

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	92
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	92
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	92
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	92
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	92
8.12 投资组合报告附注 .....	93
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>93</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	94
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	94
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>94</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>95</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	95
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	95
11.4 基金投资策略的改变 .....	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	95
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	96
11.8 其他重大事件 .....	100
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>105</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	105
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>105</b>
13.1 备查文件目录 .....	105
13.2 存放地点 .....	105
13.3 查阅方式 .....	106

## § 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	48,223,380.39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	43,353,886.63份	4,869,493.76份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年	2023 年 11 月 24 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	2022 年	
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C

						C
本期已实现收益	-68,986,467.85	-1,510,883.98	18,486,216.01	-101,920.88	-2,287,413.12	-
本期利润	-66,839,895.53	-3,949,543.87	18,921,025.86	-15,142.26	-3,455,411.04	-
加权平均基金份额本期利润	-0.8544	-0.3901	0.2704	-0.0031	-0.2642	-
本期加权平均净值利润率	-81.59%	-28.09%	19.38%	-0.20%	-18.15%	-
本期基金份额净值增长率	3.17%	2.66%	13.43%	-0.23%	-15.91%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	8,109,982.91	2,887,493.99	51,689,186.42	4,728,766.40	4,285,847.03	-
期末可供分配基金份额利润	0.1871	0.5930	0.1506	0.5517	0.3593	-
期末基金资产净值	51,463,869.54	7,756,987.75	394,881,734.22	13,300,099.02	16,213,385.02	-

期末基金份额净值	1.1871	1.5930	1.1506	1.5517	1.3593	-
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	59.08%	2.42%	54.19%	-0.23%	35.93%	-

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	5.81%	2.47%	8.08%	2.53%	-2.27%	-0.06%
过去六个月	24.80%	2.24%	26.23%	2.27%	-1.43%	-0.03%
过去一年	3.17%	2.29%	-1.68%	2.32%	4.85%	-0.03%
过去三年	-1.59%	1.59%	-18.43%	1.46%	16.84%	0.13%
过去五年	42.35%	1.49%	1.65%	1.24%	40.70%	0.25%
自基金合同生效起至今	59.08%	1.40%	-3.97%	1.16%	63.05%	0.24%

东方量化成长灵活配置混合 C

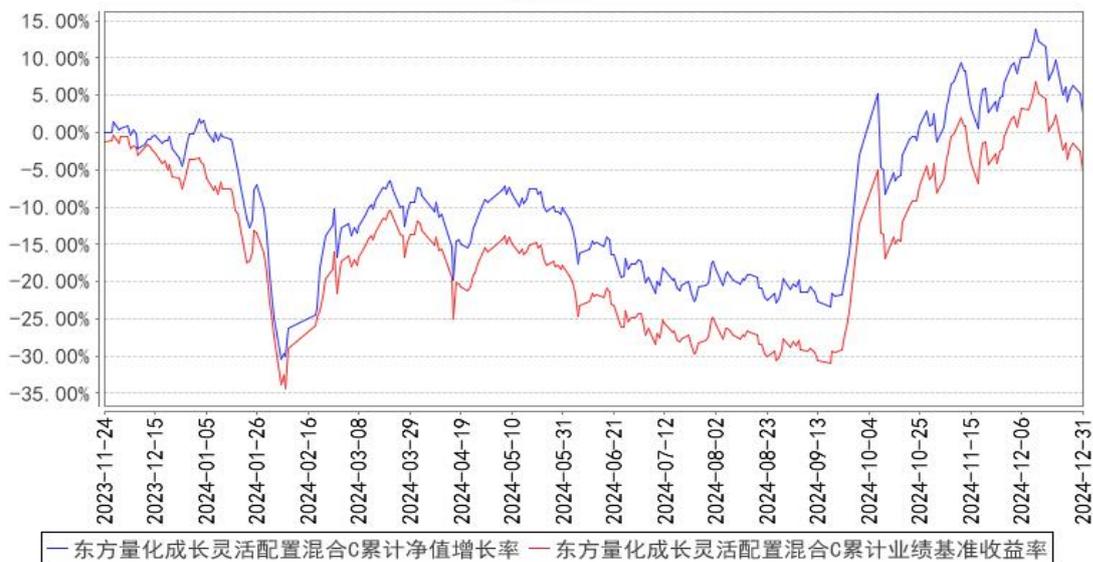
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.68%	2.47%	8.08%	2.53%	-2.40%	-0.06%
过去六个月	24.49%	2.24%	26.23%	2.27%	-1.74%	-0.03%
过去一年	2.66%	2.29%	-1.68%	2.32%	4.34%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	2.42%	2.19%	-5.20%	2.23%	7.62%	-0.04%

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

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

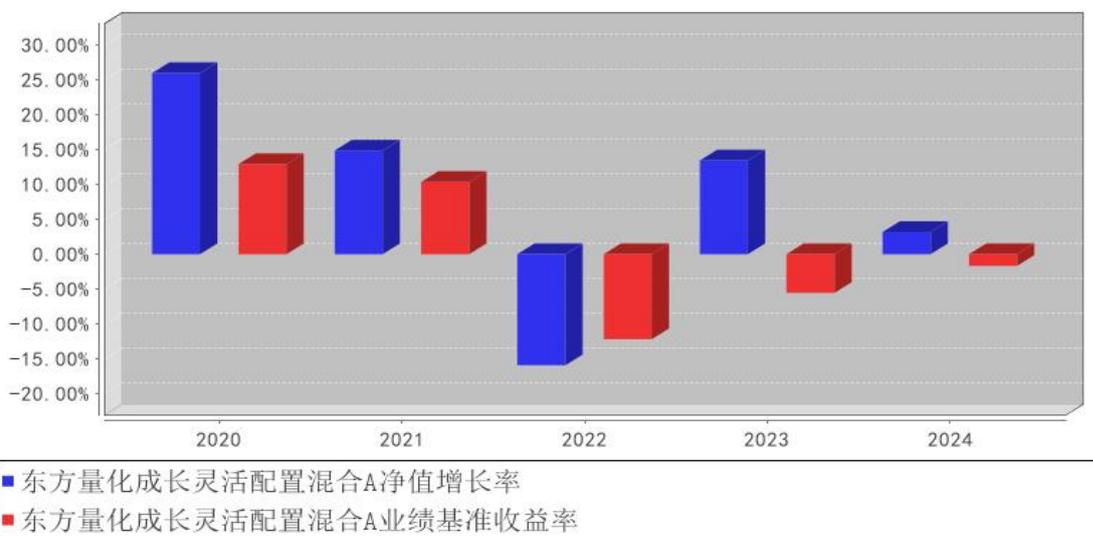


东方量化成长灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

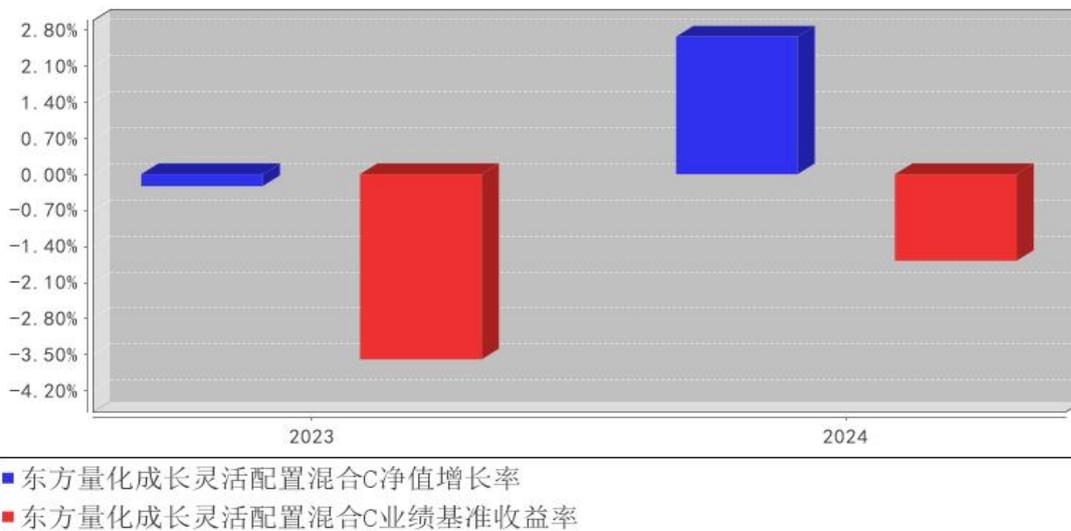


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复，于2004年6月11日成立。

截至2024年12月31日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止 2024 年 12 月 31 日, 本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方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、东方招益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	2018年8月13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、量化投资部副总经理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证500指数增强型证券投资基金基金经理，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：①2025年1月14日，公司发布了《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，自2025年1月14日起盛泽先生不再担任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2025年3月12日，公司发布了《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2025年3月12日起盛泽先生不再担任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

②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。

③证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易管理制度的规定

对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95%的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2024 年于整个量化行业来说都较为坎坷，量化策略本质上是在没有新的外力的情况下，预测系统基于惯性的自发运行方向，但 2024 年却是一个反反复复被外力冲击的系统，因此从 ALPHA 的角度难度较大。从 BETA 角度，小盘股在这一年中经历过多次大幅下跌，使得产品净值出现过较大回撤。总结 2024 年的教训，产品未来将在保持基本策略的同时，更加注重风险管理，严格控制相对于基准指数的偏离，努力创造更加稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 3.17%，业绩比较基准收益率为-1.68%，高于业绩比较基准 4.85%；本基金 C 类净值增长率为 2.66%，业绩比较基准收益率为-1.68%，高于业绩比较基准 4.34%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年政府工作报告释放了积极信号，宏观经济有望保持稳健增长。报告提出国内生产总值增长目标为 5%左右，财政政策更加积极，赤字率提升至 4%，并计划加大发行超长期特别国债和地方专项债券，这将为经济发展提供有力支撑。货币政策适度宽松，适时降准降息，保持流动性充裕，有助于提振市场对于宏观经济的信心。

证券市场方面，报告强调推动资本市场改革，优化股票发行上市和并购重组制度，促进中长期资金入市，增强市场稳定性。创新驱动和产业升级的持续推进，特别是数字经济、绿色经济等新兴领域的发展，将为资本市场注入新动能。总体来看，对于证券市场，政策环境趋于友好，市场预期有望逐步改善。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### 1. 委员会主任

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

##### 2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

⑤负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

### 3. 投研部门

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

### 4. 合规法务部、风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基

金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2507106 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该基金管理人东方基金管理股份有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评</p>

	价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	龚凯	楼竹君
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025年3月28日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	6,989,954.01	4,171,394.15
结算备付金		1,913,819.23	5,132,890.33
存出保证金		21,833.32	123,607.75
交易性金融资产	7.4.7.2	57,363,193.95	400,982,549.19
其中：股票投资		53,431,312.99	378,907,887.82
基金投资		-	-
债券投资		3,931,880.96	22,074,661.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	2,553,804.08
应收股利		-	-
应收申购款		79,120.81	831,792.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		66,367,921.32	413,796,038.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-139.43	-
应付清算款		2,629,253.10	2,835,591.82
应付赎回款		4,200,957.20	1,261,664.05
应付管理人报酬		68,324.38	438,896.39
应付托管费		11,387.38	73,149.42
应付销售服务费		3,811.86	3,874.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	233,469.54	1,001,028.44
负债合计		7,147,064.03	5,614,204.89
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	48,223,380.39	351,763,880.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	10,997,476.90	56,417,952.82
净资产合计		59,220,857.29	408,181,833.24
负债和净资产总计		66,367,921.32	413,796,038.13

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，东方量化成长灵活配置混合 A 基金份额净值 1.1871 元，基金份额总额 43,353,886.63 份；东方量化成长灵活配置混合 C 基金份额净值 1.5930 元，基金份额总额 4,869,493.76 份。东方量化成长灵活配置混合份额总额合计为 48,223,380.39 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-69,200,775.81	20,284,182.23
1. 利息收入		60,735.74	30,645.93
其中：存款利息收入	7.4.7.10	60,634.08	30,645.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-

其他利息收入		101.66	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-70,729,422.54	19,239,281.32
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-71,868,041.42	18,967,769.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	153,831.57	84,141.79
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	226,267.66	-
股利收益	7.4.7.16	758,519.65	187,369.92
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-292,087.57	521,588.47
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	1,759,998.56	492,666.51
<b>减：二、营业总支出</b>		1,588,663.59	1,378,298.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,150,648.68	1,124,019.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	191,774.74	192,977.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	69,881.09	3,896.35
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		23,078.31	105.50
其中：卖出回购金融资产 支出		23,078.31	105.50
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		815.77	-
8. 其他费用	7.4.7.20	152,465.00	57,300.00
<b>三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）</b>		-70,789,439.40	18,905,883.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以 “-”号填列）</b>		-70,789,439.40	18,905,883.60
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-70,789,439.40	18,905,883.60

### 7.3 净资产变动表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-303,540,500.03	-	-45,420,475.92	-348,960,975.95
(一)、综合收益总额	-	-	-70,789,439.40	-70,789,439.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-303,540,500.03	-	25,368,963.48	-278,171,536.55
其中：1. 基金申购款	178,215,023.74	-	39,291,196.38	217,506,220.12
2. 基金赎回款	-481,755,523.77	-	-13,922,232.90	-495,677,756.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	48,223,380.39	-	10,997,476.90	59,220,857.29
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	11,927,537.99	-	4,285,847.03	16,213,385.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,927,537.99	-	4,285,847.03	16,213,385.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	339,836,342.43	-	52,132,105.79	391,968,448.22
(一)、综合收益总额	-	-	18,905,883.60	18,905,883.60
(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)	339,836,342.43	-	165,237,990.08	505,074,332.51
其中：1. 基金申购款	402,268,390.79	-	193,202,622.43	595,471,013.22
2. 基金赎回款	-62,432,048.36	-	-27,964,632.35	-90,396,680.71
(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)	-	-	-132,011,767.89	-132,011,767.89
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏

刘鸿鹏

王丹丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

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

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

## (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (1) 金融工具的初始确认

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

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

#### (2) 金融工具的后续计量

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

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

#### (3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

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

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

#### (4) 金融工具的减值

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

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

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

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持有的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按

票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

#### 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

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

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

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利

差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	6,989,954.01	4,171,394.15
等于：本金	6,989,311.34	4,170,229.16
加：应计利息	642.67	1,164.99
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	6,989,954.01	4,171,394.15

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	53,528,570.65	-	53,431,312.99	-97,257.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	24,890.96	3,931,880.96	3,787.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	24,890.96	3,931,880.96	3,787.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,431,773.65	24,890.96	57,363,193.95	-93,470.66
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	378,742,208.63	-	378,907,887.82	165,679.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	204,391.37	22,074,661.37	32,937.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	204,391.37	22,074,661.37	32,937.72
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	400,579,540.91	204,391.37	400,982,549.19	198,616.91

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,002.93	530.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	105,466.61	971,498.25
其中：交易所市场	105,466.61	971,498.25
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	124,000.00	29,000.00
合计	233,469.54	1,001,028.44

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	343,192,547.80	343,192,547.80
本期申购	84,659,219.98	84,659,219.98
本期赎回（以“-”号填列）	-384,497,881.15	-384,497,881.15
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	43,353,886.63	43,353,886.63

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,571,332.62	8,571,332.62
本期申购	93,555,803.76	93,555,803.76
本期赎回（以“-”号填列）	-97,257,642.62	-97,257,642.62
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	4,869,493.76	4,869,493.76

