汽车	6,000	67,740.00	0.04
521	300501	海顺新材	5,300	67,310.00	0.04
522	600262	北方股份	3,400	67,286.00	0.04
523	688508	芯朋微	723	67,210.08	0.04
524	301227	森鹰窗业	2,660	67,058.60	0.04
525	300858	科拓生物	4,400	66,836.00	0.04
526	603777	来伊份	4,300	66,779.00	0.04
527	301042	安联锐视	1,000	66,700.00	0.04
528	688556	高测股份	4,993	66,307.04	0.04
529	301256	华融化学	5,100	66,096.00	0.04
530	300030	阳普医疗	11,000	63,910.00	0.04
531	300589	江龙船艇	5,400	63,720.00	0.04
532	300562	乐心医疗	4,700	63,497.00	0.04
533	301202	朗威股份	1,900	63,327.00	0.04
534	688718	唯赛勃	3,935	62,841.95	0.04
535	688428	诺诚健华	2,172	61,836.84	0.04
536	301136	招标股份	5,600	61,488.00	0.04
537	300213	佳讯飞鸿	10,100	61,206.00	0.04
538	605277	新亚电子	3,200	60,992.00	0.04
539	300922	天秦装备	4,000	60,600.00	0.04
539	301229	纽泰格	5,000	60,600.00	0.04
540	601226	华电科工	9,500	60,420.00	0.04
541	600792	云煤能源	19,000	60,230.00	0.04
542	300504	天邑股份	3,700	59,681.00	0.04
543	300337	银邦股份	5,100	59,466.00	0.04
544	603286	日盈电子	1,300	59,319.00	0.04
545	301237	和顺科技	800	59,264.00	0.04
546	000672	上峰材料	2,500	59,200.00	0.04
546	300050	世纪鼎利	10,000	59,200.00	0.04
547	300022	吉峰科技	7,600	59,052.00	0.04
548	301201	诚达药业	1,600	58,176.00	0.04

549	603057	紫燕食品	2,600	57,980.00	0.04
550	002833	弘亚数控	3,000	57,870.00	0.04
551	300129	泰胜风能	6,700	57,285.00	0.04
552	301498	乖宝宠物	1,400	56,826.00	0.04
553	920640	富士达	1,800	56,538.00	0.04
554	301090	华润材料	9,000	56,430.00	0.04
555	300891	惠云钛业	8,900	56,337.00	0.04
556	002125	湘潭电化	4,100	56,006.00	0.04
557	603969	银龙股份	7,700	55,979.00	0.04
558	688553	汇宇制药	5,234	55,637.42	0.04
559	605338	巴比食品	3,100	55,490.00	0.04
560	300936	中英科技	500	55,150.00	0.04
561	603151	邦基科技	5,000	54,950.00	0.04
562	688297	中无人机	1,322	54,929.10	0.04
563	301287	康力源	1,700	54,893.00	0.04
564	301408	华人健康	3,800	54,644.00	0.04
565	301023	奕帆传动	1,600	54,320.00	0.04
566	605050	福然德	5,800	54,288.00	0.04
567	603739	蔚蓝生物	4,700	54,191.00	0.04
568	920978	开特股份	2,600	54,158.00	0.04
569	603258	电魂网络	4,500	53,955.00	0.04
570	688103	国力电子	721	53,649.61	0.04
571	301052	果麦文化	2,400	53,328.00	0.03
572	301283	聚胶股份	2,165	52,999.20	0.03
573	605188	国光连锁	4,500	52,605.00	0.03
574	603367	辰欣药业	4,100	52,603.00	0.03
575	600461	洪城环境	5,800	52,548.00	0.03
576	600075	新疆天业	13,000	52,520.00	0.03
577	688609	九联科技	4,770	52,517.70	0.03
578	301518	长华化学	2,000	52,400.00	0.03
579	001280	中国铀业	771	51,425.70	0.03
580	600173	卧龙新能	8,700	51,417.00	0.03
581	600903	贵州燃气	7,700	51,128.00	0.03
582	300753	爱朋医疗	2,700	51,111.00	0.03
583	301329	信音电子	2,100	51,009.00	0.03
584	688726	拉普拉斯	958	50,630.30	0.03
585	920799	艾融软件	1,500	50,340.00	0.03
586	301141	中科磁业	1,200	50,232.00	0.03
587	603130	云中马	1,200	50,100.00	0.03
588	300547	川环科技	1,500	50,085.00	0.03
589	688722	同益中	3,287	49,863.79	0.03
590	600328	中盐化工	8,300	49,800.00	0.03
591	603380	易德龙	1,100	49,599.00	0.03

