

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

2023 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：2024 年 3 月 30 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 2024 年 3 月 29 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 2023 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	10
<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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>52</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	89
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 .....	89
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 .....	89
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 .....	89
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 .....	89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	90
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	90
8.12 投资组合报告附注 .....	90
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>90</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	90
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	91
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 .....	91
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>91</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>92</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	92
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 .....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
11.4 基金投资策略的改变 .....	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	92
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 .....	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	93
11.8 其他重大事件 .....	97
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>102</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 .....	102
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>102</b>
13.1 备查文件目录 .....	102
13.2 存放地点 .....	103
13.3 查阅方式 .....	103

## § 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	351,763,880.42 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	343,192,547.80 份	8,571,332.62 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。

注：本基金从 2023 年 8 月 28 日起调整基金费率，相关公告已于 2023 年 8 月 25 日在规定媒介上公告。

本基金从 2023 年 11 月 24 日起增设 C 类基金份额、变更业绩比较基准，相关公告已于 2023 年 11 月 23 日在中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》和本公司网站上进行披露。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 姓名	李景岩	王小飞

负责人	联系电话	010-66295888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	021-60637228
传真		010-66578700	021-60635778
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100073	100033
法定代表人		崔伟	田国立

## 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	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号四层
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	2023 年	2023 年 11 月 24 日 (基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	2022 年		2021 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 A	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 A

				置 混 合 C		置 混 合 C
本期已实现收益	18,486,216.01	-101,920.88	-2,287,413.12	-	2,343,542.66	-
本期利润	18,921,025.86	-15,142.26	-3,455,411.04	-	3,379,748.00	-
加权平均基金份额本期利润	0.2704	-0.0031	-0.2642	-	0.2158	-
本期加权平均净值利润率	19.38%	-0.20%	-18.15%	-	14.30%	-
本期基金份额净值增长率	13.43%	-0.23%	-15.91%	-	14.86%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	51,689,186.42	4,728,766.40	4,285,847.03	-	8,629,868.02	-
期末可供分配基金份额利润	0.1506	0.5517	0.3593	-	0.6165	-
期末基金资产净值	394,881,734.22	13,300,099.02	16,213,385.02	-	22,628,728.68	-
期末基金份额净值	1.1506	1.5517	1.3593	-	1.6165	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	54.19%	-0.23%	35.93%	-	61.65%	-

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	3.29%	1.08%	-4.28%	0.76%	7.57%	0.32%
过去六个月	7.94%	0.99%	-7.22%	0.64%	15.16%	0.35%
过去一年	13.43%	0.90%	-5.54%	0.56%	18.97%	0.34%
过去三年	9.56%	1.09%	-8.44%	0.67%	18.00%	0.42%
过去五年	85.01%	1.22%	20.29%	0.78%	64.72%	0.44%
自基金合同生效起至今	54.19%	1.18%	-2.33%	0.80%	56.52%	0.38%

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
自基金合同生效起至今	-0.23%	0.97%	-3.59%	0.97%	3.36%	0.00%