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	172,807,339.88	-121,118,153.46	51,689,186.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	172,807,339.88	-121,118,153.46	51,689,186.42
本期利润	-68,986,467.85	2,146,572.32	-66,839,895.53
本期基金份额交易产生的变动数	-82,450,783.78	105,711,475.80	23,260,692.02
其中：基金申购款	29,525,621.64	-26,415,955.53	3,109,666.11
基金赎回款	-111,976,405.42	132,127,431.33	20,151,025.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,370,088.25	-13,260,105.34	8,109,982.91

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	7,650,375.16	-2,921,608.76	4,728,766.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,650,375.16	-2,921,608.76	4,728,766.40
本期利润	-1,510,883.98	-2,438,659.89	-3,949,543.87
本期基金份额交易产生的变动数	-1,901,401.21	4,009,672.67	2,108,271.46

生的变动数			
其中：基金申购款	58,838,943.32	-22,657,413.05	36,181,530.27
基金赎回款	-60,740,344.53	26,667,085.72	-34,073,258.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,238,089.97	-1,350,595.98	2,887,493.99

#### 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	23,511.92	20,740.79
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	34,577.93	9,632.62
其他	2,544.23	272.52
合计	60,634.08	30,645.93

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,868,041.42	18,967,769.61
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	-71,868,041.42	18,967,769.61

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	1,770,332,103.99	1,099,293,285.69

减：卖出股票成本总额	1,839,220,701.36	1,078,439,112.27
减：交易费用	2,979,444.05	1,886,403.81
买卖股票差价收入	-71,868,041.42	18,967,769.61

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	103,400.85	91,886.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	50,430.72	-7,744.72
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	153,831.57	84,141.79

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,244,494.30	10,565,470.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,862,550.28	10,481,783.72
减：应计利息总额	331,513.30	91,431.47
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	50,430.72	-7,744.72

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股指期货投资收益	226,267.66	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	758,519.65	187,369.92
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	758,519.65	187,369.92

#### 7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	-292,087.57	521,588.47
股票投资	-262,936.85	485,374.75
债券投资	-29,150.72	36,213.72
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值	-	-

变动产生的预估增值税		
合计	-292,087.57	521,588.47

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	1,698,144.74	488,646.27
基金转换费收入	61,853.82	4,020.24
合计	1,759,998.56	492,666.51

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	35,000.00	20,000.00
信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	265.00	100.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	152,465.00	57,300.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北国控资本管理有限公司	本基金管理人股东
海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东

海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人全资子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	271,579,927.77	8.27	224,961,740.38	8.85

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	5,702,171.00	13.63	5,491,781.00	13.11

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	2,900,000.00	8.60	900,000.00	91.84

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份有 限公司	242,794.22	12.89	12,584.61	11.93
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份有 限公司	212,815.67	18.76	202,358.20	20.83

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

②根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

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

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,150,648.68
其中：应支付销售机构的客户维护 费	295,752.99	166,228.42
应支付基金管理人的净管理费	854,895.69	957,790.74

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。管理费率的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	191,774.74	192,977.62

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%（2023 年 8 月 28 日前为 0.25%）的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

③本基金于 2023 年 8 月 28 日，将托管费自 0.25%调整至 0.20%，详情见《东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同的公告》（2023 年 8 月修订）。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	5,424.99	5,424.99
合计	-	5,424.99	5,424.99
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	0.58	0.58
合计	-	0.58	0.58

注：①本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；

本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	6,989,954.01	23,511.92	4,171,394.15	20,740.79

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

#### 7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002379	宏创控股	2024年12月23日	重大事项停牌	8.97	2025年01月07日	9.87	21,600	147,268.28	193,752.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额-139.43 元，于 2025 年 1 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在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31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等。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31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
----	------	------

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 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

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 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

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人赎回其持有的基金份额，

二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,989,954.01	-	-	-	6,989,954.01
结算备付金	1,913,819.23	-	-	-	1,913,819.23
存出保证金	21,833.32	-	-	-	21,833.32
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	53,431,312.99	53,431,312.99

交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	3,931,880.96	-	-	-	3,931,880.96
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	79,120.81	79,120.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,857,487.52	-	-	53,510,433.80	66,367,921.32
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-139.43	-	-	-	-139.43
应付清算款	-	-	-	2,629,253.10	2,629,253.10
应付赎回款	-	-	-	4,200,957.20	4,200,957.20
应付管理人报酬	-	-	-	68,324.38	68,324.38
应付托管费	-	-	-	11,387.38	11,387.38
应付销售服务费	-	-	-	3,811.86	3,811.86
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	233,469.54	233,469.54
负债总计	-139.43	-	-	7,147,203.46	7,147,064.03
利率敏感度缺口	12,857,626.95	-	-	46,363,230.34	59,220,857.29
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	4,171,394.15	-	-	-	4,171,394.15
结算备付金	5,132,890.33	-	-	-	5,132,890.33
存出保证金	123,607.75	-	-	-	123,607.75
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-378,907,887.82	378,907,887.82
交易性金融资产-债券投资	22,074,661.37	-	-	-	22,074,661.37
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	-	-	2,553,804.08	2,553,804.08
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	831,792.63	831,792.63
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	31,502,553.60	-	-382,293,484.53	413,796,038.13
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	-	-	2,835,591.82	2,835,591.82
应付赎回款	-	-	1,261,664.05	1,261,664.05
应付管理人报酬	-	-	438,896.39	438,896.39
应付托管费	-	-	73,149.42	73,149.42
应付销售服务费	-	-	3,874.77	3,874.77
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	-	-	1,001,028.44	1,001,028.44
负债总计	-	-	-5,614,204.89	5,614,204.89
利率敏感度缺口	31,502,553.60	-	-376,679,279.64	408,181,833.24

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的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12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-5,329.21	-26,637.66
	市场利率下调 0.25%	5,329.21	26,637.66

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	53,431,312.99	90.22	378,907,887.82	92.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,931,880.96	6.64	22,074,661.37	5.41
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	57,363,193.95	96.86	400,982,549.19	98.24

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

动	本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
沪深 300 指数上涨 5%	3,215,946.63	13,476,940.84
沪深 300 指数下跌 5%	-3,215,946.63	-13,476,940.84

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	53,237,560.99	378,849,204.77
第二层次	4,125,632.96	22,074,661.37
第三层次	-	58,683.05
合计	57,363,193.95	400,982,549.19

###### 7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	58,683.05	58,683.05
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	81,810.97	81,810.97
转出第三层次	-	187,677.72	187,677.72
当期利得或损失总额	-	47,183.70	47,183.70
其中：计入损益的利得或损失	-	47,183.70	47,183.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	31,465.12	31,465.12
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	27,217.93	27,217.93
其中：计入损益的利得或损失	-	27,217.93	27,217.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	58,683.05	58,683.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	27,217.93	27,217.93

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	58,683.05	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	22.72%-42.07%	负相关

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

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

**§ 8 投资组合报告**

**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,431,312.99	80.51
	其中：股票	53,431,312.99	80.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,931,880.96	5.92
	其中：债券	3,931,880.96	5.92
	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	8,903,773.24	13.42
8	其他各项资产	100,954.13	0.15
9	合计	66,367,921.32	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	309,234.00	0.52
B	采矿业	399,620.00	0.67
C	制造业	36,184,909.84	61.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,157,311.00	1.95
E	建筑业	739,813.00	1.25
F	批发和零售业	2,316,802.00	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	766,984.00	1.30
H	住宿和餐饮业	98,622.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,914,694.47	9.99
J	金融业	122,671.00	0.21
K	房地产业	1,302,279.00	2.20
L	租赁和商务服务业	1,106,549.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	1,178,254.28	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	930,460.40	1.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	56,000.00	0.09
Q	卫生和社会工作	115,047.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	640,458.00	1.08
S	综合	91,604.00	0.15
	合计	53,431,312.99	90.22

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300377	赢时胜	7,700	212,212.00	0.36
2	002379	宏创控股	21,600	193,752.00	0.33
3	600708	光明地产	48,200	179,304.00	0.30

4	603009	北特科技	4,300	168,044.00	0.28
5	301018	申菱环境	4,100	158,014.00	0.27
6	300131	英唐智控	18,700	151,657.00	0.26
7	300184	力源信息	14,800	138,084.00	0.23
8	300276	三丰智能	14,100	126,759.00	0.21
9	300493	润欣科技	4,500	126,585.00	0.21
10	688181	八亿时空	3,821	125,710.90	0.21
11	002611	东方精工	12,300	119,925.00	0.20
12	688766	普冉股份	1,122	113,613.72	0.19
13	002045	国光电器	5,200	112,788.00	0.19
14	600184	光电股份	10,900	112,488.00	0.19
15	603516	淳中科技	2,000	110,560.00	0.19
16	300048	合康新能	21,900	110,376.00	0.19
17	603662	柯力传感	1,700	109,820.00	0.19
18	002970	锐明技术	2,300	109,549.00	0.18
19	002170	芭田股份	12,400	108,252.00	0.18
20	300046	台基股份	2,900	105,183.00	0.18
21	300809	华辰装备	3,300	104,544.00	0.18
22	300100	双林股份	3,700	102,268.00	0.17
23	002175	东方智造	24,400	101,992.00	0.17
24	300145	中金环境	27,400	101,654.00	0.17
25	002707	众信旅游	13,500	99,765.00	0.17
26	000652	泰达股份	24,000	99,360.00	0.17
27	300355	蒙草生态	19,000	97,470.00	0.16
28	688313	仕佳光子	5,827	95,504.53	0.16
29	002892	科力尔	6,200	95,480.00	0.16
30	300401	花园生物	6,500	95,290.00	0.16
31	300541	先进数通	7,000	94,850.00	0.16
32	002106	莱宝高科	8,600	93,826.00	0.16
33	300213	佳讯飞鸿	12,200	93,818.00	0.16
34	002765	蓝黛科技	10,900	93,740.00	0.16
35	300561	汇金科技	1,700	93,432.00	0.16
36	300793	佳禾智能	4,700	92,637.00	0.16
37	300292	吴通控股	19,000	92,150.00	0.16
38	002823	凯中精密	6,500	92,105.00	0.16
39	300612	宣亚国际	5,800	91,582.00	0.15
40	603602	纵横通信	5,700	91,200.00	0.15
41	002165	红宝丽	21,100	90,308.00	0.15
42	300278	华昌达	15,400	90,090.00	0.15
43	300007	汉威科技	4,400	89,980.00	0.15
44	600106	重庆路桥	16,000	89,440.00	0.15
45	688609	九联科技	8,409	89,135.40	0.15
46	300925	法本信息	4,000	89,120.00	0.15

47	000948	南天信息	5,300	88,669.00	0.15
48	603319	湘油泵	4,500	88,650.00	0.15
49	300972	万辰集团	1,100	88,451.00	0.15
50	300035	中科电气	5,900	88,205.00	0.15
51	600736	苏州高新	14,200	88,182.00	0.15
52	300047	天源迪科	7,500	88,125.00	0.15
53	002805	丰元股份	7,400	88,060.00	0.15
54	600789	鲁抗医药	9,200	87,860.00	0.15
55	002523	天桥起重	26,700	87,309.00	0.15
56	600458	时代新材	6,800	87,108.00	0.15
57	002457	青龙管业	7,500	87,000.00	0.15
58	600327	大东方	16,300	86,879.00	0.15
59	603667	五洲新春	3,500	86,625.00	0.15
60	688148	芳源股份	17,456	86,407.20	0.15
61	000612	焦作万方	13,400	86,028.00	0.15
62	300025	华星创业	8,000	86,000.00	0.15
63	000888	峨眉山 A	6,500	85,995.00	0.15
64	002148	北纬科技	13,000	85,930.00	0.15
65	688049	炬芯科技	1,901	85,297.87	0.14
66	002640	跨境通	22,200	85,248.00	0.14
67	600664	哈药股份	20,600	85,078.00	0.14
68	300772	运达股份	6,400	84,736.00	0.14
69	000520	凤凰航运	18,100	84,708.00	0.14
70	002526	山东矿机	23,900	84,367.00	0.14
71	002093	国脉科技	10,800	84,240.00	0.14
72	300607	拓斯达	3,300	84,117.00	0.14
73	600020	中原高速	19,900	83,978.00	0.14
74	002935	天奥电子	5,200	83,720.00	0.14
75	600113	浙江东日	6,000	83,520.00	0.14
76	600217	中再资环	15,700	83,210.00	0.14
77	002510	天汽模	14,200	82,928.00	0.14
78	000735	罗牛山	12,400	82,584.00	0.14
79	002277	友阿股份	14,100	82,485.00	0.14
80	300975	商络电子	7,300	82,125.00	0.14
81	300790	宇瞳光学	4,300	82,087.00	0.14
82	688320	禾川科技	2,101	81,728.90	0.14
83	688522	纳睿雷达	1,446	81,467.64	0.14
84	002474	榕基软件	13,600	81,464.00	0.14
85	002406	远东传动	12,600	81,270.00	0.14
86	002361	神剑股份	14,900	81,205.00	0.14
87	002881	美格智能	2,700	80,892.00	0.14
88	688133	泰坦科技	4,427	80,748.48	0.14
89	300581	晨曦航空	7,200	80,712.00	0.14

90	300403	汉字集团	8,100	80,595.00	0.14
91	002438	江苏神通	6,600	80,520.00	0.14
92	300378	鼎捷数智	3,100	80,197.00	0.14
93	300326	凯利泰	12,300	79,950.00	0.14
94	603063	禾望电气	4,000	79,840.00	0.13
95	688068	热景生物	1,289	79,711.76	0.13
96	002149	西部材料	4,500	79,650.00	0.13
97	600114	东睦股份	4,900	79,233.00	0.13
98	600101	明星电力	9,000	79,200.00	0.13
99	600525	长园集团	16,200	79,056.00	0.13
100	300872	天阳科技	5,000	78,750.00	0.13
101	002668	TCL 智家	6,000	78,720.00	0.13
102	300005	探路者	11,200	78,512.00	0.13
103	300121	阳谷华泰	6,400	77,376.00	0.13
104	600744	华银电力	24,800	77,128.00	0.13
105	300785	值得买	2,300	77,050.00	0.13
106	300578	会畅通讯	4,000	77,000.00	0.13
107	002979	雷赛智能	2,500	76,975.00	0.13
108	300708	聚灿光电	6,100	76,189.00	0.13
109	002009	天奇股份	5,000	76,100.00	0.13
110	300248	新开普	7,800	75,582.00	0.13
111	300420	五洋自控	24,200	75,262.00	0.13
112	300349	金卡智能	5,500	75,185.00	0.13
113	600628	新世界	9,200	75,164.00	0.13
114	600537	亿晶光电	24,400	74,908.00	0.13
115	600130	波导股份	15,800	74,576.00	0.13
116	000925	众合科技	8,600	74,562.00	0.13
117	002559	亚威股份	8,300	74,451.00	0.13
118	600865	百大集团	6,300	74,151.00	0.13
119	002915	中欣氟材	5,800	74,124.00	0.13
120	300448	浩云科技	11,200	73,808.00	0.12
121	300304	云意电气	9,200	73,600.00	0.12
122	002095	生意宝	4,100	73,595.00	0.12
123	600094	大名城	20,200	73,528.00	0.12
124	300154	瑞凌股份	6,700	73,432.00	0.12
125	000551	创元科技	6,100	72,956.00	0.12
126	002174	游族网络	7,800	72,930.00	0.12
127	600622	光大嘉宝	22,500	72,675.00	0.12
128	603906	龙蟠科技	7,000	72,520.00	0.12
129	300424	航新科技	4,000	72,240.00	0.12
130	002481	双塔食品	13,300	71,953.00	0.12
131	300684	中石科技	3,200	71,776.00	0.12
132	301285	鸿日达	2,500	71,700.00	0.12