592	300838	浙江力诺	3,700	49,395.00	0.03
593	601163	三角轮胎	3,800	48,222.00	0.03
594	688226	威腾电气	1,123	48,098.09	0.03
595	300406	九强生物	4,400	48,092.00	0.03
596	001215	千味央厨	1,300	47,970.00	0.03
597	688757	胜科纳米	715	47,690.50	0.03
598	300841	康华生物	1,000	47,560.00	0.03
599	300539	横河精密	2,300	46,851.00	0.03
600	300911	亿田智能	2,200	46,750.00	0.03
601	300109	新开源	2,900	46,545.00	0.03
602	603836	海程邦达	5,880	46,452.00	0.03
603	301066	万事利	4,000	46,440.00	0.03
604	600638	新黄浦	10,600	46,322.00	0.03
605	300134	大富科技	5,400	46,170.00	0.03
606	301186	超达装备	1,120	45,920.00	0.03
607	002238	天威视讯	8,500	45,900.00	0.03
608	301133	金钟股份	1,200	45,840.00	0.03
609	300614	百川畅银	4,700	45,496.00	0.03
610	001313	粤海饲料	6,400	45,376.00	0.03
611	688601	力芯微	742	44,928.10	0.03
612	688326	经纬恒润	619	43,874.72	0.03
613	688355	明志科技	2,271	43,716.75	0.03
614	920571	国航远洋	5,400	43,578.00	0.03
615	002923	润都股份	4,600	43,516.00	0.03
616	301268	铭利达	3,100	43,338.00	0.03
617	000837	秦川机床	3,900	43,329.00	0.03
618	603697	有友食品	4,500	43,155.00	0.03
619	301376	致欧科技	2,400	42,528.00	0.03
620	688818	电科蓝天	565	41,894.75	0.03
621	300482	万孚生物	2,500	41,525.00	0.03
622	688665	四方光电	625	41,062.50	0.03
623	300996	普联软件	3,760	40,946.40	0.03
624	688517	金冠电气	2,334	40,798.32	0.03
625	300048	合康新能	8,700	40,629.00	0.03
626	300298	三诺生物	2,900	40,455.00	0.03
627	920953	国子软件	1,800	40,050.00	0.03
628	300906	日月明	1,600	39,888.00	0.03
629	920821	则成电子	2,000	39,820.00	0.03
630	603118	共进股份	3,200	38,752.00	0.03
631	301367	瑞迈特	1,000	38,660.00	0.03
632	301037	保立佳	3,200	38,400.00	0.03
633	301163	宏德股份	1,700	37,706.00	0.02
634	002434	万里扬	6,200	37,510.00	0.02