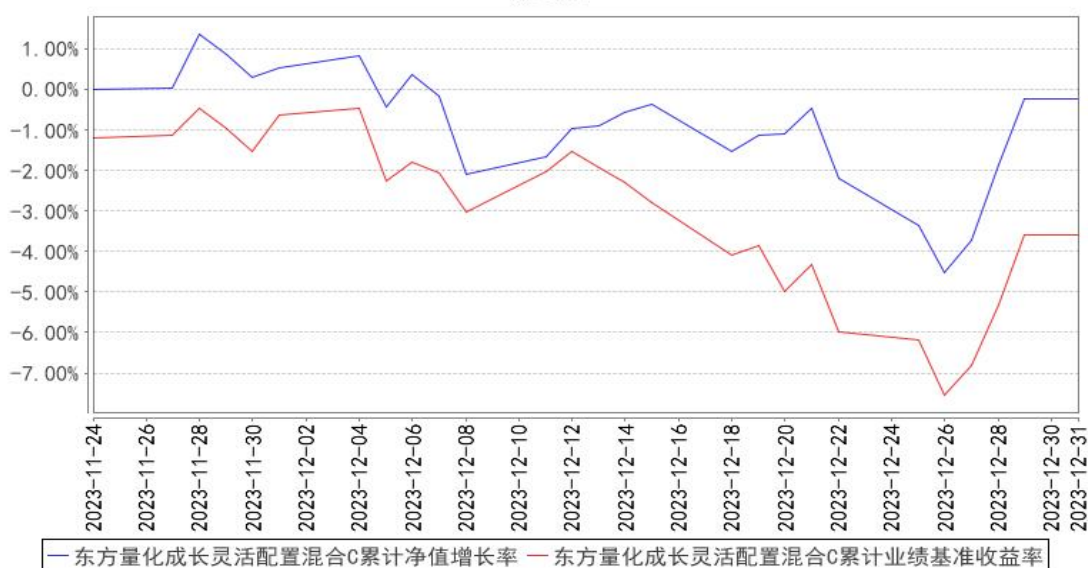


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

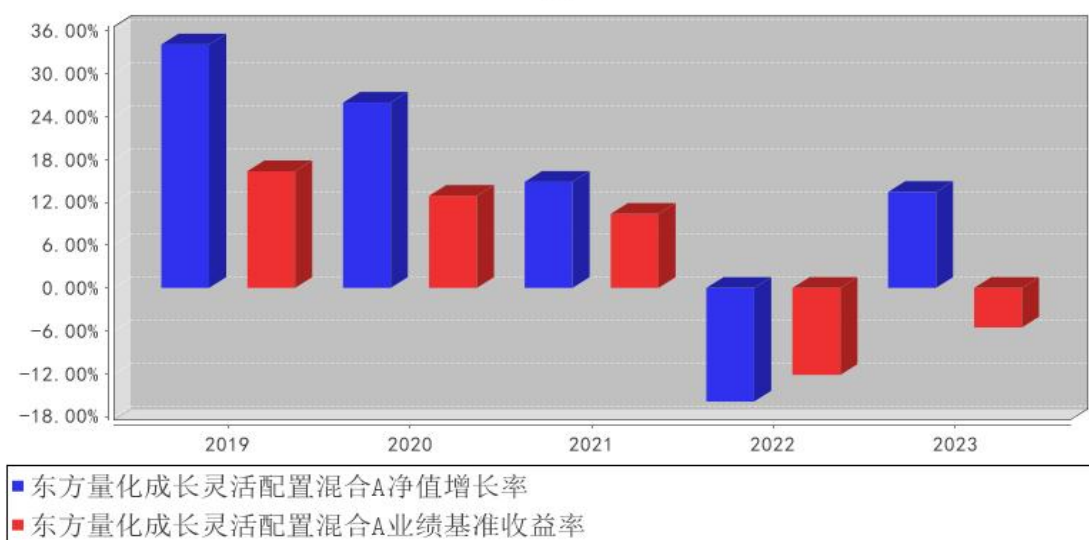


东方量化成长灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

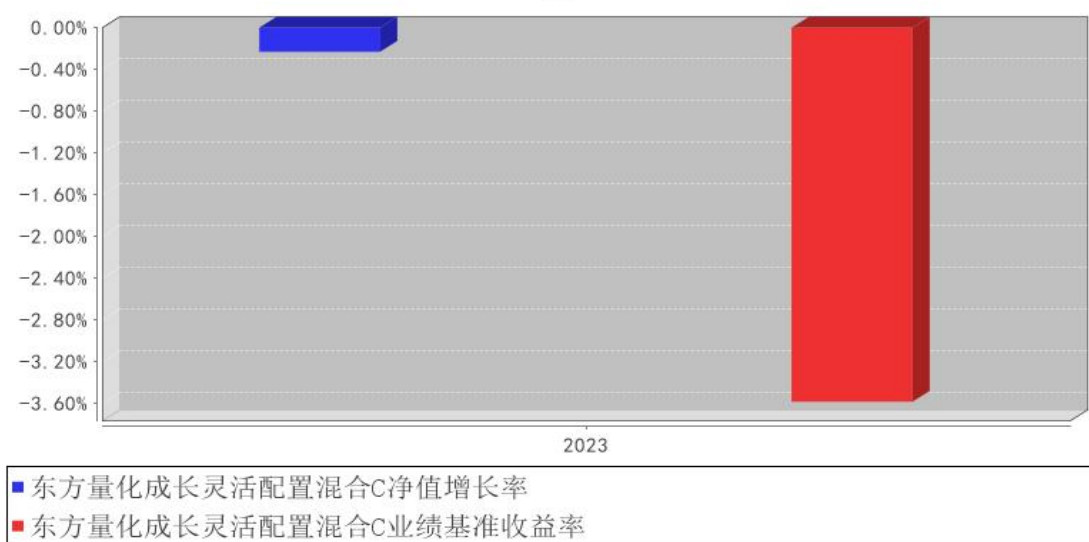


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2023 年	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 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2023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2023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、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方

恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金。

#### 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	-	8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，8年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018年7月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理，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、东方中证 500 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	-	8年	中国人民大学金融专业硕士，8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：①2024 年 3 月 5 日，公司发布了《东方中证 500 指数增强型证券投资基金清算报告》，自 2024 年 3 月 5 日起盛泽先生不再担任东方中证 500 指数增强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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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。策略运行良好，最终在小微市值带来的BETA收益和多因子模型带来的ALPHA收益的结合下，本报告期产品取得了一定正收益。本基金已于2023年第四季度将业绩比较基准变更为“中证2000指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”，以更贴近于基金实际运作情况，未来仍将继续长期聚焦于小盘股领域。在多因子模型的大类因子配比上，本年度内主要以量价因子为主，其中尤其以高频交易数据（例如分钟级的成交、委托、盘口数据）为基础计算的量价因子占据的权重较大，其次是资金流类、舆情类因子和少量基本面类因子。在组合构建上本年度仍继续采用较为分散的持仓模式。未来本基金仍将继续使用多因子模型进行选股，力求选出未来潜在收益高的股票并持有。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023年01月01日起至2023年12月31日，本基金A类净值增长率为13.43%，业绩比较基准收益率为-5.54%，高于业绩比较基准18.97%；本基金C类净值增长率为-0.23%，业绩比较基准收

益率为-3.59%，高于业绩比较基准 3.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从今年的政府工作报告来看，我们相信未来一年中国经济仍将保持良好势头，在确保高质量发展的前提下，完成 5% 的 GDP 增速目标，居民收入也将与经济同步增长。报告也提到要“增强资本市场内在稳定性”，相信在未来一年，证券市场仍将在稳定的前提下，进一步实现健全和法治化。

#### 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《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》的相关规定，本年度基金管理人对本基金份额持有人实施了分红，按照《基金合同》规定：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低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，具体分配情况如下：

2023 年 11 月 28 日为收益分配基准日，基准日基金 A 类可供分配利润 189,034,949.07 元，基金 C 类可供分配利润 90,645.30 元；基金 A 类实际分配金额 132,011,767.89 元，每 10 份基金份额分配现金红利 3.9400 元，基金 C 类实际分配金额 0.00 元，每 10 份基金份额分配现金红利 0.00 元，现金红利发放日为 2023 年 12 月 11 日。



#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。之后，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情形，持续期间为 2023 年 7 月 24 日至 2023 年 9 月 27 日。截至报告期末，本基金基金资产净值已达到五千万元以上。

### § 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	信会师报字[2024]第 ZB30133 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	我们审计了东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称东方量化成长基金）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表

	<p>附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方量化成长基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师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，我们独立于东方量化成长基金，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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>东方量化成长基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司（以下简称基金管理人）对其他信息负责。其他信息包括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，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人负责按照企业会计准则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，基金管理人负责评估东方量化成长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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、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</p>

	<p>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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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，就可能对导致对东方量化成长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东方量化成长基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	李永江 高慧丽
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层
审计报告日期	2024 年 3 月 21 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	4,171,394.15	262,089.31
结算备付金		5,132,890.33	18,906.05
存出保证金		123,607.75	1,050.06
交易性金融资产	7.4.7.2	400,982,549.19	16,013,761.17
其中：股票投资		378,907,887.82	15,107,590.62
基金投资		-	-
债券投资		22,074,661.37	906,170.55
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		831,792.63	617.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		413,796,038.13	16,296,424.08
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<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		-	-
应付清算款		2,835,591.82	-
应付赎回款		1,261,664.05	26,939.94
应付管理人报酬		438,896.39	17,036.85
应付托管费		73,149.42	3,549.35
应付销售服务费		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	1,001,028.44	35,512.92
负债合计		5,614,204.89	83,039.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	351,763,880.42	11,927,537.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	56,417,952.82	4,285,847.03
净资产合计		408,181,833.24	16,213,385.02
负债和净资产总计		413,796,038.13	16,296,424.08

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，东方量化成长灵活配置混合 A 基金份额净值 1.1506 元，基金份额总额 343,192,547.80 份；东方量化成长灵活配置混合 C 基金份额净值 1.5517 元，基金份额总额 8,571,332.62 份。东方量化成长灵活配置混合份额总额合计为 351,763,880.42 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		20,284,182.23	-3,121,691.20
1. 利息收入		30,645.93	2,260.84
其中：存款利息收入	7.4.7.10	30,645.93	2,260.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,239,281.32	-1,958,175.11
其中：股票投资收益	7.4.7.11	18,967,769.61	-2,549,770.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	84,141.79	25,713.99
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	187,369.92	565,881.09
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	521,588.47	-1,167,997.92
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	492,666.51	2,220.99
<b>减：二、营业总支出</b>		1,378,298.63	333,719.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,124,019.16	228,738.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	192,977.62	47,653.97
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,896.35	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		105.50	72.06

其中：卖出回购金融资产支出		105.50	72.06
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	57,300.00	57,255.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,905,883.60	-3,455,411.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,905,883.60	-3,455,411.04
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		18,905,883.60	-3,455,411.04

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	-62,432,048.36	-	-27,964,632.35	-90,396,680.71