133	002296	辉煌科技	7,300	71,613.00	0.12
134	603336	宏辉果蔬	16,700	71,309.00	0.12
135	688509	正元地信	17,928	71,174.16	0.12
136	301127	天源环保	4,700	71,158.00	0.12
137	600336	澳柯玛	10,500	70,980.00	0.12
138	002392	北京利尔	15,000	70,800.00	0.12
139	300688	创业黑马	2,200	70,422.00	0.12
140	300041	回天新材	7,600	69,920.00	0.12
141	300622	博士眼镜	1,400	69,720.00	0.12
142	300953	震裕科技	1,000	69,640.00	0.12
143	688299	长阳科技	4,737	69,633.90	0.12
144	300590	移为通信	4,500	69,570.00	0.12
145	300466	赛摩智能	9,300	69,285.00	0.12
146	300566	激智科技	3,500	69,020.00	0.12
147	000590	启迪药业	9,700	68,967.00	0.12
148	601500	通用股份	12,900	68,757.00	0.12
149	605086	龙高股份	2,200	68,640.00	0.12
150	600894	广日股份	4,700	68,620.00	0.12
151	300556	丝路视觉	3,600	68,580.00	0.12
152	002757	南兴股份	4,400	68,332.00	0.12
153	300342	天银机电	4,200	68,166.00	0.12
154	300310	宜通世纪	9,000	68,040.00	0.11
155	600495	晋西车轴	17,900	68,020.00	0.11
156	000751	锌业股份	24,200	68,002.00	0.11
157	301126	达嘉维康	6,500	67,860.00	0.11
158	600830	香溢融通	5,800	67,802.00	0.11
159	603619	中曼石油	3,500	67,760.00	0.11
160	600651	飞乐音响	16,300	67,482.00	0.11
161	600501	航天晨光	3,700	67,118.00	0.11
162	688222	成都先导	5,442	67,045.44	0.11
163	002035	华帝股份	9,000	66,060.00	0.11
164	002279	久其软件	10,500	65,835.00	0.11
165	300825	阿尔特	5,800	65,540.00	0.11
166	600609	金杯汽车	9,100	65,520.00	0.11
167	301062	上海艾录	5,000	65,500.00	0.11
168	000544	中原环保	7,500	65,475.00	0.11
169	600824	益民集团	14,600	65,262.00	0.11
170	605305	中际联合	2,300	65,159.00	0.11
171	603507	振江股份	2,700	64,908.00	0.11
172	300569	天能重工	13,000	64,740.00	0.11
173	300680	隆盛科技	2,700	64,692.00	0.11
174	603998	方盛制药	6,200	64,604.00	0.11
175	002479	富春环保	13,600	64,464.00	0.11

176	000417	合百集团	10,100	64,438.00	0.11
177	002676	顺威股份	10,800	64,368.00	0.11
178	300986	志特新材	5,300	64,342.00	0.11
179	000593	德龙汇能	11,800	64,310.00	0.11
180	000973	佛塑科技	10,800	64,152.00	0.11
181	601616	广电电气	14,600	64,094.00	0.11
182	688603	天承科技	549	63,958.50	0.11
183	300812	易天股份	2,900	63,916.00	0.11
184	300127	银河磁体	2,600	63,908.00	0.11
185	001283	豪鹏科技	1,100	63,679.00	0.11
186	600826	兰生股份	7,400	63,640.00	0.11
187	300021	大禹节水	15,600	63,492.00	0.11
188	002947	恒铭达	1,900	63,327.00	0.11
189	002082	万邦德	9,800	63,014.00	0.11
190	300917	特发服务	1,300	62,894.00	0.11
191	300545	联得装备	2,000	62,660.00	0.11
192	002160	常铝股份	16,800	62,496.00	0.11
193	603668	天马科技	4,900	62,426.00	0.11
194	688305	科德数控	914	62,307.38	0.11
195	688311	盟升电子	1,878	62,180.58	0.10
196	603098	森特股份	6,400	61,440.00	0.10
197	603738	泰晶科技	4,100	61,418.00	0.10
198	300291	百纳千成	12,200	61,366.00	0.10
199	002869	金溢科技	2,300	61,180.00	0.10
200	301052	果麦文化	2,400	61,056.00	0.10
201	603969	银龙股份	9,000	60,840.00	0.10
202	002519	银河电子	10,200	60,588.00	0.10
202	300465	高伟达	3,300	60,588.00	0.10
203	300075	数字政通	3,500	60,550.00	0.10
204	300217	东方电热	13,400	60,434.00	0.10
205	301030	仕净科技	2,500	60,350.00	0.10
206	688205	德科立	659	59,969.00	0.10
207	002326	永太科技	6,700	59,898.00	0.10
208	300170	汉得信息	4,800	59,520.00	0.10
209	601700	风范股份	13,200	59,400.00	0.10
210	600636	国新文化	6,400	59,392.00	0.10
211	000797	中国武夷	21,400	59,278.00	0.10
212	603520	司太立	6,800	59,092.00	0.10
213	002606	大连电瓷	6,400	59,008.00	0.10
214	300360	炬华科技	3,500	58,695.00	0.10
215	300348	长亮科技	4,100	58,630.00	0.10
215	600791	京能置业	14,300	58,630.00	0.10
216	002578	闽发铝业	19,600	58,604.00	0.10

217	300320	海达股份	6,100	58,560.00	0.10
218	688080	映翰通	1,769	58,235.48	0.10
219	002567	唐人神	11,400	58,140.00	0.10
220	301116	益客食品	4,700	58,045.00	0.10
221	002695	煌上煌	6,800	58,004.00	0.10
222	300040	九洲集团	8,000	58,000.00	0.10
223	002039	黔源电力	3,800	57,988.00	0.10
224	600376	首开股份	22,000	57,860.00	0.10
225	002246	北化股份	5,700	57,855.00	0.10
226	603101	汇嘉时代	6,200	57,846.00	0.10
227	301004	嘉益股份	500	57,825.00	0.10
228	603258	电魂网络	2,900	57,681.00	0.10
229	600866	星湖科技	8,900	57,583.00	0.10
230	300516	久之洋	1,700	57,511.00	0.10
231	000801	四川九洲	4,000	57,240.00	0.10
232	002213	大为股份	4,200	56,994.00	0.10
233	600237	铜峰电子	8,700	56,985.00	0.10
234	300279	和晶科技	9,400	56,964.00	0.10
235	003005	竞业达	2,100	56,952.00	0.10
236	002376	新北洋	8,700	56,724.00	0.10
237	002515	金字火腿	12,500	56,625.00	0.10
238	605398	新炬网络	2,600	56,472.00	0.10
239	002728	特一药业	6,300	56,385.00	0.10
240	300299	富春股份	10,300	56,341.00	0.10
241	300179	四方达	5,000	56,250.00	0.09
242	000530	冰山冷热	9,300	55,893.00	0.09
243	003010	若羽臣	2,000	55,800.00	0.09
243	300099	尤洛卡	9,300	55,800.00	0.09
244	600825	新华传媒	8,500	55,675.00	0.09
245	301061	匠心家居	900	55,620.00	0.09
246	002838	道恩股份	4,700	55,507.00	0.09
247	600345	长江通信	2,400	55,488.00	0.09
248	688378	奥来德	2,432	55,473.92	0.09
249	300523	辰安科技	2,800	55,412.00	0.09
250	300193	佳士科技	6,200	55,118.00	0.09
251	000790	华神科技	14,100	54,990.00	0.09
252	300673	佩蒂股份	3,100	54,963.00	0.09
253	002577	雷柏科技	2,900	54,897.00	0.09
254	300531	优博讯	3,900	54,405.00	0.09
255	002066	瑞泰科技	4,800	54,384.00	0.09
256	003015	日久光电	3,800	54,378.00	0.09
257	300587	天铁科技	12,300	53,997.00	0.09
258	002112	三变科技	4,800	53,760.00	0.09

259	300484	蓝海华腾	2,600	53,716.00	0.09
260	300425	中建环能	9,200	53,636.00	0.09
261	600088	中视传媒	3,000	53,580.00	0.09
262	002599	盛通股份	7,200	53,496.00	0.09
263	301000	肇民科技	2,100	53,361.00	0.09
264	600433	冠豪高新	16,800	53,256.00	0.09
265	002272	川润股份	5,400	53,190.00	0.09
266	603085	天成自控	4,900	53,165.00	0.09
267	300483	首华燃气	5,400	53,136.00	0.09
268	688186	广大特材	3,460	53,111.00	0.09
269	002845	同兴达	3,500	53,060.00	0.09
270	002017	东信和平	5,100	52,887.00	0.09
271	000402	金融街	16,200	52,812.00	0.09
272	300580	贝斯特	2,300	52,785.00	0.09
273	002119	康强电子	3,400	52,632.00	0.09
274	000926	福星股份	20,600	52,530.00	0.09
275	002889	东方嘉盛	2,600	52,234.00	0.09
276	300453	三鑫医疗	7,000	52,220.00	0.09
277	600235	民丰特纸	9,200	52,164.00	0.09
278	688212	澳华内镜	1,297	52,113.46	0.09
279	600135	乐凯胶片	7,900	52,061.00	0.09
280	300057	万顺新材	10,800	52,056.00	0.09
281	002997	瑞鹄模具	1,500	51,975.00	0.09
282	000510	新金路	14,400	51,840.00	0.09
283	002922	伊戈尔	2,900	51,678.00	0.09
284	300241	瑞丰光电	9,400	51,606.00	0.09
285	300831	派瑞股份	3,200	51,520.00	0.09
286	300444	双杰电气	7,400	51,282.00	0.09
287	002137	实益达	5,700	51,243.00	0.09
288	002255	海陆重工	9,200	51,152.00	0.09
289	688678	福立旺	3,444	51,143.40	0.09
290	002421	达实智能	14,900	51,107.00	0.09
291	688239	航宇科技	1,368	51,026.40	0.09
292	301550	斯菱股份	700	50,953.00	0.09
293	001287	中电港	2,500	50,775.00	0.09
294	688401	路维光电	1,923	50,747.97	0.09
295	603111	康尼机电	8,400	50,652.00	0.09
296	002378	章源钨业	7,800	50,466.00	0.09
297	000404	长虹华意	6,800	50,320.00	0.08
298	605186	健麾信息	2,500	50,275.00	0.08
299	002245	蔚蓝锂芯	4,700	50,243.00	0.08
300	000892	欢瑞世纪	15,400	50,204.00	0.08
301	002103	广博股份	5,300	50,085.00	0.08

302	603429	集友股份	8,000	50,080.00	0.08
303	688138	清溢光电	2,185	50,036.50	0.08
304	301338	凯格精机	1,600	49,920.00	0.08
305	002849	威星智能	2,800	49,896.00	0.08
306	600222	太龙药业	9,800	49,882.00	0.08
307	600359	新农开发	7,800	49,842.00	0.08
308	300404	博济医药	5,700	49,761.00	0.08
309	688588	凌志软件	3,601	49,693.80	0.08
310	000153	丰原药业	8,100	49,653.00	0.08
311	000978	桂林旅游	8,200	49,528.00	0.08
312	300835	龙磁科技	1,600	49,472.00	0.08
313	603727	博迈科	4,300	49,364.00	0.08
314	300426	唐德影视	5,000	49,350.00	0.08
315	300691	联合光电	2,500	49,300.00	0.08
316	603119	浙江荣泰	2,200	49,258.00	0.08
317	600665	天地源	15,700	49,141.00	0.08
318	002521	齐峰新材	4,900	49,098.00	0.08
319	688621	阳光诺和	1,300	49,010.00	0.08
320	001267	汇绿生态	6,400	48,896.00	0.08
321	002787	华源控股	6,200	48,856.00	0.08
322	603912	佳力图	5,900	48,852.00	0.08
323	301111	粤万年青	3,000	48,840.00	0.08
324	000677	恒天海龙	11,900	48,790.00	0.08
325	600756	浪潮软件	3,400	48,722.00	0.08
326	600133	东湖高新	5,200	48,620.00	0.08
327	002989	中天精装	2,200	48,576.00	0.08
328	300662	科锐国际	2,300	48,438.00	0.08
329	600558	大西洋	11,900	48,433.00	0.08
330	601339	百隆东方	8,900	48,416.00	0.08
331	002067	景兴纸业	12,200	48,312.00	0.08
332	002469	三维化学	6,600	48,180.00	0.08
332	301027	华蓝集团	3,000	48,180.00	0.08
333	000011	深物业 A	5,500	48,070.00	0.08
334	002587	奥拓电子	8,000	48,000.00	0.08
335	301085	亚康股份	700	47,999.00	0.08
336	601599	浙文影业	13,400	47,972.00	0.08
337	002115	三维通信	7,200	47,880.00	0.08
338	300119	瑞普生物	2,600	47,762.00	0.08
339	002186	全聚德	4,100	47,560.00	0.08
340	300652	雷迪克	1,600	47,552.00	0.08
341	300430	诚益通	3,100	47,430.00	0.08
342	603214	爱婴室	2,100	47,376.00	0.08
343	603607	京华激光	2,900	47,212.00	0.08

344	300494	盛天网络	4,200	47,208.00	0.08
345	600629	华建集团	5,100	47,022.00	0.08
346	000036	华联控股	11,500	46,920.00	0.08
347	603015	弘讯科技	4,800	46,896.00	0.08
348	000159	国际实业	7,800	46,800.00	0.08
349	001314	亿道信息	900	46,665.00	0.08
350	002307	北新路桥	12,600	46,620.00	0.08
351	301270	汉仪股份	1,300	46,462.00	0.08
352	300164	通源石油	10,900	46,434.00	0.08
353	002190	成飞集成	2,400	46,416.00	0.08
354	300548	博创科技	1,000	46,410.00	0.08
355	300830	金现代	5,700	46,398.00	0.08
356	002264	新华都	7,500	46,350.00	0.08
357	603099	长白山	1,100	46,332.00	0.08
358	300898	熊猫乳品	1,800	46,278.00	0.08
359	301345	涛涛车业	700	46,270.00	0.08
360	603122	合富中国	6,600	46,266.00	0.08
361	300543	朗科智能	4,400	46,112.00	0.08
362	300718	长盛轴承	1,500	46,035.00	0.08
363	300722	新余国科	1,700	45,934.00	0.08
364	002116	中国海诚	4,600	45,908.00	0.08
365	002760	凤形股份	2,700	45,900.00	0.08
366	300802	矩子科技	2,500	45,675.00	0.08
367	000736	中交地产	5,300	45,580.00	0.08
368	002455	百川股份	6,100	45,567.00	0.08
369	002375	亚厦股份	11,800	45,548.00	0.08
370	002703	浙江世宝	4,000	45,480.00	0.08
371	300987	川网传媒	3,200	45,312.00	0.08
372	600523	贵航股份	3,800	45,296.00	0.08
373	688377	迪威尔	2,348	45,269.44	0.08
374	002338	奥普光电	1,200	45,264.00	0.08
375	600851	海欣股份	7,800	45,240.00	0.08
376	600620	天宸股份	7,900	45,188.00	0.08
377	000407	胜利股份	13,200	45,144.00	0.08
377	300440	运达科技	5,700	45,144.00	0.08
378	301349	信德新材	1,400	45,052.00	0.08
379	688055	龙腾光电	10,899	45,012.87	0.08
380	300719	安达维尔	2,500	44,775.00	0.08
381	603332	苏州龙杰	5,200	44,772.00	0.08
382	002328	新朋股份	7,300	44,749.00	0.08
383	000931	中关村	9,400	44,744.00	0.08
384	301380	挖金客	900	44,622.00	0.08
385	300491	通合科技	2,800	44,576.00	0.08