635	688212	澳华内镜	1,270	37,338.00	0.02
636	300320	海达股份	3,900	37,206.00	0.02
637	920961	创远信科	1,500	36,885.00	0.02
638	301007	德迈仕	1,200	36,720.00	0.02
639	603558	健盛集团	3,300	36,597.00	0.02
640	600971	恒源煤电	5,300	36,570.00	0.02
641	300778	新城市	3,800	36,290.00	0.02
642	600446	金证股份	3,600	36,216.00	0.02
643	300615	欣天科技	3,600	36,108.00	0.02
644	300837	浙矿股份	1,500	35,640.00	0.02
645	002540	亚太科技	7,600	35,492.00	0.02
646	002160	常铝股份	9,600	35,136.00	0.02
647	600195	中牧股份	5,900	34,810.00	0.02
648	300766	每日互动	1,600	34,240.00	0.02
649	920593	鼎智科技	1,200	34,080.00	0.02
650	000915	华特达因	1,200	33,972.00	0.02
651	600138	中青旅	5,200	33,956.00	0.02
652	300743	天地数码	2,300	33,557.00	0.02
653	301263	泰恩康	1,600	32,784.00	0.02
654	603889	新澳股份	6,400	32,704.00	0.02
655	002852	道道全	4,600	32,614.00	0.02
656	300138	晨光生物	3,600	32,400.00	0.02
657	301393	昊帆生物	500	32,385.00	0.02
658	605116	奥锐特	1,700	32,164.00	0.02
659	300414	中光防雷	2,900	31,958.00	0.02
660	300471	厚普股份	3,700	31,857.00	0.02
661	600718	东软集团	4,400	31,856.00	0.02
662	000533	顺钠股份	3,300	31,383.00	0.02
663	002178	延华智能	7,200	31,248.00	0.02
664	300923	研奥股份	1,400	31,192.00	0.02
665	300043	星辉娱乐	7,100	30,885.00	0.02
666	600929	雪天盐业	6,800	30,872.00	0.02
667	003030	祖名股份	1,500	30,825.00	0.02
668	002537	海联金汇	5,800	30,682.00	0.02
669	001399	惠科股份	870	30,658.80	0.02
670	603090	宏盛股份	600	30,636.00	0.02
671	688335	复洁科技	1,266	30,434.64	0.02
672	002083	孚日股份	2,900	30,421.00	0.02
673	603279	景津装备	2,500	30,000.00	0.02
674	300389	艾比森	2,300	29,486.00	0.02
675	300523	辰安科技	1,600	29,408.00	0.02
676	301665	泰禾股份	1,400	29,344.00	0.02
677	688325	赛微微电	225	29,342.25	0.02

678	920946	森萱医药	3,000	29,280.00	0.02
679	601789	宁波建工	7,300	29,273.00	0.02
680	603126	中材节能	4,600	28,980.00	0.02
681	301179	泽宇智能	1,400	28,644.00	0.02
682	688232	新点软件	1,589	28,252.42	0.02
683	600288	大恒科技	2,100	27,930.00	0.02
684	002530	金财互联	4,100	27,880.00	0.02
685	002641	公元股份	7,200	27,792.00	0.02
686	301083	百胜智能	2,100	27,657.00	0.02
687	300055	万邦达	4,300	27,649.00	0.02
688	600649	城投控股	8,000	27,600.00	0.02
688	920914	远航精密	1,500	27,600.00	0.02
689	300228	富瑞特装	3,700	27,380.00	0.02
690	688611	杭州柯林	383	27,365.35	0.02
691	603506	南都物业	2,900	27,086.00	0.02
692	300809	华辰装备	1,000	27,050.00	0.02
693	301103	何氏眼科	1,800	26,964.00	0.02
694	300851	交大思诺	1,200	26,700.00	0.02
695	605507	国邦医药	1,800	26,640.00	0.02
696	300470	中密控股	900	26,109.00	0.02
697	301047	义翘神州	400	25,824.00	0.02
698	688505	复旦张江	3,488	25,741.44	0.02
699	002279	久其软件	4,500	25,740.00	0.02
700	000985	大庆华科	1,800	25,614.00	0.02
701	002637	赞宇科技	2,400	25,272.00	0.02
702	600315	上海家化	1,500	25,230.00	0.02
703	688007	光峰科技	1,876	24,950.80	0.02
704	002733	雄韬股份	800	24,784.00	0.02
705	301209	联合化学	440	24,442.00	0.02
706	603281	江瀚新材	600	24,378.00	0.02
707	603886	元祖股份	1,900	24,282.00	0.02
708	001336	楚环科技	1,100	24,222.00	0.02
709	301682	宏明电子	149	23,831.06	0.02
710	600724	宁波富达	4,700	23,829.00	0.02
710	601007	金陵饭店	3,900	23,829.00	0.02
711	002218	拓日新能	6,200	23,808.00	0.02
712	300885	海昌新材	1,000	23,770.00	0.02
713	301595	太力科技	600	23,760.00	0.02
714	001333	光华股份	1,300	23,751.00	0.02
715	300946	恒而达	600	23,634.00	0.02
716	001234	泰慕士	1,200	23,568.00	0.02
717	688558	国盛智科	712	23,396.32	0.02
718	300880	迦南智能	1,100	23,375.00	0.02