回款				
(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
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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	13,998,860.66	-	8,629,868.02	22,628,728.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	13,998,860.66	-	8,629,868.02	22,628,728.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,071,322.67	-	-4,344,020.99	-6,415,343.66
(一)、综合收益总额	-	-	-3,455,411.04	-3,455,411.04
(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)	-2,071,322.67	-	-888,609.95	-2,959,932.62
其中：1. 基金申购款	607,332.57	-	287,251.63	894,584.20
2. 基金赎回款	-2,678,655.24	-	-1,175,861.58	-3,854,516.82
(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	11,927,537.99	-	4,285,847.03	16,213,385.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>王丹丹</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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



法律文件的公告》。

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

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划

分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## 2、金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1、利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2、投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产

支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

### 3、公允价值变动损益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 4、信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

## 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2%的年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提并确认。

(3) 基金销售服务费按前一日东方量化成长 C 类基金资产净值的 0.50%年费率计提并确认。

(4) 卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

(5) 交易费用

进行股票、债券、同业存单及权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

(6) 其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

## 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

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

#### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《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《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]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,171,394.15	262,089.31
等于：本金	4,170,229.16	262,042.49
加：应计利息	1,164.99	46.82
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	4,171,394.15	262,089.31

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	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	21,837,332.28	204,391.37	22,074,661.37	32,937.72
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,837,332.28	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	
项目	上年度末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	15,427,286.18	-	15,107,590.62	-319,695.56	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	901,566.00	7,880.55	906,170.55	-3,276.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	901,566.00	7,880.55	906,170.55	-3,276.00



资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,328,852.18	7,880.55	16,013,761.17	-322,971.56

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	530.19	0.03
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	971,498.25	6,512.89
其中：交易所市场	971,498.25	6,512.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	29,000.00	29,000.00
合计	1,001,028.44	35,512.92

注：预提费用为按日计提的审计费和账户维护费。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	----------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,927,537.99	11,927,537.99
本期申购	391,716,391.68	391,716,391.68
本期赎回（以“-”号填列）	-60,451,381.87	-60,451,381.87
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	343,192,547.80	343,192,547.80

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	本期 2023 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	10,551,999.11	10,551,999.11
本期赎回（以“-”号填列）	-1,980,666.49	-1,980,666.49
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	8,571,332.62	8,571,332.62

注：本期申购包含基金转换入、红利再投资份额；本期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	8,902,034.29	-4,616,187.26	4,285,847.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,902,034.29	-4,616,187.26	4,285,847.03
本期利润	18,486,216.01	434,809.85	18,921,025.86
本期基金份额交易产生的变动数	277,430,857.47	-116,936,776.05	160,494,081.42
其中：基金申购款	326,370,512.24	-138,946,915.31	187,423,596.93
基金赎回款	-48,939,654.77	22,010,139.26	-26,929,515.51
本期已分配利润	-132,011,767.89	-	-132,011,767.89
本期末	172,807,339.88	-121,118,153.46	51,689,186.42

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-101,920.88	86,778.62	-15,142.26
本期基金份额交易产生的变动数	7,752,296.04	-3,008,387.38	4,743,908.66
其中：基金申购款	9,541,542.24	-3,762,516.74	5,779,025.50
基金赎回款	-1,789,246.20	754,129.36	-1,035,116.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,650,375.16	-2,921,608.76	4,728,766.40

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	20,740.79	1,906.36
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	9,632.62	336.59
其他	272.52	17.89
合计	30,645.93	2,260.84

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,967,769.61	-2,549,770.19
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	18,967,769.61	-2,549,770.19

##### 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,099,293,285.69	18,150,425.85
减：卖出股票成本总额	1,078,439,112.27	20,647,229.45
减：交易费用	1,886,403.81	52,966.59
买卖股票差价收入	18,967,769.61	-2,549,770.19

#### 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	91,886.51	24,062.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,744.72	1,651.80
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	84,141.79	25,713.99

##### 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,565,470.47	1,427,046.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,481,783.72	1,398,614.00
减：应计利息总额	91,431.47	26,780.82
减：交易费用	-	0.20
买卖债券差价收入	-7,744.72	1,651.80

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	187,369.92	565,881.09
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	187,369.92	565,881.09

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	521,588.47	-1,167,997.92
股票投资	485,374.75	-1,162,641.92
债券投资	36,213.72	-5,356.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	521,588.47	-1,167,997.92

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	488,646.27	1,936.08
基金转换费收入	4,020.24	284.91
合计	492,666.51	2,220.99

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	100.00	55.00
合计	57,300.00	57,255.00

#### 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	5,491,781.00	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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	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 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
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)
-	-	-	-	-

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该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,124,019.16	228,738.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	166,228.42	112,173.65
应支付基金管理人的净管理费	957,790.74	116,565.16

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%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

##### 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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	192,977.62	47,653.97



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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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、公休日等，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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
合计	-	-	-

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。由基金管

理人于次月前 5 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	4,171,394.15	20,740.79	262,089.31	1,906.36

#### 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.11 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

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 12 月 8 日	-	2023 年 12 月 8 日	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-
合计	-	-	-	3.9400	124,369,164.86	7,642,603.03	132,011,767.89	-

#### 7.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	46.28	87	3,567.00	4,026.36	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	31.90	44.48	208	6,635.20	9,251.84	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	16.82	32.25	383	6,442.06	12,351.75	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.87	20.07	604	4,149.48	12,122.28	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	43.26	246	5,714.58	10,641.96	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.80	34.50	195	3,276.00	6,727.50	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.10	40.47	88	1,680.80	3,561.36	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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。

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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

所谓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可随时要求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。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
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	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>31,502,553.60</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-382,293,484.53</b>	<b>413,796,038.13</b>
<b>负债</b>					
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
上年度末 2022 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	262,089.31	-	-	-	262,089.31
结算备付金	18,906.05	-	-	-	18,906.05
存出保证金	1,050.06	-	-	-	1,050.06
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	15,107,590.62	15,107,590.62
交易性金融资产-债券投资	906,170.55	-	-	-	906,170.55
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	-	-	-	617.49	617.49
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,188,215.97	-	-	15,108,208.11	16,296,424.08
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	26,939.94	26,939.94
应付管理人报酬	-	-	-	17,036.85	17,036.85
应付托管费	-	-	-	3,549.35	3,549.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	35,512.92	35,512.92
负债总计	-	-	-	83,039.06	83,039.06
利率敏感度缺口	1,188,215.97	-	-	15,025,169.05	16,213,385.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上调0.25%	-26,637.66	-1,214.72
市场利率下调0.25%	26,637.66	1,214.72	

#### 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 2023年12月31日		上年度末 2022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	378,907,887.82	92.83	15,107,590.62	93.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	22,074,661.37	5.41	906,170.55	5.59
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	400,982,549.19	98.24	16,013,761.17	98.77

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到,对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票,默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%,其他市场变量均不发生变化,计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023年12月31日)	上年度末(2022年12月31日)
	沪深 300 指数上涨 5%	13,476,940.84	569,766.77
	沪深 300 指数下跌 5%	-13,476,940.84	-569,766.77