386	688028	沃尔德	2,010	44,481.30	0.08
387	301160	翔楼新材	800	44,480.00	0.08
388	600127	金健米业	6,600	44,418.00	0.08
389	002533	金杯电工	4,500	44,280.00	0.07
390	000906	浙商中拓	6,700	44,220.00	0.07
391	300235	方直科技	4,100	44,198.00	0.07
392	300926	博俊科技	2,000	44,020.00	0.07
393	000957	中通客车	4,000	44,000.00	0.07
394	688699	明微电子	1,221	43,882.74	0.07
395	301326	捷邦科技	600	43,860.00	0.07
396	001380	华纬科技	2,000	43,800.00	0.07
397	000850	华茂股份	10,600	43,778.00	0.07
398	300546	雄帝科技	2,600	43,732.00	0.07
399	688018	乐鑫科技	200	43,600.00	0.07
400	600784	鲁银投资	7,400	43,586.00	0.07
401	000514	渝开发	10,600	43,566.00	0.07
402	000524	岭南控股	4,500	43,560.00	0.07
402	000576	甘化科工	6,000	43,560.00	0.07
403	002140	东华科技	4,400	43,472.00	0.07
404	300485	赛升药业	6,200	43,462.00	0.07
405	600476	湘邮科技	2,900	43,355.00	0.07
406	300792	壹网壹创	1,800	43,200.00	0.07
407	688058	宝兰德	1,566	43,065.00	0.07
408	301183	东田微	800	43,040.00	0.07
409	300365	恒华科技	7,000	42,980.00	0.07
410	688179	阿拉丁	3,109	42,904.20	0.07
411	001319	铭科精技	1,700	42,755.00	0.07
412	301082	久盛电气	3,200	42,656.00	0.07
413	688371	菲沃泰	2,743	42,571.36	0.07
414	688207	格灵深瞳	2,989	42,563.36	0.07
415	600051	宁波联合	6,500	42,510.00	0.07
416	688258	卓易信息	1,227	42,454.20	0.07
417	301121	紫建电子	800	42,448.00	0.07
418	300647	超频三	6,900	42,435.00	0.07
419	600503	华丽家族	16,300	42,380.00	0.07
420	300654	世纪天鸿	4,200	42,378.00	0.07
421	301396	宏景科技	1,500	42,120.00	0.07
422	002522	浙江众成	10,700	41,837.00	0.07
423	603618	杭电股份	7,700	41,811.00	0.07
424	002662	京威股份	10,800	41,796.00	0.07
425	002873	新天药业	4,400	41,668.00	0.07
426	603686	福龙马	4,000	41,600.00	0.07
427	002897	意华股份	1,000	41,350.00	0.07

428	300004	南风股份	6,700	41,205.00	0.07
429	600552	凯盛科技	3,600	41,076.00	0.07
430	300384	三联虹普	2,200	40,964.00	0.07
431	600838	上海九百	4,200	40,866.00	0.07
432	300185	通裕重工	15,900	40,863.00	0.07
433	300818	耐普矿机	1,500	40,740.00	0.07
434	002327	富安娜	4,600	40,664.00	0.07
435	300375	鹏翎股份	8,800	40,568.00	0.07
436	688252	天德钰	1,691	40,499.45	0.07
437	688533	上声电子	1,161	40,426.02	0.07
438	300667	必创科技	2,500	40,425.00	0.07
439	002590	万安科技	3,300	40,326.00	0.07
440	002322	理工能科	3,200	40,288.00	0.07
441	600262	北方股份	2,200	40,282.00	0.07
442	688502	茂莱光学	200	40,280.00	0.07
443	000701	厦门信达	8,800	40,216.00	0.07
444	301266	宇邦新材	1,200	40,200.00	0.07
445	301076	新瀚新材	1,300	40,196.00	0.07
446	002110	三钢闽光	12,100	40,172.00	0.07
447	688651	盛邦安全	1,135	40,144.95	0.07
448	000529	广弘控股	6,800	40,120.00	0.07
449	300138	晨光生物	4,600	40,112.00	0.07
450	603256	宏和科技	4,800	40,080.00	0.07
451	688319	欧林生物	3,781	40,078.60	0.07
452	300283	温州宏丰	7,300	40,077.00	0.07
453	002516	旷达科技	7,900	40,053.00	0.07
454	300840	酷特智能	2,000	40,040.00	0.07
455	301333	诺思格	800	39,992.00	0.07
456	300272	开能健康	6,500	39,975.00	0.07
457	300881	盛德鑫泰	1,300	39,962.00	0.07
458	300981	中红医疗	3,100	39,866.00	0.07
459	300402	宝色股份	2,700	39,825.00	0.07
460	000880	潍柴重机	2,300	39,790.00	0.07
461	300160	秀强股份	7,300	39,712.00	0.07
462	688677	海泰新光	1,052	39,618.32	0.07
463	300885	海昌新材	3,600	39,600.00	0.07
464	603168	莎普爱思	5,900	39,530.00	0.07
465	300019	硅宝科技	2,700	39,528.00	0.07
466	688035	德邦科技	1,071	39,359.25	0.07
467	300711	广哈通信	1,700	39,355.00	0.07
468	300467	迅游科技	2,500	39,325.00	0.07
469	002100	天康生物	6,000	39,300.00	0.07
470	002194	武汉凡谷	3,500	39,270.00	0.07

471	603889	新澳股份	5,600	39,256.00	0.07
472	688290	景业智能	897	39,216.84	0.07
473	002949	华阳国际	2,200	39,204.00	0.07
474	688210	统联精密	1,963	39,181.48	0.07
475	002632	道明光学	4,400	39,160.00	0.07
476	300738	奥飞数据	2,700	39,150.00	0.07
477	600892	大晟文化	10,600	39,114.00	0.07
478	300650	太龙股份	3,400	39,100.00	0.07
479	300905	宝丽迪	1,500	39,090.00	0.07
480	003026	中晶科技	1,200	39,060.00	0.07
481	002734	利民股份	4,900	39,053.00	0.07
482	301188	力诺药包	2,600	39,052.00	0.07
483	300542	新晨科技	1,900	39,026.00	0.07
484	002863	今飞凯达	8,400	38,976.00	0.07
485	300814	中富电路	1,200	38,904.00	0.07
486	002084	海鸥住工	13,500	38,880.00	0.07
487	000419	通程控股	6,800	38,828.00	0.07
488	600683	京投发展	10,200	38,760.00	0.07
489	000905	厦门港务	5,400	38,664.00	0.07
489	002303	美盈森	10,800	38,664.00	0.07
490	300605	恒锋信息	3,300	38,643.00	0.07
491	002846	英联股份	4,700	38,634.00	0.07
492	688247	宣泰医药	3,839	38,620.34	0.07
493	000700	模塑科技	5,500	38,610.00	0.07
494	301101	明月镜片	900	38,592.00	0.07
495	002240	盛新锂能	2,800	38,584.00	0.07
495	002452	长高电新	5,200	38,584.00	0.07
496	300547	川环科技	1,400	38,556.00	0.07
497	002669	康达新材	4,000	38,520.00	0.07
498	300733	西菱动力	3,300	38,511.00	0.07
499	300933	中辰股份	4,600	38,456.00	0.06
500	603081	大丰实业	3,400	38,420.00	0.06
501	003002	壶化股份	1,700	38,352.00	0.06
502	301201	诚达药业	1,900	38,342.00	0.06
503	600210	紫江企业	5,800	38,338.00	0.06
504	300486	东杰智能	5,600	38,304.00	0.06
505	002192	融捷股份	1,200	38,280.00	0.06
505	603663	三祥新材	2,400	38,280.00	0.06
506	300512	中亚股份	5,600	38,136.00	0.06
507	301046	能辉科技	1,900	38,114.00	0.06
508	002401	中远海科	2,400	38,112.00	0.06
509	300250	初灵信息	2,700	38,070.00	0.06
510	605488	福莱新材	1,800	37,998.00	0.06

511	001201	东瑞股份	2,400	37,968.00	0.06
512	688636	智明达	1,351	37,963.10	0.06
513	300263	隆华科技	5,200	37,960.00	0.06
514	000859	国风新材	7,500	37,950.00	0.06
515	300921	南凌科技	1,400	37,940.00	0.06
516	300698	万马科技	1,100	37,906.00	0.06
517	300788	中信出版	1,200	37,884.00	0.06
518	688168	安博通	966	37,770.60	0.06
519	300700	岱勒新材	4,300	37,754.00	0.06
520	603002	宏昌电子	7,000	37,590.00	0.06
521	002164	宁波东力	7,500	37,575.00	0.06
522	301421	波长光电	700	37,569.00	0.06
523	301048	金鹰重工	4,000	37,480.00	0.06
524	300221	银禧科技	6,400	37,376.00	0.06
525	300473	德尔股份	1,500	37,365.00	0.06
526	002553	南方精工	2,900	37,294.00	0.06
527	000420	吉林化纤	10,300	37,183.00	0.06
528	000823	超声电子	3,600	37,152.00	0.06
528	002284	亚太股份	4,800	37,152.00	0.06
529	603199	九华旅游	1,100	37,125.00	0.06
530	688270	臻镭科技	1,057	36,995.00	0.06
531	301110	青木科技	600	36,924.00	0.06
532	000965	天保基建	12,300	36,900.00	0.06
533	300963	中洲特材	4,200	36,834.00	0.06
534	001215	千味央厨	1,200	36,816.00	0.06
535	301130	西点药业	1,400	36,750.00	0.06
536	601188	龙江交通	10,200	36,720.00	0.06
537	603697	有友食品	3,600	36,648.00	0.06
538	688298	东方生物	1,248	36,603.84	0.06
539	603558	健盛集团	3,400	36,584.00	0.06
540	688150	莱特光电	1,623	36,549.96	0.06
541	002023	海特高新	3,600	36,540.00	0.06
542	002339	积成电子	5,300	36,517.00	0.06
543	603206	嘉环科技	2,100	36,498.00	0.06
544	002398	垒知集团	8,300	36,437.00	0.06
545	000533	顺钠股份	6,000	36,360.00	0.06
546	688025	杰普特	765	36,337.50	0.06
547	300996	普联软件	2,000	36,240.00	0.06
548	002083	孚日股份	7,400	36,186.00	0.06
549	600052	东望时代	8,000	36,160.00	0.06
550	002660	茂硕电源	3,500	36,120.00	0.06
551	301302	华如科技	1,500	36,075.00	0.06
552	603929	亚翔集成	1,300	36,049.00	0.06

553	600819	耀皮玻璃	6,700	35,979.00	0.06
554	300055	万邦达	7,500	35,925.00	0.06
555	603611	诺力股份	2,000	35,900.00	0.06
556	301191	菲菱科思	400	35,780.00	0.06
557	300884	狄耐克	3,200	35,776.00	0.06
558	300092	科新机电	3,100	35,774.00	0.06
559	600477	杭萧钢构	13,900	35,723.00	0.06
560	300958	建工修复	3,100	35,712.00	0.06
561	002891	中宠股份	1,000	35,700.00	0.06
562	603223	恒通股份	3,400	35,632.00	0.06
563	603386	骏亚科技	3,200	35,584.00	0.06
564	600769	祥龙电业	3,700	35,557.00	0.06
565	603811	诚意药业	4,600	35,512.00	0.06
566	300434	金石亚药	4,300	35,475.00	0.06
567	603598	引力传媒	2,100	35,469.00	0.06
568	002243	力合科创	4,400	35,464.00	0.06
569	002827	高争民爆	1,400	35,434.00	0.06
570	002882	金龙羽	2,200	35,376.00	0.06
571	688117	圣诺生物	1,378	35,373.26	0.06
572	603167	渤海轮渡	4,000	35,360.00	0.06
573	603121	华培动力	3,200	35,296.00	0.06
574	300275	梅安森	2,400	35,280.00	0.06
574	600425	青松建化	9,000	35,280.00	0.06
575	300219	鸿利智汇	4,700	35,203.00	0.06
576	300230	永利股份	7,900	35,155.00	0.06
577	000531	穗恒运 A	6,100	35,136.00	0.06
578	001298	好上好	1,400	35,070.00	0.06
579	301558	三态股份	4,000	35,040.00	0.06
580	600035	楚天高速	7,600	34,960.00	0.06
581	601388	怡球资源	14,200	34,932.00	0.06
582	600178	东安动力	3,000	34,920.00	0.06
583	300295	三六五网	2,100	34,881.00	0.06
584	002799	环球印务	4,600	34,868.00	0.06
585	003041	真爱美家	1,300	34,866.00	0.06
586	300656	民德电子	1,400	34,832.00	0.06
587	603309	维力医疗	2,900	34,742.00	0.06
588	600605	汇通能源	1,000	34,690.00	0.06
589	688606	奥泰生物	548	34,688.40	0.06
590	300559	佳发教育	2,900	34,684.00	0.06
591	002006	精工科技	2,100	34,650.00	0.06
592	300968	格林精密	2,100	34,608.00	0.06
593	002733	雄韬股份	2,500	34,600.00	0.06
594	300018	中元股份	5,100	34,527.00	0.06

595	300519	新光药业	2,600	34,502.00	0.06
596	688285	高铁电气	4,659	34,476.60	0.06
597	600796	钱江生化	6,000	34,440.00	0.06
598	300399	天利科技	1,400	34,384.00	0.06
599	301311	昆船智能	1,900	34,371.00	0.06
600	002802	洪汇新材	2,900	34,365.00	0.06
601	300815	玉禾田	2,200	34,298.00	0.06
602	300584	海辰药业	1,700	34,272.00	0.06
602	601368	绿城水务	7,200	34,272.00	0.06
603	300696	爱乐达	2,200	34,166.00	0.06
604	300597	吉大通信	3,900	34,125.00	0.06
605	600249	两面针	6,700	34,103.00	0.06
606	600293	三峡新材	10,800	34,020.00	0.06
607	300388	节能国祯	4,500	33,975.00	0.06
608	002451	摩恩电气	5,400	33,912.00	0.06
609	688700	东威科技	1,151	33,908.46	0.06
610	603036	如通股份	2,000	33,840.00	0.06
611	603696	安记食品	4,100	33,620.00	0.06
612	600693	东百集团	4,800	33,600.00	0.06
613	002536	飞龙股份	2,900	33,582.00	0.06
614	301068	大地海洋	1,100	33,539.00	0.06
615	600386	北巴传媒	7,500	33,525.00	0.06
616	301282	金禄电子	1,600	33,520.00	0.06
617	002488	金固股份	3,200	33,408.00	0.06
618	002446	盛路通信	5,100	33,405.00	0.06
619	600648	外高桥	2,800	33,348.00	0.06
620	001317	三羊马	1,200	33,324.00	0.06
621	002725	跃岭股份	3,100	33,263.00	0.06
622	603130	云中马	1,500	33,225.00	0.06
623	000557	西部创业	6,400	33,216.00	0.06
624	000722	湖南发展	3,500	33,075.00	0.06
625	300822	贝仕达克	1,600	33,040.00	0.06
626	688543	国科军工	658	32,978.96	0.06
627	605080	浙江自然	1,400	32,900.00	0.06
628	002212	天融信	5,100	32,895.00	0.06
629	301026	浩通科技	1,200	32,880.00	0.06
630	688716	中研股份	904	32,860.40	0.06
631	603648	畅联股份	3,200	32,832.00	0.06
632	002365	永安药业	4,100	32,759.00	0.06
633	301215	中汽股份	5,500	32,725.00	0.06
634	688379	华光新材	1,602	32,712.84	0.06
635	300796	贝斯美	3,200	32,672.00	0.06
636	600593	大连圣亚	900	32,652.00	0.06