719	600668	尖峰集团	3,200	23,328.00	0.02
720	600232	金鹰股份	3,700	23,310.00	0.02
721	300708	聚灿光电	2,700	23,166.00	0.02
722	688112	鼎阳科技	314	23,066.44	0.02
723	301113	雅艺科技	1,540	22,961.40	0.02
724	301381	赛维时代	1,204	22,201.76	0.01
725	300702	天宇股份	1,100	22,176.00	0.01
726	300270	中威电子	1,700	22,117.00	0.01
727	300609	汇纳科技	700	21,994.00	0.01
728	301587	中瑞股份	1,000	21,950.00	0.01
729	688658	悦康药业	1,691	21,746.26	0.01
730	300584	海辰药业	600	21,738.00	0.01
731	603400	华之杰	400	21,608.00	0.01
732	688683	莱尔科技	565	21,424.80	0.01
733	605179	一鸣食品	1,700	21,369.00	0.01
734	603209	兴通股份	1,700	21,301.00	0.01
735	920873	中设咨询	3,100	21,142.00	0.01
736	300833	浩洋股份	700	21,126.00	0.01
737	002451	摩恩电气	3,000	21,120.00	0.01
738	688021	奥福科技	1,085	21,005.60	0.01
739	603615	茶花股份	1,300	20,995.00	0.01
740	603326	我乐家居	3,400	20,944.00	0.01
741	301567	贝隆精密	600	20,766.00	0.01
742	002186	全聚德	2,500	20,700.00	0.01
743	600955	维远股份	1,400	20,608.00	0.01
744	688586	江航装备	1,739	20,328.91	0.01
745	688338	赛科希德	687	20,273.37	0.01
746	603676	卫信康	2,500	20,125.00	0.01
747	301149	隆华新材	1,900	20,102.00	0.01
748	600391	航发科技	600	20,070.00	0.01
749	301073	君亭酒店	1,100	20,020.00	0.01
750	300141	和顺电气	2,100	19,719.00	0.01
751	920879	基康技术	1,500	19,710.00	0.01
752	001388	信通电子	700	19,229.00	0.01
753	920735	德源药业	800	19,088.00	0.01
754	002811	郑中设计	1,700	19,023.00	0.01
755	603706	东方环宇	1,100	19,019.00	0.01
756	601599	浙文影业	6,800	18,972.00	0.01
757	002813	路畅科技	1,000	18,900.00	0.01
758	603035	常熟汽饰	1,700	18,054.00	0.01
759	301589	诺瓦星云	120	17,877.60	0.01
760	920809	安达科技	2,000	17,860.00	0.01
761	002806	华锋股份	900	17,280.00	0.01

762	920924	广脉科技	1,200	17,184.00	0.01
763	603895	天永智能	600	17,034.00	0.01
764	003040	楚天龙	1,600	16,992.00	0.01
765	605066	天正电气	2,500	16,975.00	0.01
766	300425	中建环能	4,500	16,830.00	0.01
767	300847	中船汉光	1,300	16,822.00	0.01
768	300426	华智数媒	3,300	16,698.00	0.01
769	000700	模塑科技	1,100	16,236.00	0.01
770	002632	道明光学	1,800	16,218.00	0.01
771	600054	黄山旅游	1,500	16,155.00	0.01
772	300505	川金诺	700	16,065.00	0.01
773	603383	顶点软件	600	15,936.00	0.01
774	002286	保龄宝	1,900	15,675.00	0.01
775	301228	实朴检测	200	15,632.00	0.01
776	920950	迅安科技	1,300	15,496.00	0.01
777	300519	新光药业	1,300	15,405.00	0.01
778	920892	广咨国际	1,400	15,358.00	0.01
779	601089	福元医药	900	14,652.00	0.01
780	920926	鸿智科技	1,500	14,325.00	0.01
781	920699	海达尔	200	14,298.00	0.01
782	688117	圣诺生物	528	14,271.84	0.01
783	605488	福莱新材	500	14,180.00	0.01
784	301065	本立科技	800	14,120.00	0.01
785	002765	蓝黛科技	2,000	13,920.00	0.01
786	600059	古越龙山	1,900	13,908.00	0.01
787	920770	艾能聚	1,300	13,793.00	0.01
788	600218	全柴动力	1,900	13,718.00	0.01
789	600639	浦东金桥	1,500	13,680.00	0.01
790	603848	好太太	1,000	13,660.00	0.01
791	920932	科达自控	1,100	13,629.00	0.01
792	600129	太极集团	1,000	13,570.00	0.01
793	920974	凯大催化	2,300	13,524.00	0.01
794	002791	坚朗五金	1,000	13,100.00	0.01
795	605001	威奥股份	2,400	13,080.00	0.01
796	300119	瑞普生物	900	12,987.00	0.01
797	688073	毕得医药	237	12,755.34	0.01
798	920895	花溪科技	1,100	12,518.00	0.01
799	300862	蓝盾光电	600	12,504.00	0.01
800	301669	高特电子	333	12,494.16	0.01
801	300380	安硕信息	400	12,308.00	0.01
802	920970	大禹生物	2,300	12,259.00	0.01
803	603071	物产环能	1,100	12,166.00	0.01
804	301638	南网数字	492	11,832.60	0.01