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	378,849,204.77	15,107,590.62
第二层次	22,074,661.37	906,170.55
第三层次	58,683.05	-
合计	400,982,549.19	16,013,761.17

###### 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 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实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	27,217.93	27,217.93
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损	-	-	-

失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

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
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
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
-	-	-	-	-	-

#### 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	378,907,887.82	91.57
	其中：股票	378,907,887.82	91.57
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	22,074,661.37	5.33
	其中：债券	22,074,661.37	5.33
	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	9,304,284.48	2.25
8	其他各项资产	3,509,204.46	0.85
9	合计	413,796,038.13	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	2,069,474.00	0.51
B	采矿业	2,185,676.00	0.54
C	制造业	263,570,523.80	64.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,270,411.00	0.31
E	建筑业	29,830,261.91	7.31
F	批发和零售业	6,351,691.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	6,116,127.00	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,101,803.51	3.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,042,740.00	1.48
L	租赁和商务服务业	3,561.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	19,255,327.75	4.72
N	水利、环境和公共设施管理业	24,374,387.49	5.97
O	居民服务、修理和其他服务业	2,188,778.00	0.54
P	教育	2,547,125.00	0.62
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	378,907,887.82	92.83

### 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	300665	飞鹿股份	790,000	6,825,600.00	1.67
2	301198	喜悦智行	524,146	6,363,132.44	1.56
3	301167	建研设计	371,300	6,282,396.00	1.54
4	301098	金埔园林	506,580	5,982,709.80	1.47
5	300931	通用电梯	653,400	5,514,696.00	1.35
6	300816	艾可蓝	208,300	5,138,761.00	1.26
7	300907	康平科技	218,900	4,857,391.00	1.19
8	301055	张小泉	329,100	4,745,622.00	1.16
9	300649	杭州园林	272,600	4,566,050.00	1.12
10	000929	兰州黄河	463,700	4,544,260.00	1.11
11	300746	汉嘉设计	423,000	4,251,150.00	1.04
12	300929	华骐环保	328,300	3,995,411.00	0.98
13	688171	纬德信息	177,348	3,990,330.00	0.98
14	300865	大宏立	173,500	3,895,075.00	0.95
15	688655	迅捷兴	256,778	3,877,347.80	0.95
16	300329	海伦钢琴	518,600	3,863,570.00	0.95
17	688379	华光新材	194,831	3,851,808.87	0.94
18	603813	原尚股份	238,500	3,851,775.00	0.94
19	688092	爱科科技	124,603	3,832,788.28	0.94
20	301037	保立佳	191,900	3,824,567.00	0.94
21	300509	新美星	526,600	3,807,318.00	0.93
22	002193	如意集团	574,700	3,804,514.00	0.93
23	300836	佰奥智能	133,800	3,802,596.00	0.93
24	688096	京源环保	404,702	3,792,057.74	0.93
25	301010	晶雪节能	202,800	3,790,332.00	0.93
26	688013	天臣医疗	179,274	3,782,681.40	0.93
27	002633	申科股份	323,500	3,781,715.00	0.93
28	300854	中兰环保	216,300	3,774,435.00	0.92
29	603955	大千生态	256,600	3,769,454.00	0.92
30	002144	宏达高科	323,700	3,761,394.00	0.92
31	603879	永悦科技	566,000	3,616,740.00	0.89
32	603320	迪贝电气	225,600	3,589,296.00	0.88
33	300845	捷安高科	196,100	3,543,527.00	0.87
34	300658	延江股份	518,720	3,511,734.40	0.86
35	603900	莱绅通灵	525,300	3,509,004.00	0.86
36	300877	金春股份	202,300	3,501,813.00	0.86
37	000573	粤宏远 A	1,031,800	3,487,484.00	0.85
38	603041	美思德	257,500	3,465,950.00	0.85
39	688528	秦川物联	308,642	3,410,494.10	0.84
40	002789	建艺集团	247,800	3,409,728.00	0.84

41	300640	德艺文创	526,000	3,376,920.00	0.83
42	300535	达威股份	191,800	3,358,418.00	0.82
43	300163	先锋新材	863,900	3,317,376.00	0.81
44	300823	建科机械	152,600	3,282,426.00	0.80
45	300321	同大股份	165,500	3,202,425.00	0.78
46	301027	华蓝集团	255,500	3,196,305.00	0.78
47	300717	华信新材	179,800	3,018,842.00	0.74
48	688616	西力科技	220,871	3,012,680.44	0.74
49	300948	冠中生态	209,000	3,011,690.00	0.74
50	002620	瑞和股份	553,700	2,978,906.00	0.73
51	603021	山东华鹏	447,300	2,947,707.00	0.72
52	300635	中达安	234,100	2,944,978.00	0.72
53	688021	奥福环保	138,695	2,891,790.75	0.71
54	300594	朗进科技	138,200	2,885,616.00	0.71
55	603159	上海亚虹	175,600	2,879,840.00	0.71
56	688335	复洁环保	223,993	2,873,830.19	0.70
57	000702	正虹科技	444,200	2,785,134.00	0.68
58	300478	杭州高新	218,500	2,761,840.00	0.68
59	605303	园林股份	223,710	2,729,262.00	0.67
60	300749	顶固集创	294,100	2,726,307.00	0.67
61	600235	民丰特纸	443,900	2,725,546.00	0.67
62	301182	凯旺科技	113,976	2,664,758.88	0.65
63	301040	中环海陆	134,400	2,549,568.00	0.62
64	600455	博通股份	102,500	2,547,125.00	0.62
65	300243	瑞丰高材	255,500	2,496,235.00	0.61
66	603506	南都物业	228,000	2,478,360.00	0.61
67	301043	绿岛风	73,800	2,415,474.00	0.59
68	300838	浙江力诺	146,200	2,391,832.00	0.59
69	688367	工大高科	132,877	2,370,525.68	0.58
70	300971	博亚精工	94,300	2,348,070.00	0.58
71	605003	众望布艺	118,500	2,339,190.00	0.57
72	688565	力源科技	266,374	2,250,860.30	0.55
73	000590	启迪药业	250,100	2,240,896.00	0.55
74	002778	中晟高科	147,100	2,209,442.00	0.54
75	300935	盈建科	80,100	2,195,541.00	0.54
76	603272	联翔股份	129,900	2,192,712.00	0.54
77	603810	丰山集团	163,900	2,191,343.00	0.54
78	300736	百邦科技	171,400	2,188,778.00	0.54
79	301081	严牌股份	192,300	2,134,530.00	0.52
80	002910	庄园牧场	190,700	2,086,258.00	0.51
81	300970	华绿生物	119,900	2,069,474.00	0.51
82	301288	清研环境	108,600	2,061,228.00	0.50
83	603022	新通联	189,600	1,952,880.00	0.48