637	300639	凯普生物	5,500	32,615.00	0.06
638	300771	智莱科技	3,100	32,612.00	0.06
639	603527	众源新材	3,400	32,606.00	0.06
640	688312	燕麦科技	1,057	32,555.60	0.05
641	300101	振芯科技	1,500	32,490.00	0.05
642	600649	城投控股	7,300	32,485.00	0.05
643	300306	远方信息	2,800	32,480.00	0.05
644	301246	宏源药业	2,400	32,472.00	0.05
645	301025	读客文化	3,400	32,402.00	0.05
646	300707	威唐工业	2,100	32,277.00	0.05
647	688595	芯海科技	984	32,275.20	0.05
648	300522	世名科技	2,600	32,214.00	0.05
649	603266	天龙股份	2,000	32,200.00	0.05
650	001229	魅视科技	900	32,157.00	0.05
651	600969	郴电国际	5,000	32,150.00	0.05
652	300805	电声股份	2,900	32,132.00	0.05
653	688129	东来技术	1,902	32,105.76	0.05
654	301505	苏州规划	1,300	32,084.00	0.05
655	002208	合肥城建	4,500	31,995.00	0.05
656	002036	联创电子	3,400	31,960.00	0.05
657	301186	超达装备	800	31,912.00	0.05
658	600805	悦达投资	7,200	31,896.00	0.05
659	300636	同和药业	4,000	31,880.00	0.05
660	603108	润达医疗	2,000	31,860.00	0.05
661	301139	元道通信	1,400	31,850.00	0.05
662	001208	华菱线缆	3,500	31,780.00	0.05
663	002671	龙泉股份	7,000	31,710.00	0.05
664	603103	横店影视	2,200	31,658.00	0.05
665	000919	金陵药业	4,800	31,584.00	0.05
666	300359	全通教育	6,000	31,560.00	0.05
667	603200	上海洗霸	1,300	31,551.00	0.05
668	300200	高盟新材	3,800	31,464.00	0.05
669	301369	联动科技	600	31,428.00	0.05
670	300592	华凯易佰	2,200	31,416.00	0.05
671	603809	豪能股份	2,700	31,401.00	0.05
672	688003	天准科技	725	31,392.50	0.05
673	603999	读者传媒	5,100	31,365.00	0.05
674	000779	甘咨询	3,800	31,274.00	0.05
675	300619	金银河	1,300	31,265.00	0.05
676	688232	新点软件	1,072	31,077.28	0.05
677	688218	江苏北人	1,500	31,065.00	0.05
678	000936	华西股份	3,800	31,046.00	0.05
679	603329	上海雅仕	2,400	30,936.00	0.05

680	688110	东芯股份	1,239	30,851.10	0.05
681	300400	劲拓股份	1,900	30,818.00	0.05
682	002029	七匹狼	4,700	30,738.00	0.05
683	300950	德固特	1,900	30,685.00	0.05
684	300112	万讯自控	3,400	30,634.00	0.05
685	300660	江苏雷利	800	30,576.00	0.05
686	002686	亿利达	5,700	30,552.00	0.05
687	300817	双飞集团	2,200	30,514.00	0.05
688	600255	鑫科材料	8,900	30,438.00	0.05
689	002476	宝莫股份	7,200	30,384.00	0.05
690	603209	兴通股份	1,900	30,362.00	0.05
691	600379	宝光股份	3,200	30,304.00	0.05
692	002893	京能热力	3,000	30,270.00	0.05
693	600505	西昌电力	2,500	30,250.00	0.05
694	300414	中光防雷	3,800	30,248.00	0.05
695	300629	新劲刚	1,400	30,240.00	0.05
696	002615	哈尔斯	3,800	30,210.00	0.05
697	301419	阿莱德	1,000	30,190.00	0.05
698	300947	德必集团	1,900	30,153.00	0.05
699	002167	东方锆业	4,100	30,094.00	0.05
700	000705	浙江震元	3,800	30,058.00	0.05
701	002642	荣联科技	4,200	30,030.00	0.05
701	301331	恩威医药	1,300	30,030.00	0.05
702	688275	万润新能	621	30,012.93	0.05
703	300062	中能电气	5,100	29,988.00	0.05
704	002830	名雕股份	2,400	29,976.00	0.05
705	603739	蔚蓝生物	2,500	29,975.00	0.05
706	688041	海光信息	200	29,958.00	0.05
707	301305	朗坤环境	1,700	29,954.00	0.05
708	002886	沃特股份	1,800	29,916.00	0.05
709	300589	江龙船艇	2,400	29,880.00	0.05
710	300774	倍杰特	3,400	29,852.00	0.05
711	688733	壹石通	1,579	29,843.10	0.05
712	002824	和胜股份	1,900	29,830.00	0.05
712	002933	新兴装备	1,000	29,830.00	0.05
713	300508	维宏股份	1,100	29,755.00	0.05
714	603600	永艺股份	2,500	29,725.00	0.05
715	002543	万和电气	2,900	29,696.00	0.05
716	002919	名臣健康	1,800	29,610.00	0.05
716	603308	应流股份	2,100	29,610.00	0.05
717	002923	润都股份	3,100	29,574.00	0.05
718	300663	科蓝软件	1,700	29,512.00	0.05
719	301158	德石股份	2,100	29,463.00	0.05

720	300289	利德曼	6,000	29,400.00	0.05
721	002644	佛慈制药	3,800	29,336.00	0.05
722	002337	赛象科技	5,900	29,323.00	0.05
723	601002	晋亿实业	6,700	29,145.00	0.05
724	002576	通达动力	1,700	29,138.00	0.05
725	002866	传艺科技	1,800	29,124.00	0.05
726	300678	中科信息	800	29,096.00	0.05
727	600266	城建发展	5,700	29,070.00	0.05
728	002386	天原股份	6,300	28,791.00	0.05
729	688045	必易微	901	28,741.90	0.05
730	603689	皖天然气	3,200	28,736.00	0.05
731	300922	天秦装备	2,000	28,700.00	0.05
732	601218	吉鑫科技	8,800	28,688.00	0.05
733	605199	葫芦娃	1,800	28,674.00	0.05
734	002907	华森制药	2,200	28,600.00	0.05
735	688613	奥精医疗	1,582	28,539.28	0.05
736	603324	盛剑科技	1,100	28,479.00	0.05
737	600138	中青旅	2,800	28,392.00	0.05
738	002033	丽江股份	3,200	28,384.00	0.05
739	300447	全信股份	2,000	28,340.00	0.05
740	300702	天宇股份	1,700	28,322.00	0.05
741	301087	可孚医疗	800	28,288.00	0.05
742	300626	华瑞股份	3,100	28,272.00	0.05
743	002828	贝肯能源	3,300	28,248.00	0.05
743	300938	信测标准	1,100	28,248.00	0.05
744	688227	品高股份	1,091	28,202.35	0.05
745	301171	易点天下	1,000	28,190.00	0.05
746	002489	浙江永强	8,700	28,188.00	0.05
747	301103	何氏眼科	1,400	28,168.00	0.05
748	000565	渝三峡 A	5,200	28,132.00	0.05
749	002419	天虹股份	4,800	28,128.00	0.05
749	002771	真视通	1,600	28,128.00	0.05
750	002927	泰永长征	1,900	28,101.00	0.05
751	002972	科安达	2,700	28,080.00	0.05
752	601133	柏诚股份	2,500	28,050.00	0.05
753	603090	宏盛股份	1,600	28,016.00	0.05
754	600797	浙大网新	3,900	28,002.00	0.05
755	002580	圣阳股份	3,300	27,984.00	0.05
756	688579	山大地纬	3,045	27,983.55	0.05
757	301278	快可电子	800	27,960.00	0.05
758	301393	昊帆生物	700	27,937.00	0.05
759	002492	恒基达鑫	5,800	27,898.00	0.05
760	300443	金雷股份	1,400	27,888.00	0.05

761	300869	康泰医学	2,000	27,880.00	0.05
762	300162	雷曼光电	3,700	27,861.00	0.05
763	603960	克来机电	1,400	27,860.00	0.05
764	300860	锋尚文化	1,000	27,830.00	0.05
765	603936	博敏电子	3,300	27,786.00	0.05
766	300396	迪瑞医疗	1,700	27,778.00	0.05
767	688233	神工股份	1,182	27,717.90	0.05
768	002843	泰嘉股份	1,300	27,716.00	0.05
769	688060	云涌科技	780	27,697.80	0.05
770	300908	仲景食品	900	27,666.00	0.05
771	002135	东南网架	6,500	27,625.00	0.05
772	003001	中岩大地	600	27,600.00	0.05
773	300945	曼卡龙	2,400	27,576.00	0.05
774	301117	佳缘科技	900	27,567.00	0.05
775	688559	海目星	801	27,554.40	0.05
776	603976	正川股份	1,700	27,540.00	0.05
777	301399	英特科技	1,000	27,530.00	0.05
778	301377	鼎泰高科	1,300	27,495.00	0.05
779	300980	祥源新材	1,200	27,480.00	0.05
780	003000	劲仔食品	2,000	27,400.00	0.05
781	300583	赛托生物	1,400	27,370.00	0.05
782	003011	海象新材	1,800	27,360.00	0.05
783	600814	杭州解百	3,300	27,357.00	0.05
784	002127	南极电商	6,200	27,280.00	0.05
785	002887	绿茵生态	3,900	27,183.00	0.05
786	688737	中自科技	1,526	27,178.06	0.05
787	603755	日辰股份	1,000	27,100.00	0.05
788	300183	东软载波	1,400	27,090.00	0.05
788	600973	宝胜股份	4,300	27,090.00	0.05
789	605016	百龙创园	1,600	27,040.00	0.05
790	603917	合力科技	2,300	27,025.00	0.05
791	000899	赣能股份	3,100	27,001.00	0.05
792	688125	安达智能	690	26,958.30	0.05
793	300828	锐新科技	1,600	26,912.00	0.05
794	301172	君逸数码	1,000	26,840.00	0.05
795	603078	江化微	1,600	26,784.00	0.05
796	605318	法狮龙	1,300	26,780.00	0.05
797	002616	长青集团	5,600	26,768.00	0.05
798	002076	星光股份	11,100	26,640.00	0.04
798	300880	迦南智能	1,200	26,640.00	0.04
799	301256	华融化学	3,500	26,635.00	0.04
800	300435	中泰股份	2,200	26,576.00	0.04
801	600308	华泰股份	7,300	26,572.00	0.04

802	002238	天威视讯	3,300	26,499.00	0.04
803	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.04
804	301383	天键股份	500	26,325.00	0.04
805	300928	华安鑫创	800	26,312.00	0.04
806	600962	国投中鲁	2,000	26,300.00	0.04
807	605368	蓝天燃气	2,300	26,289.00	0.04
808	301235	华康医疗	1,300	26,273.00	0.04
809	300634	彩讯股份	1,200	26,160.00	0.04
810	300961	深水海纳	2,600	26,130.00	0.04
811	603016	新宏泰	700	26,110.00	0.04
812	300800	力合科技	2,500	26,075.00	0.04
813	000935	四川双马	1,800	26,064.00	0.04
814	301136	招标股份	2,200	26,048.00	0.04
815	300451	创业慧康	5,800	25,984.00	0.04
816	300087	荃银高科	2,200	25,960.00	0.04
817	301370	国科恒泰	2,400	25,920.00	0.04
818	300314	戴维医疗	2,300	25,898.00	0.04
819	301028	东亚机械	2,400	25,896.00	0.04
820	603629	利通电子	1,300	25,883.00	0.04
821	688231	隆达股份	1,820	25,880.40	0.04
822	002380	科远智慧	1,400	25,872.00	0.04
823	300739	明阳电路	1,700	25,738.00	0.04
824	688611	杭州柯林	769	25,715.36	0.04
825	301011	华立科技	1,000	25,690.00	0.04
826	600479	千金药业	2,400	25,632.00	0.04
827	600615	丰华股份	2,300	25,599.00	0.04
828	002265	建设工业	1,100	25,597.00	0.04
829	003019	宸展光电	1,000	25,580.00	0.04
830	300694	蠡湖股份	1,600	25,520.00	0.04
831	002598	山东章鼓	2,700	25,515.00	0.04
832	600829	人民同泰	3,400	25,500.00	0.04
833	300787	海能实业	1,900	25,498.00	0.04
834	301098	金埔园林	3,200	25,440.00	0.04
834	603918	金桥信息	2,000	25,440.00	0.04
835	300079	数码视讯	4,700	25,427.00	0.04
836	605277	新亚电子	1,800	25,398.00	0.04
837	301408	华人健康	2,300	25,369.00	0.04
838	002593	日上集团	5,000	25,350.00	0.04
839	300504	天邑股份	1,400	25,242.00	0.04
840	002560	通达股份	3,700	25,234.00	0.04
841	002344	海宁皮城	5,400	25,110.00	0.04
842	300962	中金辐照	1,500	25,095.00	0.04
842	301017	漱玉平民	2,100	25,095.00	0.04

843	301516	中远通	1,300	25,090.00	0.04
844	300439	美康生物	2,400	25,080.00	0.04
845	603158	腾龙股份	3,100	25,048.00	0.04
846	600531	豫光金铅	3,900	25,038.00	0.04
847	603176	汇通集团	5,600	24,920.00	0.04
848	002301	齐心集团	3,500	24,885.00	0.04
849	301292	海科新源	1,900	24,852.00	0.04
850	603028	赛福天	4,100	24,846.00	0.04
851	300188	国投智能	1,800	24,822.00	0.04
852	301120	新特电气	2,500	24,775.00	0.04
853	600573	惠泉啤酒	2,200	24,772.00	0.04
854	002232	启明信息	1,300	24,713.00	0.04
855	600269	赣粤高速	4,400	24,684.00	0.04
856	300842	帝科股份	600	24,612.00	0.04
857	688525	佰维存储	397	24,602.09	0.04
858	002967	广电计量	1,500	24,600.00	0.04
859	300943	春晖智控	1,900	24,491.00	0.04
860	301137	哈焊华通	1,400	24,458.00	0.04
861	002570	贝因美	5,800	24,418.00	0.04
862	002975	博杰股份	800	24,368.00	0.04
863	603083	剑桥科技	600	24,360.00	0.04
864	688489	三未信安	706	24,357.00	0.04
865	301312	智立方	500	24,300.00	0.04
866	688201	信安世纪	2,746	24,247.18	0.04
867	001216	华瓷股份	1,900	24,225.00	0.04
868	002550	千红制药	3,900	24,180.00	0.04
869	301131	聚赛龙	700	24,150.00	0.04
870	600724	宁波富达	3,800	24,130.00	0.04
871	300904	威力传动	400	24,068.00	0.04
872	300258	精锻科技	2,700	24,057.00	0.04
873	002747	埃斯顿	1,300	24,050.00	0.04
874	301041	金百泽	1,000	24,000.00	0.04
875	600468	百利电气	5,100	23,970.00	0.04
876	603916	苏博特	3,200	23,872.00	0.04
877	601007	金陵饭店	3,400	23,834.00	0.04
878	601999	出版传媒	3,800	23,826.00	0.04
879	600604	市北高新	5,000	23,800.00	0.04
880	603726	朗迪集团	1,500	23,715.00	0.04
881	000589	贵州轮胎	4,700	23,641.00	0.04
882	300781	因赛集团	400	23,612.00	0.04
883	603860	中公高科	800	23,608.00	0.04
884	600053	九鼎投资	1,700	23,579.00	0.04
885	688131	皓元医药	660	23,562.00	0.04