805	920943	优机股份	900	11,736.00	0.01
806	920964	润农节水	2,700	11,610.00	0.01
807	301531	春光集团	173	11,573.70	0.01
808	688370	从麟科技	553	11,568.76	0.01
809	920925	锦好医疗	1,100	11,550.00	0.01
810	002445	中南文化	4,000	11,360.00	0.01
811	002093	国脉科技	1,800	11,340.00	0.01
812	300741	华宝股份	900	11,268.00	0.01
813	920885	星辰科技	900	11,241.00	0.01
814	300971	博亚精工	600	11,196.00	0.01
815	920493	并行科技	100	11,066.00	0.01
816	920931	无锡鼎邦	1,200	10,644.00	0.01
817	920942	恒立钻具	600	10,638.00	0.01
818	920992	中科美菱	900	10,359.00	0.01
819	920906	舜宇精工	600	10,326.00	0.01
820	688080	映翰通	236	10,207.00	0.01
821	300542	新晨科技	900	9,972.00	0.01
822	301516	中远通	700	9,905.00	0.01
823	002760	凤形股份	600	9,852.00	0.01
824	002206	海利得	1,900	9,823.00	0.01
825	688638	誉辰智能	314	9,787.38	0.01
826	688682	霍莱沃	250	9,725.00	0.01
827	603860	中公高科	400	9,676.00	0.01
828	002827	高争民爆	400	9,656.00	0.01
829	301696	三瑞智能	92	9,641.60	0.01
830	600650	锦江在线	1,000	9,640.00	0.01
831	300314	戴维医疗	1,000	9,310.00	0.01
832	002967	广电计量	500	9,025.00	0.01
833	301056	森赫股份	800	8,960.00	0.01
834	002644	佛慈制药	1,300	8,853.00	0.01
835	603590	康辰药业	300	8,703.00	0.01
836	002448	中原内配	700	8,610.00	0.01
837	300569	天能重工	1,700	8,194.00	0.01
838	300559	佳发教育	800	8,184.00	0.01
839	920985	海泰新能	1,700	8,092.00	0.01
840	300947	德必集团	600	7,650.00	0.01
841	600982	宁波能源	1,600	7,616.00	0.00
842	301599	理奇智能	185	7,522.10	0.00
843	300575	中旗股份	1,500	7,380.00	0.00
844	002780	三夫户外	600	7,284.00	0.00
845	301687	新广益	94	7,213.56	0.00
846	605339	南侨食品	600	7,164.00	0.00
847	001298	好上好	345	7,158.75	0.00