84	300521	爱司凯	140,300	1,943,155.00	0.48
85	603316	诚邦股份	286,900	1,933,706.00	0.47
86	688178	万德斯	105,125	1,900,660.00	0.47
87	300013	新宁物流	497,300	1,879,794.00	0.46
88	002836	新宏泽	211,400	1,849,750.00	0.45
89	003001	中岩大地	102,273	1,848,073.11	0.45
90	301359	东南电子	69,200	1,841,412.00	0.45
91	600847	万里股份	153,600	1,830,912.00	0.45
92	300886	华业香料	73,500	1,820,595.00	0.45
93	300385	雪浪环境	262,000	1,760,640.00	0.43
94	301125	腾亚精工	92,900	1,757,668.00	0.43
95	300992	泰福泵业	80,400	1,735,032.00	0.43
96	688607	康众医疗	82,565	1,682,674.70	0.41
97	300899	上海凯鑫	61,900	1,682,442.00	0.41
98	301036	双乐股份	73,900	1,638,363.00	0.40
99	301079	邵阳液压	94,700	1,638,310.00	0.40
100	600493	凤竹纺织	237,600	1,596,672.00	0.39
101	001211	双枪科技	65,800	1,589,728.00	0.39
102	300906	日月明	61,900	1,565,451.00	0.38
103	300955	嘉亨家化	69,800	1,543,278.00	0.38
104	688395	正弦电气	61,973	1,424,759.27	0.35
105	688350	富淼科技	85,280	1,409,678.40	0.35
106	301336	趣睡科技	31,900	1,396,901.00	0.34
107	002830	名雕股份	93,300	1,389,237.00	0.34
108	301006	迈拓股份	76,451	1,384,527.61	0.34
109	300716	泉为科技	117,300	1,357,161.00	0.33
110	002809	红墙股份	124,500	1,354,560.00	0.33
111	300897	山科智能	38,900	1,330,380.00	0.33
112	301300	远翔新材	41,600	1,315,808.00	0.32
113	605069	正和生态	125,500	1,232,410.00	0.30
114	002826	易明医药	101,000	1,198,870.00	0.29
115	605298	必得科技	75,100	1,170,809.00	0.29
116	002828	贝肯能源	111,000	1,157,730.00	0.28
117	603356	华菱精工	77,700	1,136,751.00	0.28
118	301237	和顺科技	36,600	1,115,202.00	0.27
119	301163	宏德股份	39,200	1,062,320.00	0.26
120	600051	宁波联合	144,500	1,043,290.00	0.26
121	002629	仁智股份	260,900	1,027,946.00	0.25
122	003008	开普检测	36,700	1,024,297.00	0.25
123	300371	汇中股份	80,200	977,638.00	0.24
124	600448	华纺股份	291,100	960,630.00	0.24
125	002247	聚力文化	401,900	940,446.00	0.23
126	300670	大烨智能	118,500	927,855.00	0.23



127	605258	协和电子	33,400	927,518.00	0.23
128	688004	博汇科技	31,434	923,216.58	0.23
129	600137	浪莎股份	49,200	896,424.00	0.22
130	300995	奇德新材	40,800	867,816.00	0.21
131	600969	郴电国际	131,100	852,150.00	0.21
132	002842	翔鹭钨业	94,200	821,424.00	0.20
133	000679	大连友谊	146,000	805,920.00	0.20
134	002857	三晖电气	47,000	775,500.00	0.19
135	002652	扬子新材	234,400	747,736.00	0.18
136	603655	朗博科技	35,400	737,028.00	0.18
137	603139	康惠制药	38,600	724,522.00	0.18
138	002205	国统股份	65,100	705,033.00	0.17
139	603822	嘉澳环保	24,600	684,126.00	0.17
140	300103	达刚控股	100,800	640,080.00	0.16
141	300281	金明精机	106,600	638,534.00	0.16
142	688129	东来技术	38,273	633,418.15	0.16
143	603637	镇海股份	70,300	632,700.00	0.16
144	688251	井松智能	21,557	626,877.56	0.15
145	000622	恒立实业	142,000	621,960.00	0.15
146	600082	海泰发展	175,300	604,785.00	0.15
147	301057	汇隆新材	35,600	598,080.00	0.15
148	600883	博闻科技	69,600	591,600.00	0.14
149	300611	美力科技	49,000	563,010.00	0.14
150	688215	瑞晟智能	15,380	552,911.00	0.14
151	688455	科捷智能	42,665	542,272.15	0.13
152	688329	艾隆科技	21,532	535,285.52	0.13
153	300234	开尔新材	101,500	528,815.00	0.13
154	300920	润阳科技	24,500	515,725.00	0.13
155	002231	奥维通信	73,500	479,955.00	0.12
156	003003	天元股份	41,100	472,239.00	0.12
157	301003	江苏博云	18,800	469,248.00	0.11
158	300564	筑博设计	34,500	464,370.00	0.11
159	688193	仁度生物	10,281	463,878.72	0.11
160	300333	兆日科技	62,300	459,774.00	0.11
161	688659	元琛科技	36,770	457,786.50	0.11
162	603828	柯利达	114,800	438,536.00	0.11
163	301156	美农生物	22,700	428,122.00	0.10
164	688681	科汇股份	27,611	426,589.95	0.10
165	605255	天普股份	24,200	424,710.00	0.10
166	605180	华生科技	30,200	422,800.00	0.10
167	600356	恒丰纸业	52,000	414,960.00	0.10
168	688227	品高股份	20,413	389,275.91	0.10
169	688393	安必平	15,455	385,911.35	0.09

170	600561	江西长运	59,900	384,558.00	0.09
171	002105	信隆健康	58,200	377,136.00	0.09
172	000586	汇源通信	28,900	363,562.00	0.09
173	001210	金房能源	17,700	349,575.00	0.09
174	301209	联合化学	13,700	341,952.00	0.08
175	600697	欧亚集团	26,800	341,164.00	0.08
176	603268	松发股份	19,600	338,688.00	0.08
177	300810	中科海讯	16,100	328,440.00	0.08
178	688217	睿昂基因	8,858	316,939.24	0.08
179	688067	爱威科技	13,198	314,244.38	0.08
180	603086	先达股份	53,300	313,404.00	0.08
181	002114	罗平锌电	41,100	307,428.00	0.08
182	603580	艾艾精工	20,000	297,800.00	0.07
183	688501	青达环保	17,233	288,308.09	0.07
184	300069	金利华电	15,400	247,940.00	0.06
185	688069	德林海	12,078	240,110.64	0.06
186	301024	霍普股份	7,600	230,280.00	0.06
187	300675	建科院	14,100	213,615.00	0.05
188	301049	超越科技	9,000	208,440.00	0.05
189	300961	深水海纳	18,400	206,632.00	0.05
190	300132	青松股份	38,900	203,058.00	0.05
191	603798	康普顿	19,700	190,499.00	0.05
192	301273	瑞晨环保	6,700	184,853.00	0.05
193	301233	盛帮股份	4,158	184,698.36	0.05
194	603860	中公高科	5,900	183,195.00	0.04
195	600889	南京化纤	29,500	169,920.00	0.04
196	300901	中胤时尚	16,100	164,864.00	0.04
197	600156	华升股份	31,800	156,456.00	0.04
198	301298	东利机械	9,000	153,000.00	0.04
199	002963	豪尔赛	9,800	151,900.00	0.04
200	301228	实朴检测	9,100	150,878.00	0.04
201	688038	中科通达	10,207	147,082.87	0.04
202	002295	精艺股份	16,400	133,988.00	0.03
203	000695	滨海能源	12,100	130,801.00	0.03
204	688296	和达科技	6,995	125,700.15	0.03
205	301077	星华新材	6,100	124,013.00	0.03
206	002883	中设股份	9,400	115,432.00	0.03
207	688163	赛伦生物	5,766	115,262.34	0.03
208	301065	本立科技	5,000	113,750.00	0.03
209	002899	英派斯	6,800	112,540.00	0.03
210	688090	瑞松科技	2,844	92,117.16	0.02
211	300923	研奥股份	3,700	90,724.00	0.02
212	688081	兴图新科	5,233	90,059.93	0.02