886	603788	宁波高发	1,700	23,511.00	0.04
887	002731	萃华珠宝	2,500	23,475.00	0.04
888	300911	亿田智能	900	23,472.00	0.04
889	002546	新联电子	5,400	23,382.00	0.04
890	002956	西麦食品	1,400	23,338.00	0.04
891	300455	航天智装	1,800	23,328.00	0.04
892	002981	朝阳科技	1,000	23,320.00	0.04
893	301313	凡拓数创	900	23,292.00	0.04
893	603178	圣龙股份	1,200	23,292.00	0.04
894	688353	华盛锂电	995	23,263.10	0.04
895	600790	轻纺城	6,200	23,250.00	0.04
896	301398	星源卓镁	500	23,200.00	0.04
896	603579	荣泰健康	1,600	23,200.00	0.04
897	002735	王子新材	2,500	23,150.00	0.04
898	603118	共进股份	2,600	23,140.00	0.04
899	600478	科力远	5,600	23,128.00	0.04
900	002896	中大力德	600	23,046.00	0.04
901	300505	川金诺	1,600	23,040.00	0.04
901	301310	鑫宏业	900	23,040.00	0.04
902	603203	快克智能	1,000	23,020.00	0.04
903	603162	海通发展	2,500	23,000.00	0.04
904	600787	中储股份	3,600	22,968.00	0.04
905	301378	通达海	800	22,912.00	0.04
906	300509	新美星	3,300	22,869.00	0.04
907	001379	腾达科技	1,000	22,850.00	0.04
908	002931	锋龙股份	1,400	22,764.00	0.04
909	301078	孩子王	2,000	22,760.00	0.04
910	301072	中捷精工	1,200	22,728.00	0.04
911	603126	中材节能	2,700	22,680.00	0.04
912	002890	弘宇股份	2,300	22,678.00	0.04
913	688721	龙图光罩	384	22,671.36	0.04
914	300668	杰恩设计	1,000	22,660.00	0.04
915	002900	哈三联	2,300	22,655.00	0.04
916	600644	乐山电力	3,700	22,644.00	0.04
917	300515	三德科技	1,900	22,629.00	0.04
918	600577	精达股份	3,100	22,599.00	0.04
919	300675	建科院	1,400	22,568.00	0.04
920	003027	同兴科技	1,500	22,560.00	0.04
921	603601	再升科技	6,700	22,512.00	0.04
922	301567	贝隆精密	500	22,440.00	0.04
923	300407	凯发电气	2,200	22,374.00	0.04
924	600278	东方创业	3,200	22,368.00	0.04
925	603855	华荣股份	1,100	22,319.00	0.04

926	001328	登康口腔	700	22,232.00	0.04
927	301488	豪恩汽电	400	22,116.00	0.04
928	301066	万事利	1,600	22,096.00	0.04
929	600775	南京熊猫	2,200	22,088.00	0.04
930	300637	扬帆新材	2,400	22,080.00	0.04
930	300959	线上线	500	22,080.00	0.04
931	688323	瑞华泰	1,794	22,048.26	0.04
932	000017	深中华 A	3,800	22,040.00	0.04
933	002051	中工国际	2,700	22,032.00	0.04
934	688226	威腾电气	874	21,963.62	0.04
935	002908	德生科技	2,500	21,900.00	0.04
936	002649	博彦科技	1,800	21,816.00	0.04
937	300525	博思软件	1,400	21,812.00	0.04
938	301141	中科磁业	600	21,780.00	0.04
939	300726	宏达电子	700	21,770.00	0.04
940	688061	灿瑞科技	750	21,660.00	0.04
941	301189	奥尼电子	900	21,645.00	0.04
942	002983	芯瑞达	1,100	21,604.00	0.04
943	603062	麦加芯彩	600	21,594.00	0.04
944	301515	港通医疗	1,200	21,576.00	0.04
945	688114	华大智造	461	21,570.19	0.04
946	300084	海默科技	4,000	21,520.00	0.04
947	002741	光华科技	1,300	21,476.00	0.04
948	300703	创源股份	1,500	21,405.00	0.04
949	301413	安培龙	400	21,404.00	0.04
950	600738	丽尚国潮	4,300	21,371.00	0.04
951	002342	巨力索具	6,600	21,318.00	0.04
952	300653	正海生物	1,000	21,300.00	0.04
953	301211	亨迪药业	1,000	21,260.00	0.04
954	688693	锆威特	605	21,259.70	0.04
955	301010	晶雪节能	900	21,213.00	0.04
956	300642	透景生命	1,500	21,180.00	0.04
957	002099	海翔药业	4,100	21,156.00	0.04
958	300611	美力科技	2,000	21,140.00	0.04
959	002835	同为股份	1,100	21,120.00	0.04
960	002825	纳尔股份	2,700	21,114.00	0.04
961	605286	同力日升	700	21,112.00	0.04
962	300791	仙乐健康	800	21,064.00	0.04
963	301329	信音电子	1,000	21,050.00	0.04
964	300916	朗特智能	700	21,000.00	0.04
965	301135	瑞德智能	900	20,952.00	0.04
966	301281	科源制药	700	20,937.00	0.04
967	301251	威尔高	600	20,934.00	0.04

968	300224	正海磁材	1,700	20,927.00	0.04
969	301226	祥明智能	900	20,898.00	0.04
970	301510	固高科技	800	20,880.00	0.04
971	000058	深赛格	2,600	20,878.00	0.04
972	300786	国林科技	1,500	20,850.00	0.04
973	688336	三生国健	973	20,841.66	0.04
974	001202	炬申股份	1,500	20,835.00	0.04
975	301031	中熔电气	200	20,804.00	0.04
976	300737	科顺股份	4,100	20,787.00	0.04
977	301277	新天地	1,500	20,745.00	0.04
978	688562	航天软件	1,302	20,714.82	0.03
979	601177	杭齿前进	2,500	20,700.00	0.03
980	688779	五矿新能	3,890	20,694.80	0.03
981	603630	拉芳家化	1,500	20,670.00	0.03
982	300886	华业香料	1,100	20,669.00	0.03
983	300239	东宝生物	3,300	20,658.00	0.03
984	688163	赛伦生物	1,176	20,650.56	0.03
985	688668	鼎通科技	440	20,618.40	0.03
986	300532	今天国际	1,800	20,556.00	0.03
987	300976	达瑞电子	300	20,550.00	0.03
988	600419	天润乳业	2,200	20,482.00	0.03
989	688251	井松智能	1,263	20,410.08	0.03
990	301508	中机认检	600	20,400.00	0.03
990	301568	思泰克	600	20,400.00	0.03
991	603269	海鸥股份	1,900	20,387.00	0.03
992	301337	亚华电子	700	20,370.00	0.03
993	603136	天目湖	1,800	20,340.00	0.03
994	301456	盘古智能	900	20,331.00	0.03
995	600668	尖峰集团	2,000	20,300.00	0.03
996	688663	新风光	930	20,190.30	0.03
997	605068	明新旭腾	1,500	20,175.00	0.03
998	605598	上海港湾	900	20,169.00	0.03
999	301529	福赛科技	700	20,132.00	0.03
1,000	301148	嘉戎技术	1,100	20,130.00	0.03
1,001	688213	思特威	259	20,129.48	0.03
1,002	301511	德福科技	1,600	20,096.00	0.03
1,003	688616	西力科技	1,929	20,042.31	0.03
1,004	301217	铜冠铜箔	1,800	19,944.00	0.03
1,005	688098	申联生物	3,646	19,943.62	0.03
1,006	603937	丽岛新材	2,200	19,932.00	0.03
1,007	301100	风光股份	1,200	19,920.00	0.03
1,008	000020	深华发A	1,600	19,872.00	0.03
1,009	688369	致远互联	989	19,849.23	0.03

1,010	688155	先惠技术	522	19,804.68	0.03
1,011	002878	元隆雅图	1,200	19,776.00	0.03
1,012	002940	昂利康	1,500	19,770.00	0.03
1,013	301032	新柴股份	2,100	19,719.00	0.03
1,014	605177	东亚药业	1,000	19,700.00	0.03
1,015	600854	春兰股份	4,300	19,694.00	0.03
1,016	300939	秋田微	600	19,680.00	0.03
1,016	603711	香飘飘	1,200	19,680.00	0.03
1,017	300644	南京聚隆	900	19,674.00	0.03
1,018	002678	珠江钢琴	4,400	19,668.00	0.03
1,019	603351	威尔药业	800	19,648.00	0.03
1,020	600367	红星发展	1,700	19,618.00	0.03
1,021	301178	天亿马	700	19,565.00	0.03
1,022	002136	安纳达	2,000	19,500.00	0.03
1,022	603211	晋拓股份	1,300	19,500.00	0.03
1,023	300721	怡达股份	1,600	19,488.00	0.03
1,024	603365	水星家纺	1,200	19,440.00	0.03
1,025	688627	精智达	266	19,394.06	0.03
1,026	002613	北玻股份	4,800	19,392.00	0.03
1,027	301320	豪江智能	1,300	19,383.00	0.03
1,028	002462	嘉事堂	1,500	19,380.00	0.03
1,029	603312	西典新能	600	19,368.00	0.03
1,030	301132	满坤科技	700	19,250.00	0.03
1,031	300903	科翔股份	2,400	19,176.00	0.03
1,031	603577	汇金通	2,400	19,176.00	0.03
1,032	002068	黑猫股份	1,800	19,152.00	0.03
1,033	002836	新宏泽	2,600	19,136.00	0.03
1,034	688001	华兴源创	706	19,132.60	0.03
1,035	688799	华纳药厂	455	19,055.40	0.03
1,036	688531	日联科技	400	19,052.00	0.03
1,037	300243	瑞丰高材	2,000	19,040.00	0.03
1,038	600560	金自天正	1,300	19,032.00	0.03
1,039	603758	秦安股份	2,300	18,998.00	0.03
1,040	301096	百诚医药	500	18,970.00	0.03
1,041	603306	华懋科技	600	18,966.00	0.03
1,042	603861	白云电器	2,100	18,900.00	0.03
1,043	002788	鹭燕医药	2,300	18,883.00	0.03
1,044	600513	联环药业	1,900	18,829.00	0.03
1,045	688116	天奈科技	485	18,822.85	0.03
1,046	301330	熵基科技	700	18,816.00	0.03
1,047	603586	金麒麟	1,300	18,811.00	0.03
1,048	603897	长城科技	800	18,800.00	0.03
1,049	002448	中原内配	3,000	18,780.00	0.03

1,050	301555	惠柏新材	800	18,776.00	0.03
1,051	000862	银星能源	3,800	18,772.00	0.03
1,052	603628	清源股份	1,500	18,720.00	0.03
1,053	300296	利亚德	2,900	18,676.00	0.03
1,054	300658	延江股份	3,600	18,648.00	0.03
1,055	603466	风语筑	2,000	18,640.00	0.03
1,056	002014	永新股份	1,700	18,632.00	0.03
1,057	301225	恒勃股份	700	18,578.00	0.03
1,058	300997	欢乐家	1,200	18,552.00	0.03
1,059	603004	鼎龙科技	900	18,549.00	0.03
1,060	301119	正强股份	600	18,546.00	0.03
1,061	002282	博深股份	2,500	18,525.00	0.03
1,062	688680	海优新材	545	18,410.10	0.03
1,063	002766	索菱股份	3,200	18,400.00	0.03
1,063	300387	富邦科技	2,300	18,400.00	0.03
1,064	300931	通用电梯	2,800	18,396.00	0.03
1,065	301388	欣灵电气	800	18,392.00	0.03
1,066	300852	四会富仕	700	18,354.00	0.03
1,067	600883	博闻科技	2,800	18,340.00	0.03
1,068	000570	苏常柴 A	3,600	18,324.00	0.03
1,069	301307	美利信	900	18,297.00	0.03
1,070	003038	鑫铂股份	1,100	18,238.00	0.03
1,071	301151	冠龙节能	1,200	18,228.00	0.03
1,072	600502	安徽建工	3,800	18,164.00	0.03
1,073	603357	设计总院	2,000	18,120.00	0.03
1,074	002402	和而泰	1,000	18,110.00	0.03
1,075	688228	开普云	406	18,091.36	0.03
1,076	002394	联发股份	2,400	18,048.00	0.03
1,077	600987	航民股份	2,600	18,044.00	0.03
1,078	600782	新钢股份	5,400	18,036.00	0.03
1,079	688392	骄成超声	442	18,033.60	0.03
1,080	300795	米奥会展	900	18,009.00	0.03
1,081	000521	长虹美菱	2,200	17,952.00	0.03
1,082	002912	中新赛克	700	17,913.00	0.03
1,083	301525	儒竞科技	300	17,880.00	0.03
1,083	688059	华锐精密	400	17,880.00	0.03
1,084	603817	海峡环保	3,200	17,856.00	0.03
1,085	000607	华媒控股	4,800	17,808.00	0.03
1,085	301081	严牌股份	2,100	17,808.00	0.03
1,086	600232	金鹰股份	3,400	17,782.00	0.03
1,087	002357	富临运业	2,500	17,750.00	0.03
1,088	600783	鲁信创投	1,400	17,738.00	0.03
1,089	300833	浩洋股份	400	17,660.00	0.03

1,090	601008	连云港	4,600	17,618.00	0.03
1,091	603095	越剑智能	800	17,608.00	0.03
1,092	603270	金帝股份	900	17,550.00	0.03
1,093	301229	纽泰格	800	17,544.00	0.03
1,094	002995	天地在线	800	17,528.00	0.03
1,095	301037	保立佳	1,700	17,527.00	0.03
1,096	603677	奇精机械	1,300	17,524.00	0.03
1,097	605399	晨光新材	1,500	17,520.00	0.03
1,098	002921	联诚精密	1,600	17,504.00	0.03
1,099	300768	迪普科技	1,000	17,500.00	0.03
1,099	603026	石大胜华	500	17,500.00	0.03
1,100	301063	海锅股份	1,100	17,468.00	0.03
1,101	301012	扬电科技	700	17,465.00	0.03
1,102	001207	联科科技	900	17,451.00	0.03
1,103	002412	汉森制药	2,900	17,429.00	0.03
1,104	002877	智能自控	2,100	17,409.00	0.03
1,105	002883	中设股份	1,700	17,323.00	0.03
1,106	600191	华资实业	2,500	17,300.00	0.03
1,107	002614	奥佳华	2,600	17,212.00	0.03
1,108	688508	芯朋微	400	17,188.00	0.03
1,109	301503	智迪科技	500	17,160.00	0.03
1,110	300891	惠云钛业	2,100	17,157.00	0.03
1,111	601199	江南水务	3,100	17,143.00	0.03
1,112	688628	优利德	465	17,130.60	0.03
1,113	000019	深粮控股	2,600	17,082.00	0.03
1,114	603867	新化股份	700	17,066.00	0.03
1,115	688549	中巨芯	2,003	17,065.56	0.03
1,116	688269	凯立新材	683	17,061.34	0.03
1,117	300723	一品红	1,000	17,060.00	0.03
1,118	002574	明牌珠宝	3,700	17,057.00	0.03
1,119	301265	华新环保	1,900	17,024.00	0.03
1,120	605287	德才股份	1,400	17,010.00	0.03
1,121	688667	菱电电控	423	17,000.37	0.03
1,122	300539	横河精密	1,600	16,992.00	0.03
1,123	688087	英科再生	558	16,912.98	0.03
1,124	301328	维峰电子	400	16,908.00	0.03
1,125	300618	寒锐钴业	500	16,885.00	0.03
1,126	300631	久吾高科	800	16,880.00	0.03
1,127	301020	密封科技	900	16,875.00	0.03
1,127	301065	本立科技	900	16,875.00	0.03
1,128	688648	中邮科技	723	16,838.67	0.03
1,129	301252	同星科技	500	16,830.00	0.03
1,130	002442	龙星科技	2,800	16,828.00	0.03