848	002393	力生制药	500	7,095.00	0.00
849	301258	富士莱	300	6,831.00	0.00
850	920957	汉维科技	800	6,712.00	0.00
851	600318	新力金融	1,100	6,622.00	0.00
852	002494	华斯股份	1,400	6,216.00	0.00
853	301513	尚水智能	97	6,153.68	0.00
854	301318	维海德	300	6,120.00	0.00
855	300187	永清环保	1,200	6,060.00	0.00
856	300968	格林精密	600	5,784.00	0.00
857	001365	天海电子	157	5,776.03	0.00
858	300092	科新机电	500	5,770.00	0.00
859	601908	京运通	1,800	5,634.00	0.00
860	002187	广百股份	1,200	5,616.00	0.00
861	301680	固德电材	50	5,606.50	0.00
862	300945	曼卡龙	500	5,415.00	0.00
863	301535	浙江华远	400	5,368.00	0.00
864	600736	苏州高新	800	5,352.00	0.00
865	002970	锐明技术	100	5,343.00	0.00
866	001393	维通利	108	5,235.84	0.00
867	603227	雪峰科技	700	4,914.00	0.00
868	301622	英思特	100	4,710.00	0.00
869	301683	慧谷新材	35	4,524.45	0.00
870	300447	全信股份	300	4,479.00	0.00
871	688602	康鹏科技	511	4,026.68	0.00
872	001332	锡装股份	100	3,927.00	0.00
873	600980	北矿科技	200	3,750.00	0.00
874	920896	旺成科技	300	3,669.00	0.00
875	001233	海安集团	78	3,486.60	0.00
876	300662	科锐国际	200	3,396.00	0.00
877	601061	中信金属	300	3,231.00	0.00
878	603098	森特股份	300	3,165.00	0.00
879	600640	国脉文化	300	2,901.00	0.00
880	603095	越剑智能	200	2,864.00	0.00
881	603585	苏利股份	200	2,734.00	0.00
882	300845	捷安高科	200	2,656.00	0.00
883	301539	宏鑫科技	200	2,620.00	0.00
884	001369	双欣材料	192	2,595.84	0.00
885	603059	倍加洁	100	2,425.00	0.00
886	301212	联盛化学	100	2,335.00	0.00
887	300507	苏奥传感	300	2,259.00	0.00
888	301020	密封科技	100	2,184.00	0.00
889	002026	山东威达	200	2,160.00	0.00
890	300856	科思股份	200	2,132.00	0.00

891	605028	世茂能源	100	2,130.00	0.00
892	002917	金奥博	200	2,108.00	0.00
893	001286	陕西能源	200	2,028.00	0.00
894	600284	浦东建设	400	1,944.00	0.00
895	001396	誉帆科技	54	1,912.68	0.00
896	300188	国投智能	200	1,870.00	0.00
897	600106	重庆路桥	400	1,832.00	0.00
898	002376	新北洋	300	1,725.00	0.00
899	301153	中科江南	100	1,629.00	0.00
900	002649	博彦科技	200	1,628.00	0.00
901	300021	大禹节水	400	1,596.00	0.00
902	600501	航天晨光	100	1,573.00	0.00
903	603987	康德莱	200	1,380.00	0.00
904	600756	浪潮软件	100	1,224.00	0.00
905	300232	洲明科技	200	1,146.00	0.00
906	001312	福恩股份	54	982.80	0.00
907	002930	宏川智慧	100	920.00	0.00
908	002488	金固股份	100	891.00	0.00
909	002343	慈文传媒	200	872.00	0.00
910	001220	世盟股份	31	860.87	0.00
911	600770	综艺股份	100	700.00	0.00
912	002511	中顺洁柔	100	665.00	0.00
913	002998	优彩资源	100	651.00	0.00
914	300335	迪森股份	100	487.00	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	300731	科创新源	1,561,037.00	1.44
2	301566	达利凯普	1,482,924.00	1.37
3	301013	利和兴	1,455,963.00	1.34
4	301246	宏源药业	1,415,346.00	1.31
5	301282	金禄电子	1,410,463.00	1.30
6	300790	宇瞳光学	1,212,696.00	1.12
7	600184	光电股份	1,196,885.00	1.10
8	300819	聚杰微纤	1,179,688.00	1.09
9	002039	黔源电力	1,117,759.00	1.03
10	688598	金博股份	1,108,959.27	1.02
11	300222	科大智能	1,102,591.00	1.02
12	300031	宝通科技	1,072,554.00	0.99
13	300853	申昊科技	1,059,385.00	0.98
14	301568	思泰克	1,047,804.00	0.97

15	300489	光智科技	1,044,179.00	0.96
16	300483	首华燃气	1,042,045.00	0.96
17	002272	川润股份	1,010,711.00	0.93
18	300221	银禧科技	1,003,281.00	0.93
19	300749	顶固集创	999,615.00	0.92
20	688786	悦安新材	986,785.88	0.91