213	000608	阳光股份	26,700	76,896.00	0.02
214	301059	金三江	5,900	71,508.00	0.02
215	600149	廊坊发展	12,200	68,686.00	0.02
216	688701	卓锦股份	7,231	65,440.55	0.02
217	600243	青海华鼎	13,500	64,395.00	0.02
218	300743	天地数码	4,600	63,848.00	0.02
219	300927	江天化学	3,500	58,975.00	0.01
220	301075	多瑞医药	2,000	53,340.00	0.01
221	000638	万方发展	7,600	51,072.00	0.01
222	000632	三木集团	10,400	47,528.00	0.01
223	003023	彩虹集团	2,200	44,572.00	0.01
224	603045	福达合金	2,700	42,633.00	0.01
225	300417	南华仪器	3,100	38,905.00	0.01
226	301234	五洲医疗	1,100	37,268.00	0.01
227	300689	澄天伟业	1,900	36,803.00	0.01
228	603838	四通股份	4,900	35,280.00	0.01
229	688669	聚石化学	1,699	31,839.26	0.01
230	002365	永安药业	3,100	30,318.00	0.01
231	688011	新光光电	1,151	27,221.15	0.01
232	300912	凯龙高科	1,500	27,015.00	0.01
233	300876	蒙泰高新	1,000	25,020.00	0.01
234	603183	建研院	3,900	18,213.00	0.00
235	301508	中机认检	383	12,351.75	0.00
236	301516	中远通	604	12,122.28	0.00
237	301568	思泰克	246	10,641.96	0.00
238	301459	丰茂股份	208	9,251.84	0.00
239	300295	三六五网	600	7,398.00	0.00
240	603004	鼎龙科技	195	6,727.50	0.00
241	301056	森赫股份	400	4,088.00	0.00
242	001358	兴欣新材	87	4,026.36	0.00
243	603373	安邦护卫	88	3,561.36	0.00
244	300807	天迈科技	100	3,148.00	0.00
245	603017	中衡设计	300	3,003.00	0.00
246	688597	煜邦电力	1	9.10	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300329	海伦钢琴	10,971,063.00	67.67
2	688655	迅捷兴	9,564,405.29	58.99
3	300665	飞鹿股份	9,135,034.20	56.34
4	301098	金埔园林	8,036,750.50	49.57

5	300907	康平科技	7,583,434.00	46.77
6	002778	中晟高科	7,563,670.60	46.65
7	301198	喜悦智行	7,439,061.95	45.88
8	300865	大宏立	7,430,339.00	45.83
9	301037	保立佳	7,308,966.00	45.08
10	301055	张小泉	7,181,821.00	44.30
11	605303	园林股份	7,150,546.50	44.10
12	000929	兰州黄河	7,094,027.00	43.75
13	688013	天臣医疗	7,083,939.47	43.69
14	300961	深水海纳	6,997,289.00	43.16
15	300640	德艺文创	6,962,278.00	42.94
16	300509	新美星	6,941,072.00	42.81
17	603810	丰山集团	6,825,864.00	42.10
18	688092	爱科科技	6,683,458.94	41.22
19	300321	同大股份	6,629,751.00	40.89
20	300243	瑞丰高材	6,583,891.80	40.61
21	603272	联翔股份	6,566,684.00	40.50
22	300845	捷安高科	6,445,747.00	39.76
23	600235	民丰特纸	6,363,710.00	39.25
24	300931	通用电梯	6,336,744.00	39.08
25	688096	京源环保	6,312,658.78	38.93
26	301167	建研设计	6,264,017.80	38.63
27	002836	新宏泽	6,216,498.80	38.34
28	300816	艾可蓝	6,126,007.00	37.78
29	002633	申科股份	6,119,564.00	37.74
30	603021	山东华鹏	6,116,056.68	37.72
31	300478	杭州高新	6,101,112.00	37.63
32	301040	中环海陆	5,963,196.84	36.78
33	300717	华信新材	5,894,448.00	36.36
34	002890	弘宇股份	5,819,113.78	35.89
35	600802	福建水泥	5,792,056.00	35.72
36	605298	必得科技	5,788,751.80	35.70
37	603900	莱绅通灵	5,741,925.01	35.41
38	688565	力源科技	5,714,605.87	35.25
39	300929	华骐环保	5,705,195.20	35.19
40	300749	顶固集创	5,678,017.18	35.02
41	300535	达威股份	5,663,852.00	34.93
42	300649	杭州园林	5,625,696.16	34.70
43	603041	美思德	5,620,794.00	34.67
44	603813	原尚股份	5,561,730.00	34.30
45	603320	迪贝电气	5,542,757.10	34.19
46	300658	延江股份	5,520,702.02	34.05
47	600493	凤竹纺织	5,500,000.00	33.92

48	600156	华升股份	5,459,494.00	33.67
49	603879	永悦科技	5,352,701.48	33.01
50	300405	科隆股份	5,308,105.50	32.74
51	600455	博通股份	5,245,731.00	32.35
52	603329	上海雅仕	5,234,690.00	32.29
53	603717	天域生态	5,221,843.80	32.21
54	002058	威尔泰	5,180,851.00	31.95
55	002620	瑞和股份	5,175,285.00	31.92
56	603022	新通联	5,084,589.00	31.36
57	000573	粤宏远 A	5,083,177.00	31.35
58	300838	浙江力诺	5,054,308.00	31.17
59	600847	万里股份	5,027,595.00	31.01
60	002193	如意集团	4,947,638.00	30.52
61	300635	中达安	4,905,836.00	30.26
62	300743	天地数码	4,864,289.98	30.00
63	605180	华生科技	4,791,962.10	29.56
64	600281	华阳新材	4,780,499.73	29.48
65	603226	菲林格尔	4,739,048.00	29.23
66	301107	瑜欣电子	4,656,687.50	28.72
67	300163	先锋新材	4,635,846.00	28.59
68	300013	新宁物流	4,611,903.00	28.45
69	688367	工大高科	4,611,626.49	28.44
70	002295	精艺股份	4,570,654.00	28.19
71	300943	春晖智控	4,563,402.00	28.15
72	688171	纬德信息	4,533,443.38	27.96
73	300594	朗进科技	4,520,136.00	27.88
74	688021	奥福环保	4,508,523.03	27.81
75	300836	佰奥智能	4,499,178.00	27.75
76	603637	镇海股份	4,482,209.00	27.65
77	002144	宏达高科	4,469,861.00	27.57
78	688178	万德斯	4,453,948.85	27.47
79	301006	迈拓股份	4,453,214.03	27.47
80	301010	晶雪节能	4,423,850.00	27.29
81	688528	秦川物联	4,385,770.12	27.05
82	002809	红墙股份	4,382,077.00	27.03
83	603696	安记食品	4,374,722.00	26.98
84	300746	汉嘉设计	4,338,046.00	26.76
85	003001	中岩大地	4,320,231.74	26.65
86	688616	西力科技	4,317,728.18	26.63
87	300732	设研院	4,316,703.80	26.62
88	600232	金鹰股份	4,306,427.00	26.56
89	300927	江天化学	4,290,896.00	26.47
90	688379	华光新材	4,261,459.78	26.28