1,131	688768	容知日新	463	16,825.42	0.03
1,132	601566	九牧王	2,000	16,820.00	0.03
1,133	600980	北矿科技	1,100	16,808.00	0.03
1,134	000555	神州信息	1,500	16,800.00	0.03
1,134	300593	新雷能	1,500	16,800.00	0.03
1,134	688638	誉辰智能	600	16,800.00	0.03
1,135	688026	洁特生物	1,309	16,794.47	0.03
1,136	600650	锦江在线	1,200	16,776.00	0.03
1,137	001234	泰慕士	1,000	16,770.00	0.03
1,138	603681	永冠新材	1,300	16,757.00	0.03
1,139	300743	天地数码	1,100	16,753.00	0.03
1,140	688577	浙海德曼	427	16,729.86	0.03
1,141	603278	大业股份	2,200	16,698.00	0.03
1,142	301280	珠城科技	400	16,668.00	0.03
1,143	688093	世华科技	823	16,616.37	0.03
1,144	688592	司南导航	444	16,605.60	0.03
1,145	603237	五芳斋	900	16,560.00	0.03
1,146	301258	富士莱	700	16,534.00	0.03
1,147	600714	金瑞矿业	1,700	16,524.00	0.03
1,148	301167	建研设计	1,300	16,497.00	0.03
1,149	301469	恒达新材	700	16,450.00	0.03
1,150	601956	东贝集团	3,400	16,422.00	0.03
1,151	688107	安路科技	554	16,387.32	0.03
1,152	300946	恒而达	600	16,296.00	0.03
1,153	688597	煜邦电力	1,672	16,268.56	0.03
1,154	603533	掌阅科技	800	16,248.00	0.03
1,155	603931	格林达	700	16,233.00	0.03
1,156	000913	钱江摩托	900	16,209.00	0.03
1,157	301175	中科环保	3,000	16,200.00	0.03
1,158	688013	天臣医疗	919	16,183.59	0.03
1,159	301231	荣信文化	900	16,182.00	0.03
1,160	600773	西藏城投	1,500	16,170.00	0.03
1,161	300638	广和通	800	16,120.00	0.03
1,162	300984	金沃股份	400	16,080.00	0.03
1,163	300709	精研科技	400	16,068.00	0.03
1,164	688589	力合微	586	16,038.82	0.03
1,165	301138	华研精机	600	16,014.00	0.03
1,166	688321	微芯生物	860	15,978.80	0.03
1,167	001260	坤泰股份	1,000	15,880.00	0.03
1,168	001360	南矿集团	1,200	15,840.00	0.03
1,169	301499	维科精密	600	15,834.00	0.03
1,170	688720	艾森股份	400	15,824.00	0.03
1,171	603325	博隆技术	200	15,822.00	0.03

1,172	688255	凯尔达	592	15,812.32	0.03
1,173	300995	奇德新材	1,000	15,810.00	0.03
1,174	605189	富春染织	1,300	15,795.00	0.03
1,175	600774	汉商集团	2,100	15,729.00	0.03
1,176	300579	数字认证	500	15,710.00	0.03
1,177	688625	呈和科技	411	15,691.98	0.03
1,178	301362	民爆光电	400	15,688.00	0.03
1,179	300879	大叶股份	1,000	15,680.00	0.03
1,180	301498	乖宝宠物	200	15,664.00	0.03
1,181	300534	陇神戎发	1,800	15,660.00	0.03
1,182	603569	长久物流	2,100	15,624.00	0.03
1,183	300973	立高食品	400	15,612.00	0.03
1,184	001359	平安电工	600	15,546.00	0.03
1,185	688105	诺唯赞	700	15,519.00	0.03
1,186	603856	东宏股份	1,400	15,470.00	0.03
1,187	003030	祖名股份	1,000	15,380.00	0.03
1,188	688618	三旺通信	726	15,253.26	0.03
1,189	603678	火炬电子	500	15,250.00	0.03
1,190	000837	秦川机床	1,700	15,249.00	0.03
1,191	688209	英集芯	861	15,213.87	0.03
1,192	002864	盘龙药业	500	15,205.00	0.03
1,193	603610	麒盛科技	1,200	15,132.00	0.03
1,194	300731	科创新源	700	15,127.00	0.03
1,195	300936	中英科技	400	15,120.00	0.03
1,195	300960	通业科技	600	15,120.00	0.03
1,196	603197	保隆科技	400	15,100.00	0.03
1,197	001389	广合科技	300	15,090.00	0.03
1,198	300261	雅本化学	2,200	15,070.00	0.03
1,199	603876	鼎胜新材	1,700	15,045.00	0.03
1,200	600017	日照港	4,700	15,040.00	0.03
1,201	301332	德尔玛	1,500	15,030.00	0.03
1,202	603058	永吉股份	1,700	14,994.00	0.03
1,202	603380	易德龙	600	14,994.00	0.03
1,203	000828	东莞控股	1,400	14,966.00	0.03
1,204	301161	唯万密封	700	14,959.00	0.03
1,205	300951	博硕科技	500	14,935.00	0.03
1,206	688170	德龙激光	661	14,865.89	0.03
1,207	600125	铁龙物流	2,500	14,825.00	0.03
1,208	301391	卡莱特	400	14,804.00	0.02
1,209	688249	晶合集成	634	14,797.56	0.02
1,210	688689	银河微电	698	14,790.62	0.02
1,211	003021	兆威机电	200	14,782.00	0.02
1,212	688135	利扬芯片	733	14,711.31	0.02

1,213	605108	同庆楼	600	14,706.00	0.02
1,214	301007	德迈仕	800	14,704.00	0.02
1,215	603518	锦泓集团	1,500	14,700.00	0.02
1,216	001373	翔腾新材	500	14,690.00	0.02
1,217	300864	南大环境	700	14,679.00	0.02
1,218	300428	立中集团	900	14,670.00	0.02
1,219	603617	君禾股份	2,000	14,660.00	0.02
1,220	301289	国缆检测	300	14,658.00	0.02
1,221	688448	磁谷科技	521	14,655.73	0.02
1,222	301097	天益医疗	400	14,640.00	0.02
1,223	603350	安乃达	400	14,600.00	0.02
1,224	688308	欧科亿	808	14,584.40	0.02
1,225	688118	普元信息	691	14,531.73	0.02
1,226	000532	华金资本	1,100	14,520.00	0.02
1,227	300899	上海凯鑫	700	14,518.00	0.02
1,228	000852	石化机械	2,100	14,490.00	0.02
1,229	300234	开尔新材	3,100	14,477.00	0.02
1,230	003020	立方制药	800	14,432.00	0.02
1,231	605378	野马电池	700	14,420.00	0.02
1,232	688307	中润光学	600	14,400.00	0.02
1,233	300321	同大股份	700	14,392.00	0.02
1,234	603803	瑞斯康达	1,500	14,310.00	0.02
1,235	000605	渤海股份	1,800	14,292.00	0.02
1,236	000920	沃顿科技	1,600	14,272.00	0.02
1,237	605055	迎丰股份	2,900	14,268.00	0.02
1,238	300989	蕾奥规划	900	14,265.00	0.02
1,239	688683	莱尔科技	718	14,259.48	0.02
1,240	301339	通行宝	700	14,238.00	0.02
1,241	600218	全柴动力	1,800	14,220.00	0.02
1,242	301287	康力源	500	14,205.00	0.02
1,243	688529	豪森智能	898	14,089.62	0.02
1,244	600137	浪莎股份	1,000	14,050.00	0.02
1,245	300415	伊之密	700	14,042.00	0.02
1,246	605369	拱东医疗	500	14,040.00	0.02
1,247	001212	中旗新材	600	14,028.00	0.02
1,248	002184	海得控制	1,200	14,016.00	0.02
1,249	301507	民生健康	1,100	13,959.00	0.02
1,250	688566	吉贝尔	622	13,932.80	0.02
1,251	301317	鑫磊股份	700	13,923.00	0.02
1,252	002780	三夫户外	1,100	13,915.00	0.02
1,253	001266	宏英智能	600	13,896.00	0.02
1,254	605058	澳弘电子	700	13,881.00	0.02
1,255	301368	丰立智能	300	13,845.00	0.02

1,256	603076	乐惠国际	600	13,824.00	0.02
1,257	300648	星云股份	600	13,800.00	0.02
1,258	300082	奥克股份	2,200	13,794.00	0.02
1,259	300615	欣天科技	1,200	13,788.00	0.02
1,260	301170	锡南科技	600	13,752.00	0.02
1,261	300553	集智股份	500	13,750.00	0.02
1,262	688655	迅捷兴	1,274	13,733.72	0.02
1,263	001219	青岛食品	1,000	13,730.00	0.02
1,264	300902	国安达	600	13,728.00	0.02
1,265	300226	上海钢联	600	13,722.00	0.02
1,266	301353	普莱得	500	13,720.00	0.02
1,267	603286	日盈电子	700	13,706.00	0.02
1,268	300685	艾德生物	600	13,680.00	0.02
1,269	688466	金科环境	1,008	13,658.40	0.02
1,270	301233	盛帮股份	300	13,635.00	0.02
1,271	002030	达安基因	2,400	13,632.00	0.02
1,272	688066	航天宏图	668	13,627.20	0.02
1,273	002977	火箭科技	500	13,605.00	0.02
1,274	301002	崧盛股份	800	13,592.00	0.02
1,275	002400	省广集团	1,700	13,583.00	0.02
1,276	300690	双一科技	600	13,566.00	0.02
1,277	600318	新力金融	1,600	13,552.00	0.02
1,278	301051	信濠光电	500	13,530.00	0.02
1,279	301209	联合化学	500	13,525.00	0.02
1,280	301519	舜禹股份	1,000	13,510.00	0.02
1,281	001205	盛航股份	700	13,503.00	0.02
1,282	301257	普蕊斯	500	13,480.00	0.02
1,283	300616	尚品宅配	1,100	13,475.00	0.02
1,284	688244	永信至诚	526	13,465.60	0.02
1,285	002833	弘亚数控	800	13,464.00	0.02
1,285	603165	荣晟环保	1,100	13,464.00	0.02
1,286	002187	广百股份	1,900	13,452.00	0.02
1,287	002134	天津普林	700	13,440.00	0.02
1,287	605300	佳禾食品	1,000	13,440.00	0.02
1,288	688456	有研粉材	404	13,428.96	0.02
1,289	301359	东南电子	600	13,428.00	0.02
1,289	600037	歌华有线	1,800	13,428.00	0.02
1,290	003033	征和工业	500	13,425.00	0.02
1,291	300992	泰福泵业	500	13,400.00	0.02
1,292	003036	泰坦股份	1,100	13,398.00	0.02
1,293	688297	中无人机	332	13,372.96	0.02
1,294	002317	众生药业	1,100	13,365.00	0.02
1,295	000993	闽东电力	1,600	13,360.00	0.02

1,296	605377	华旺科技	1,000	13,350.00	0.02
1,297	301418	协昌科技	400	13,340.00	0.02
1,298	000758	中色股份	2,700	13,338.00	0.02
1,298	301069	凯盛新材	900	13,338.00	0.02
1,299	688395	正弦电气	784	13,320.16	0.02
1,300	301125	腾亚精工	1,200	13,320.00	0.02
1,301	605389	长龄液压	500	13,315.00	0.02
1,302	001230	劲旅环境	800	13,264.00	0.02
1,303	300851	交大思诺	500	13,250.00	0.02
1,304	001206	依依股份	800	13,224.00	0.02
1,305	300740	水羊股份	1,000	13,220.00	0.02
1,306	605388	均瑶健康	2,100	13,209.00	0.02
1,307	001368	通达创智	700	13,202.00	0.02
1,308	688355	明志科技	788	13,199.00	0.02
1,309	002651	利君股份	1,800	13,194.00	0.02
1,310	301133	金钟股份	600	13,188.00	0.02
1,311	300948	冠中生态	1,400	13,174.00	0.02
1,312	300288	朗玛信息	900	13,158.00	0.02
1,313	002971	和远气体	700	13,125.00	0.02
1,314	688518	联赢激光	828	13,115.52	0.02
1,315	603706	东方环宇	700	13,097.00	0.02
1,316	301548	崇德科技	300	13,056.00	0.02
1,317	300535	达威股份	1,000	13,030.00	0.02
1,318	603217	元利科技	800	13,024.00	0.02
1,319	300445	康斯特	800	13,016.00	0.02
1,320	002226	江南化工	2,400	13,008.00	0.02
1,321	002133	广宇集团	5,100	13,005.00	0.02
1,322	002903	宇环数控	800	13,000.00	0.02
1,323	300514	友讯达	900	12,996.00	0.02
1,324	688459	哈铁科技	1,348	12,994.72	0.02
1,325	300906	日月明	500	12,990.00	0.02
1,326	688695	中创股份	427	12,985.07	0.02
1,327	300039	上海凯宝	2,100	12,978.00	0.02
1,328	300858	科拓生物	900	12,942.00	0.02
1,329	301509	金凯生科	500	12,940.00	0.02
1,330	300867	圣元环保	1,000	12,930.00	0.02
1,331	603992	松霖科技	700	12,929.00	0.02
1,332	002909	集泰股份	2,600	12,922.00	0.02
1,333	300977	深圳瑞捷	700	12,901.00	0.02
1,334	000762	西藏矿业	600	12,900.00	0.02
1,335	300915	海融科技	400	12,880.00	0.02
1,336	301149	隆华新材	1,300	12,857.00	0.02
1,337	300625	三雄极光	1,100	12,826.00	0.02

1,338	300031	宝通科技	700	12,824.00	0.02
1,339	002346	柘中股份	1,300	12,818.00	0.02
1,340	301603	乔锋智能	300	12,816.00	0.02
1,341	600399	抚顺特钢	2,200	12,760.00	0.02
1,342	688528	秦川物联	1,458	12,757.50	0.02
1,343	301222	浙江恒威	500	12,725.00	0.02
1,344	300192	科德教育	800	12,720.00	0.02
1,345	603320	迪贝电气	900	12,708.00	0.02
1,346	300801	泰和科技	800	12,696.00	0.02
1,347	003004	声迅股份	500	12,695.00	0.02
1,348	301163	宏德股份	600	12,678.00	0.02
1,349	300838	浙江力诺	1,000	12,660.00	0.02
1,350	300955	嘉亨家化	800	12,640.00	0.02
1,351	605319	无锡振华	600	12,630.00	0.02
1,352	603391	力聚热能	300	12,627.00	0.02
1,353	300907	康平科技	600	12,624.00	0.02
1,354	300517	海波重科	1,500	12,615.00	0.02
1,355	002840	华统股份	1,000	12,610.00	0.02
1,355	300697	电工合金	1,000	12,610.00	0.02
1,356	688552	航天南湖	755	12,608.50	0.02
1,357	301356	天振股份	800	12,608.00	0.02
1,358	301500	飞南资源	700	12,600.00	0.02
1,358	603701	德宏股份	900	12,600.00	0.02
1,358	605567	春雪食品	1,400	12,600.00	0.02
1,359	301016	雷尔伟	600	12,576.00	0.02
1,360	688143	长盈通	571	12,573.42	0.02
1,361	688236	春立医疗	981	12,556.80	0.02
1,362	002588	史丹利	1,700	12,546.00	0.02
1,363	002053	云南能投	1,100	12,540.00	0.02
1,363	301295	美硕科技	600	12,540.00	0.02
1,363	600284	浦东建设	2,000	12,540.00	0.02
1,364	603408	建霖家居	1,000	12,530.00	0.02
1,365	002772	众兴菌业	1,700	12,529.00	0.02
1,366	301238	瑞泰新材	800	12,528.00	0.02
1,367	003023	彩虹集团	700	12,523.00	0.02
1,368	301073	君亭酒店	600	12,522.00	0.02
1,369	002040	南京港	1,900	12,521.00	0.02
1,370	002870	香山股份	400	12,520.00	0.02
1,371	001318	阳光乳业	1,100	12,507.00	0.02
1,372	002441	众业达	1,600	12,448.00	0.02
1,373	001299	美能能源	1,000	12,440.00	0.02
1,374	688314	康拓医疗	431	12,412.80	0.02
1,375	301298	东利机械	900	12,402.00	0.02