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	301013	利和兴	1,793,723.00	1.65
2	000570	苏常柴 A	1,243,722.00	1.15
3	002943	宇晶股份	1,198,256.00	1.10
4	300139	晓程科技	1,168,005.00	1.08
5	002975	博杰股份	1,148,371.60	1.06
6	300680	隆盛科技	1,140,118.00	1.05
7	301282	金禄电子	1,025,033.60	0.95
8	300489	光智科技	1,024,754.00	0.94
9	301005	超捷股份	1,005,560.00	0.93
10	600184	光电股份	998,323.00	0.92
11	300806	斯迪克	993,013.00	0.92
12	000534	万泽股份	985,601.00	0.91
13	301319	唯特偶	974,712.85	0.90
14	603319	美湖股份	964,832.00	0.89
15	301228	实朴检测	954,862.00	0.88
16	300700	岱勒新材	948,429.00	0.87
17	688031	星环科技	931,982.43	0.86
18	300221	银禧科技	918,019.00	0.85
19	002491	通鼎互联	892,930.00	0.82
20	688598	金博股份	883,202.78	0.81

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	380,075,428.14
卖出股票收入（成交）总额	361,908,317.31

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	8,573,962.22	5.61
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	8,573,962.22	5.61

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	019827	26 国债 01	47,000	4,730,465.01	3.10
2	019792	25 国债 19	21,000	2,122,033.89	1.39
3	019785	25 国债 13	17,000	1,721,463.32	1.13

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	27,960.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	101,747.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,707.75

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（%）
东方量化成长灵活配置混合A	29,665	2,450.08	14,419,225.45	19.84	58,262,425.53	80.16
东方量化	1,293	3,411.88	0.00	0.00	4,411,564.75	100.00

成长灵活配置混合 C						
合计	30,958	2,490.25	14,419,225.45	18.70	62,673,990.28	81.30

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（%）	96.55

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	东方量化成长灵活配置混合 A	345,260.23	0.48
	东方量化成长灵活配置混合 C	67,114.91	1.52
	合计	412,375.14	0.53

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 21 日）基金份额总额	694,463,618.20	—
本报告期期初基金份额总额	57,994,126.78	5,061,967.59
本报告期基金总申购份额	33,591,402.78	8,511,156.80
减：本报告期基金总赎回份额	18,903,878.58	9,161,559.64

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	72,681,650.98	4,411,564.75

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，并已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 (%)	
华西证券股份有限公司	2	272,073,673.82	36.69	121,320.18	36.81	-
长城证券股份有限公司	1	212,720,027.57	28.68	94,852.13	28.78	-
国泰海通证券股份有限公司	1	115,117,735.54	15.52	51,331.54	15.57	-
国投证券股份有限公司	1	106,547,772.35	14.37	47,510.59	14.41	-
华泰证券股份有限公司	1	11,586,010.42	1.56	5,166.16	1.57	-
国联民生证券股份有限公司	2	9,135,310.13	1.23	3,159.74	0.96	-
华创证券有限责任公司	1	7,942,186.36	1.07	3,540.75	1.07	-
东北证券股份有限公司	2	2,756,081.47	0.37	1,228.86	0.37	-
中信建投证券股份有限公司	2	2,466,254.64	0.33	932.31	0.28	-
国信证券	1	1,271,667.24	0.17	567.06	0.17	-

股份有限 公司						
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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) 本基金本报告期交易单元无变化。

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(%)
华西证券股份有限公司	11,602,863.00	84.66	25,000,000.00	75.76	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	500,350.00	3.65	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限	1,401,836.00	10.23	4,000,000.00	12.12	-	-

责任公司						
东北证券股份有限公司	200,246.00	1.46	4,000,000.00	12.12	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

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	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
2	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
3	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
4	东方量化成长灵活配置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
5	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
6	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
7	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 2 月 25 日
8	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
9	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	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2026 年 3 月 17 日

	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	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
17	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
18	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

19	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
20	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
21	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
22	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
23	东方量化成长灵活配置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
24	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
25	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
26	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（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 4 月 30 日
27	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 30 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

		露网站	
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 – 20260126	14, 419, 22 5. 45	0. 00	0. 00	14, 419, 225. 45	18. 70
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、《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

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