91	603577	汇金通	4,255,207.60	26.25
92	603955	大千生态	4,252,453.00	26.23
93	301079	邵阳液压	4,242,615.70	26.17
94	002856	美芝股份	4,223,479.23	26.05
95	688350	富淼科技	4,215,625.19	26.00
96	300970	华绿生物	4,199,294.00	25.90
97	300854	中兰环保	4,199,035.04	25.90
98	603389	亚振家居	4,191,136.00	25.85
99	688067	爱威科技	4,178,002.83	25.77
100	301161	唯万密封	4,154,531.00	25.62
101	600444	国机通用	4,117,063.00	25.39
102	688004	博汇科技	4,111,967.27	25.36
103	002789	建艺集团	4,077,628.10	25.15
104	600538	国发股份	4,077,206.00	25.15
105	300716	泉为科技	4,067,827.00	25.09
106	688251	井松智能	4,066,947.81	25.08
107	000856	冀东装备	4,052,501.00	24.99
108	301182	凯旺科技	4,031,386.96	24.86
109	002921	联诚精密	4,029,031.13	24.85
110	300877	金春股份	4,026,441.00	24.83
111	300823	建科机械	3,995,786.00	24.64
112	600051	宁波联合	3,963,274.00	24.44
113	300923	研奥股份	3,927,716.00	24.23
114	300736	百邦科技	3,922,189.00	24.19
115	300076	GQY 视讯	3,896,566.00	24.03
116	002910	庄园牧场	3,868,723.00	23.86
117	688681	科汇股份	3,855,179.69	23.78
118	603159	上海亚虹	3,850,882.00	23.75
119	300849	锦盛新材	3,801,412.00	23.45
120	002780	三夫户外	3,794,368.00	23.40
121	603580	艾艾精工	3,759,657.00	23.19
122	688296	和达科技	3,754,870.90	23.16
123	300753	爱朋医疗	3,751,063.00	23.14
124	300935	盈建科	3,749,549.00	23.13
125	002825	纳尔股份	3,715,881.70	22.92
126	688038	中科通达	3,699,991.06	22.82
127	603289	泰瑞机器	3,698,559.00	22.81
128	688517	金冠电气	3,660,912.94	22.58
129	002199	东晶电子	3,641,118.00	22.46
130	300407	凯发电气	3,639,851.50	22.45
131	300948	冠中生态	3,631,492.00	22.40
132	300906	日月明	3,591,737.00	22.15
133	603316	诚邦股份	3,587,809.00	22.13

134	300956	英力股份	3,587,232.00	22.13
135	002098	浔兴股份	3,572,409.00	22.03
136	000668	荣丰控股	3,549,664.00	21.89
137	301081	严牌股份	3,521,135.80	21.72
138	603017	中衡设计	3,520,694.00	21.71
139	688395	正弦电气	3,520,540.12	21.71
140	300886	华业香料	3,504,008.00	21.61
141	000590	启迪药业	3,498,101.00	21.58
142	300992	泰福泵业	3,495,946.00	21.56
143	688227	品高股份	3,441,774.58	21.23
144	002231	奥维通信	3,427,690.00	21.14
145	600149	廊坊发展	3,415,457.00	21.07
146	600128	苏豪弘业	3,411,487.00	21.04
147	301027	华蓝集团	3,400,910.00	20.98
148	002209	达意隆	3,389,912.00	20.91
149	002848	高斯贝尔	3,363,824.94	20.75
150	603506	南都物业	3,348,765.00	20.65
151	000619	海螺新材	3,340,855.00	20.61
152	300417	南华仪器	3,320,774.00	20.48
153	301043	绿岛风	3,312,817.00	20.43
154	002652	扬子新材	3,286,463.00	20.27
155	300385	雪浪环境	3,209,786.77	19.80
156	002871	伟隆股份	3,201,655.66	19.75
157	600083	博信股份	3,196,365.00	19.71
158	300069	金利华电	3,188,568.00	19.67
159	002842	翔鹭钨业	3,173,148.68	19.57
160	300521	爱司凯	3,157,907.00	19.48
161	600082	海泰发展	3,138,583.00	19.36
162	000605	渤海股份	3,127,700.00	19.29
163	300515	三德科技	3,094,677.00	19.09
164	301197	工大科雅	3,091,859.00	19.07
165	002629	仁智股份	3,086,769.00	19.04
166	301300	远翔新材	3,042,099.00	18.76
167	300449	汉邦高科	3,037,193.00	18.73
168	603183	建研院	3,035,998.40	18.73
169	603789	星光农机	3,034,324.00	18.71
170	688597	煜邦电力	3,033,215.39	18.71
171	603838	四通股份	3,012,740.00	18.58
172	002830	名雕股份	3,011,244.00	18.57
173	688335	复洁环保	3,007,834.65	18.55
174	688669	聚石化学	3,002,586.86	18.52
175	688329	艾隆科技	3,001,406.84	18.51
176	688189	南新制药	2,991,305.64	18.45

177	000679	大连友谊	2,980,477.00	18.38
178	603079	圣达生物	2,944,526.00	18.16
179	688659	元琛科技	2,917,183.72	17.99
180	688607	康众医疗	2,910,397.05	17.95
181	001210	金房能源	2,908,507.80	17.94
182	002879	长缆科技	2,902,419.00	17.90
183	605255	天普股份	2,891,050.00	17.83
184	300686	智动力	2,886,993.00	17.81
185	002114	罗平锌电	2,870,798.00	17.71
186	300810	中科海讯	2,850,702.00	17.58
187	603161	科华控股	2,848,311.00	17.57
188	300920	润阳科技	2,846,976.00	17.56
189	688081	兴图新科	2,845,668.30	17.55
190	002862	实丰文化	2,845,034.00	17.55
191	000702	正虹科技	2,842,085.00	17.53
192	002887	绿茵生态	2,808,237.00	17.32
193	603090	宏盛股份	2,803,019.00	17.29
194	301163	宏德股份	2,779,980.43	17.15
195	300971	博亚精工	2,760,366.00	17.03
196	605069	正和生态	2,759,782.00	17.02
197	000632	三木集团	2,751,505.00	16.97
198	002105	信隆健康	2,748,700.00	16.95
199	300281	金明精机	2,741,978.00	16.91
200	600302	标准股份	2,722,884.00	16.79
201	300610	晨化股份	2,721,695.00	16.79
202	688163	赛伦生物	2,719,994.72	16.78
203	300689	澄天伟业	2,712,517.00	16.73
204	301057	汇隆新材	2,688,094.00	16.58
205	600969	郴电国际	2,685,840.40	16.57
206	600371	万向德农	2,626,066.98	16.20
207	000622	恒立实业	2,598,199.00	16.03
208	605003	众望布艺	2,598,120.00	16.02
209	300955	嘉亨家化	2,530,775.00	15.61
210	002826	易明医药	2,524,088.00	15.57
211	605081	太和水	2,502,024.35	15.43
212	600356	恒丰纸业	2,495,555.00	15.39
213	603536	惠发食品	2,490,547.00	15.36
214	002598	山东章鼓	2,489,388.00	15.35
215	605258	协和电子	2,483,964.00	15.32
216	600137	浪莎股份	2,473,968.00	15.26
217	688215	瑞晟智能	2,469,431.34	15.23
218	000419	通程控股	2,464,819.00	15.20
219	002817	黄山胶囊	2,463,631.00	15.20