1,376	301180	万祥科技	800	12,376.00	0.02
1,377	300232	洲明科技	1,800	12,366.00	0.02
1,378	600586	金晶科技	2,200	12,364.00	0.02
1,379	301392	汇成真空	200	12,352.00	0.02
1,380	688573	信宇人	791	12,331.69	0.02
1,381	002079	苏州固锟	1,200	12,324.00	0.02
1,382	301210	金杨股份	400	12,292.00	0.02
1,383	300107	建新股份	1,300	12,272.00	0.02
1,384	301288	清研环境	800	12,264.00	0.02
1,385	000096	广聚能源	1,000	12,260.00	0.02
1,386	603661	恒林股份	400	12,256.00	0.02
1,387	688119	中钢洛耐	3,141	12,249.90	0.02
1,388	001313	粤海饲料	1,400	12,236.00	0.02
1,389	002783	凯龙股份	1,500	12,225.00	0.02
1,390	003007	直真科技	400	12,204.00	0.02
1,390	605169	洪通燃气	1,200	12,204.00	0.02
1,391	603171	税友股份	400	12,200.00	0.02
1,392	301079	邵阳液压	800	12,192.00	0.02
1,393	301192	泰祥股份	700	12,187.00	0.02
1,394	300971	博亚精工	600	12,180.00	0.02
1,395	000035	中国天楹	2,500	12,175.00	0.02
1,396	300655	晶瑞电材	1,300	12,168.00	0.02
1,397	603836	海程邦达	1,000	12,160.00	0.02
1,398	603079	圣达生物	900	12,123.00	0.02
1,399	603790	雅运股份	1,100	12,122.00	0.02
1,400	003016	欣贺股份	1,400	12,110.00	0.02
1,401	300813	泰林生物	700	12,089.00	0.02
1,402	301309	万得凯	500	12,085.00	0.02
1,403	603390	通达电气	1,100	12,078.00	0.02
1,404	000631	顺发恒业	4,100	12,054.00	0.02
1,405	002910	庄园牧场	1,600	12,048.00	0.02
1,406	603186	华正新材	500	12,045.00	0.02
1,407	301102	兆讯传媒	1,100	12,023.00	0.02
1,408	603151	邦基科技	1,200	12,012.00	0.02
1,409	301237	和顺科技	500	12,000.00	0.02
1,410	603311	金海高科	1,200	11,988.00	0.02
1,411	300129	泰胜风能	1,700	11,985.00	0.02
1,412	001324	长青科技	700	11,984.00	0.02
1,413	600794	保税科技	3,300	11,979.00	0.02
1,414	600731	湖南海利	2,100	11,970.00	0.02
1,415	603373	安邦护卫	400	11,956.00	0.02
1,416	300789	唐源电气	800	11,952.00	0.02
1,417	300756	金马游乐	800	11,912.00	0.02

1,418	300970	华绿生物	1,000	11,900.00	0.02
1,419	300784	利安科技	200	11,898.00	0.02
1,420	601968	宝钢包装	2,400	11,880.00	0.02
1,421	300901	中胤时尚	1,000	11,860.00	0.02
1,422	688468	科美诊断	1,730	11,850.50	0.02
1,423	688585	上纬新材	1,779	11,848.14	0.02
1,424	002302	西部建设	1,800	11,844.00	0.02
1,424	601778	晶科科技	4,200	11,844.00	0.02
1,425	300873	海晨股份	700	11,837.00	0.02
1,425	300983	尤安设计	700	11,837.00	0.02
1,425	603201	常润股份	700	11,837.00	0.02
1,426	605299	舒华体育	1,500	11,835.00	0.02
1,427	600679	上海凤凰	900	11,817.00	0.02
1,427	600798	宁波海运	3,900	11,817.00	0.02
1,428	300382	斯莱克	1,100	11,814.00	0.02
1,429	300649	杭州园林	1,100	11,781.00	0.02
1,430	002434	万里扬	1,900	11,780.00	0.02
1,431	300174	元力股份	800	11,776.00	0.02
1,432	600785	新华百货	900	11,763.00	0.02
1,433	301587	中瑞股份	500	11,750.00	0.02
1,434	300214	日科化学	2,100	11,739.00	0.02
1,435	600661	昂立教育	1,000	11,720.00	0.02
1,436	301053	远信工业	600	11,706.00	0.02
1,437	300819	聚杰微纤	900	11,700.00	0.02
1,438	603282	亚光股份	800	11,696.00	0.02
1,439	001231	农心科技	700	11,683.00	0.02
1,440	300865	大宏立	500	11,670.00	0.02
1,441	301092	争光股份	500	11,665.00	0.02
1,442	301319	唯特偶	400	11,664.00	0.02
1,443	300923	研奥股份	600	11,652.00	0.02
1,444	002691	冀凯股份	2,300	11,638.00	0.02
1,445	002645	华宏科技	1,700	11,594.00	0.02
1,446	603273	天元智能	700	11,564.00	0.02
1,447	002395	双象股份	700	11,557.00	0.02
1,448	301520	万邦医药	300	11,550.00	0.02
1,448	603183	建研院	3,000	11,550.00	0.02
1,448	603289	泰瑞机器	1,400	11,550.00	0.02
1,449	300845	捷安高科	900	11,529.00	0.02
1,450	300371	汇中股份	1,200	11,508.00	0.02
1,450	301566	达利凯普	700	11,508.00	0.02
1,451	600817	宇通重工	1,000	11,480.00	0.02
1,452	002562	兄弟科技	2,700	11,475.00	0.02
1,453	603385	惠达卫浴	1,800	11,448.00	0.02

1,454	300305	裕兴股份	2,100	11,445.00	0.02
1,455	688503	聚和材料	258	11,426.82	0.02
1,456	688196	卓越新能	340	11,420.60	0.02
1,457	300106	西部牧业	1,300	11,414.00	0.02
1,458	300746	汉嘉设计	1,000	11,410.00	0.02
1,459	600868	梅雁吉祥	4,600	11,408.00	0.02
1,460	002829	星网宇达	600	11,376.00	0.02
1,461	002696	百洋股份	2,400	11,352.00	0.02
1,462	600843	上工申贝	900	11,322.00	0.02
1,463	301008	宏昌科技	600	11,298.00	0.02
1,464	600676	交运股份	2,500	11,275.00	0.02
1,465	603375	盛景微	300	11,217.00	0.02
1,466	600400	红豆股份	4,500	11,205.00	0.02
1,467	002820	桂发祥	900	11,178.00	0.02
1,468	603116	红蜻蜓	2,000	11,100.00	0.02
1,469	301129	瑞纳智能	400	11,060.00	0.02
1,470	600880	博瑞传播	2,300	10,902.00	0.02
1,471	002329	皇氏集团	3,000	10,890.00	0.02
1,472	002819	东方中科	400	10,872.00	0.02
1,473	300824	北鼎股份	1,100	10,758.00	0.02

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688038	中科通达	5,484,167.84	1.34
2	300665	飞鹿股份	5,291,488.00	1.30
3	688041	海光信息	5,249,722.87	1.29
4	688681	科汇股份	4,877,464.08	1.19
5	002883	中设股份	4,820,147.40	1.18
6	300992	泰福泵业	4,478,051.00	1.10
7	300703	创源股份	4,388,681.00	1.08
8	300329	海伦钢琴	4,171,892.00	1.02
9	603139	康惠制药	4,155,175.00	1.02
10	300923	研奥股份	4,074,843.00	1.00
11	600302	标准股份	4,036,871.00	0.99
12	603931	格林达	4,007,483.00	0.98
13	300626	华瑞股份	4,007,442.27	0.98
14	300640	德艺文创	3,878,371.00	0.95
15	603320	迪贝电气	3,759,421.00	0.92
16	000526	学大教育	3,755,665.00	0.92
17	301040	中环海陆	3,710,740.00	0.91
18	603637	镇海股份	3,696,404.00	0.91

19	002826	易明医药	3,681,078.00	0.90
20	600883	博闻科技	3,636,794.00	0.89

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

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300665	飞鹿股份	11,108,074.00	2.72
2	300816	艾可蓝	7,600,612.00	1.86
3	300329	海伦钢琴	6,976,305.00	1.71
4	603320	迪贝电气	6,952,858.70	1.70
5	301198	喜悦智行	6,827,951.42	1.67
6	301098	金埔园林	6,719,412.07	1.65
7	301167	建研设计	6,613,750.00	1.62
8	300929	华骐环保	6,478,564.40	1.59
9	300640	德艺文创	6,245,292.00	1.53
10	300649	杭州园林	6,154,282.00	1.51
11	002633	申科股份	6,134,357.00	1.50
12	300478	杭州高新	5,985,140.00	1.47
13	300931	通用电梯	5,914,909.00	1.45
14	300746	汉嘉设计	5,858,075.22	1.44
15	300823	建科智能	5,854,839.56	1.43
16	688041	海光信息	5,807,286.83	1.42
17	688092	爱科科技	5,760,036.49	1.41
18	600455	博通股份	5,654,959.00	1.39
19	300535	达威股份	5,608,472.67	1.37
20	301040	中环海陆	5,539,964.34	1.36

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

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,514,007,063.38
卖出股票收入（成交）总额	1,770,332,103.99

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

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

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,931,880.96	6.64
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	3,931,880.96	6.64

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019749	24 国债 15	34,000	3,426,389.59	5.79
2	019740	24 国债 09	4,000	405,053.59	0.68
3	019758	24 国债 21	1,000	100,437.78	0.17

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,833.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	79,120.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,954.13

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002379	宏创控股	193,752.00	0.33	重大事项停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

东方量化成长灵活配置混合 A	35,013	1,238.22	14,421,488.71	33.26	28,932,397.92	66.74
东方量化成长灵活配置混合 C	1,748	2,785.75	379.46	0.01	4,869,114.30	99.99
合计	36,761	1,311.81	14,421,868.17	29.91	33,801,512.22	70.09

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方量化成长灵活配置混合 A	428,346.16	0.99
	东方量化成长灵活配置混合 C	4,671.92	0.10
	合计	433,018.08	0.90

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方量化成长灵活配置混合 A	0
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方量化成长灵活配置混合 A	0~10
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2018年3月21日) 基金份额总额	694,463,618.20	-
本报告期期初基金份额总额	343,192,547.80	8,571,332.62
本报告期基金总申购份额	84,659,219.98	93,555,803.76

减：本报告期基金总赎回份额	384,497,881.15	97,257,642.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	43,353,886.63	4,869,493.76

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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，无涉及基金管理人的重大人事变动。

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金于 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。本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 35,000.00 元；截至 2024 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华鑫证券有限责任公司	2	1,352,391,503.67	41.18	332,554.12	17.66	-
中信建投证券股份有限公司	2	653,599,640.17	19.90	589,573.18	31.30	-
华西证券股份有限公司	2	348,112,066.51	10.60	177,934.64	9.45	-
东北证券股份有限公司	2	271,579,927.77	8.27	242,794.22	12.89	-
国投证券股份有限公司	1	210,650,790.44	6.41	199,256.94	10.58	-
国泰君安证券股份有限公司	1	173,955,306.51	5.30	155,150.63	8.24	-
东方财富证券股份有限公司	2	143,081,988.97	4.36	135,342.16	7.19	-
国联证券股份有限公司	2	72,115,678.97	2.20	24,944.59	1.32	-
国金证券股份有限公司	1	58,375,912.36	1.78	26,030.60	1.38	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

华创证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-
长城证券 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资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格，能够提供高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

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

(3) 本基金本报告期撤销租用 1 个交易单元，为中国中金财富证券有限公司深圳证券交易所交易单元。新增 1 个交易单元，为中信建投证券股份有限公司北京证券交易所交易单元。

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华鑫证券有限责任公司	22,914,610.00	54.77	14,940,000.00	44.31	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	12,623,013.00	30.17	15,875,000.00	47.09	-	-
东北证券股份有限公司	5,702,171.00	13.63	2,900,000.00	8.60	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
东方财 富证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股 份有 限公 司	601,608.00	1.44	-	-	-	-
国金证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证 券股 份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方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	关于增加国金证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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 12 日
3	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金(A类)恢复 10 万元以上申购、转换转入、定期定额投资公告	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 15 日
4	东方量化成长灵活配置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
5	关于增加兴业证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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 24 日
6	关于增加中信建投证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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 31 日
7	关于增加华西证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
8	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

9	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
10	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	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
11	关于增加华泰证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、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 26 日
12	关于增加上海中欧财富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	2024 年 2 月 28 日
13	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
14	关于增加中国银河证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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 3 月 8 日
15	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
16	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
17	关于增加粤开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	2024 年 3 月 19 日
18	关于旗下部分基金参与华福证券有限	证券时报、证券日报、	2024 年 3 月 27 日

	责任公司等两家机构申购费率优惠活动的公告	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	
19	东方量化成长灵活配置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
20	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
21	东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北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
22	东方量化成长灵活配置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
23	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	2024 年 4 月 30 日
24	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）（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 4 月 30 日
25	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 6 月 17 日
26	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	2024 年 6 月 27 日
27	关于增加东方证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 29 日
28	关于增加嘉实财富管理有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 12 日
29	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 19 日

30	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 1 日
31	关于增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构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 8 月 5 日
32	东方基金管理股份有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司、中国国际期货股份有限公司、中民财富基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 12 日
33	关于增加中信证券股份有限公司等四家机构为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 13 日
34	关于增加民商基金销售（上海）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 8 月 21 日
35	东方基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	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 8 月 27 日
36	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 31 日
37	关于暂停武汉佰鲲基金销售有限公司（曾用名：武汉市伯嘉基金销售有限公司）办理旗下基金相关销售业务的公告	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 9 月 13 日
38	关于增加交通银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 19 日
39	东方基金管理股份有限公司关于终止天津市润泽基金销售有限公司、北京市增财基金销售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 9 月 25 日

		露网站	
40	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 9 月 27 日
41	关于增加吉林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	2024 年 9 月 27 日
42	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 25 日
43	东方基金管理股份有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司、深圳富济基金销售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 11 月 6 日
44	关于增加上海陆金所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	2024 年 11 月 12 日
45	东方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	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 11 月 15 日
46	东方基金管理股份有限公司关于终止乾道基金销售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 11 月 22 日
47	关于旗下部分基金参与中信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 11 月 27 日
48	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 12 月 6 日

49	关于增加上海云湾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 12 月 12 日
----	--	---	------------------

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240223 - 20240227	0.00	21,369,547.76	21,369,547.76	0.00	0.00
	2	20240229 - 20240304	0.00	21,369,547.76	21,369,547.76	0.00	0.00
	3	20240101 - 20240220	101,476,445.29	0.00	101,476,445.29	0.00	0.00
	4	20240101 - 20240205	101,476,445.29	2,448,517.87	103,924,963.16	0.00	0.00
	5	20240416 - 20241231	0.00	32,484,421.28	18,065,195.83	14,419,225.45	29.90
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本,可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时,基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理,可能会影响投资者赎回。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2025 年 3 月 31 日