220	603356	华菱精工	2,453,961.00	15.14
221	600234	科新发展	2,440,668.00	15.05
222	603776	永安行	2,436,216.58	15.03
223	600883	博闻科技	2,413,590.00	14.89
224	600448	华纺股份	2,398,637.00	14.79
225	300234	开尔新材	2,396,079.00	14.78
226	301156	美农生物	2,385,501.80	14.71
227	600889	南京化纤	2,383,367.91	14.70
228	001231	农心科技	2,380,459.00	14.68
229	301002	崧盛股份	2,375,953.00	14.65
230	002247	聚力文化	2,368,165.00	14.61
231	603655	朗博科技	2,340,211.00	14.43
232	300599	雄塑科技	2,325,913.00	14.35
233	300103	达刚控股	2,311,728.00	14.26
234	002883	中设股份	2,306,972.88	14.23
235	300720	海川智能	2,288,043.00	14.11
236	600506	统一股份	2,284,793.00	14.09
237	603608	天创时尚	2,259,602.00	13.94
238	688360	德马科技	2,252,401.08	13.89
239	600714	金瑞矿业	2,229,682.00	13.75
240	301288	清研环境	2,214,866.00	13.66
241	301336	趣睡科技	2,211,369.00	13.64
242	300387	富邦股份	2,211,075.00	13.64
243	600791	京能置业	2,210,761.00	13.64
244	605155	西大门	2,208,861.80	13.62
245	301032	新柴股份	2,197,015.00	13.55
246	603332	苏州龙杰	2,191,644.40	13.52
247	003017	大洋生物	2,183,857.00	13.47
248	300644	南京聚隆	2,158,156.00	13.31
249	300819	聚杰微纤	2,132,320.00	13.15
250	301273	瑞晨环保	2,120,858.00	13.08
251	603333	尚纬股份	2,109,516.00	13.01
252	300022	吉峰科技	2,100,228.00	12.95
253	300462	华铭智能	2,098,845.00	12.95
254	603903	中持股份	2,090,670.00	12.89
255	688393	安必平	2,086,734.61	12.87
256	300464	星徽股份	2,064,055.00	12.73
257	603188	亚邦股份	2,058,528.00	12.70
258	300703	创源股份	2,048,521.00	12.63
259	603657	春光科技	2,048,485.00	12.63
260	603988	中电电机	1,999,005.00	12.33
261	300899	上海凯鑫	1,998,210.00	12.32
262	301359	东南电子	1,978,021.00	12.20

263	301059	金三江	1,976,437.40	12.19
264	603040	新坐标	1,963,898.00	12.11
265	003003	天元股份	1,943,762.00	11.99
266	688455	科捷智能	1,931,236.24	11.91
267	603331	百达精工	1,929,306.00	11.90
268	002205	国统股份	1,926,636.00	11.88
269	002696	百洋股份	1,926,241.00	11.88
270	300692	中环环保	1,905,956.00	11.76
271	002718	友邦吊顶	1,903,631.00	11.74
272	002591	恒大高新	1,896,485.00	11.70
273	300889	爱克股份	1,871,179.00	11.54
274	002732	燕塘乳业	1,868,436.00	11.52
275	300333	兆日科技	1,841,455.00	11.36
276	603139	康惠制药	1,836,927.00	11.33
277	300995	奇德新材	1,824,981.29	11.26
278	688685	迈信林	1,821,453.69	11.23
279	603045	福达合金	1,817,865.00	11.21
280	301125	腾亚精工	1,805,534.00	11.14
281	600561	江西长运	1,797,304.00	11.09
282	603500	祥和实业	1,782,137.00	10.99
283	688129	东来技术	1,777,678.84	10.96
284	605055	迎丰股份	1,775,928.00	10.95
285	600470	六国化工	1,767,600.00	10.90
286	003041	真爱美家	1,760,177.04	10.86
287	000952	广济药业	1,757,492.00	10.84
288	002972	科安达	1,744,934.80	10.76
289	001211	双枪科技	1,728,543.00	10.66
290	300950	德固特	1,715,210.00	10.58
291	300106	西部牧业	1,684,797.00	10.39
292	002734	利民股份	1,682,116.00	10.37
293	300670	大烨智能	1,681,042.00	10.37
294	002494	华斯股份	1,676,809.00	10.34
295	300562	乐心医疗	1,661,134.00	10.25
296	301003	江苏博云	1,652,562.00	10.19
297	605189	富春染织	1,651,687.40	10.19
298	300484	蓝海华腾	1,640,480.00	10.12
299	003008	开普检测	1,626,629.00	10.03
300	603086	先达股份	1,625,926.00	10.03
301	688701	卓锦股份	1,614,624.14	9.96
302	600243	青海华鼎	1,613,607.00	9.95
303	300984	金沃股份	1,611,424.00	9.94
304	603221	爱丽家居	1,594,781.00	9.84
305	301036	双乐股份	1,589,144.00	9.80

306	301237	和顺科技	1,585,919.00	9.78
307	603286	日盈电子	1,575,594.00	9.72
308	301309	万得凯	1,558,973.00	9.62
309	000638	万方发展	1,556,190.00	9.60
310	300626	华瑞股份	1,550,140.00	9.56
311	600854	春兰股份	1,548,332.00	9.55
312	603214	爱婴室	1,521,699.00	9.39
313	600148	长春一东	1,511,497.00	9.32
314	002748	世龙实业	1,507,232.00	9.30
315	603828	柯利达	1,506,445.00	9.29
316	603029	天鹅股份	1,505,979.00	9.29
317	002893	京能热力	1,505,649.00	9.29
318	603937	丽岛新材	1,498,748.00	9.24
319	603839	安正时尚	1,493,671.00	9.21
320	600858	银座股份	1,492,882.00	9.21
321	002691	冀凯股份	1,471,295.00	9.07
322	605318	法狮龙	1,468,719.00	9.06
323	300824	北鼎股份	1,457,134.00	8.99
324	603656	泰禾智能	1,453,509.00	8.96
325	301049	超越科技	1,449,695.00	8.94
326	301118	恒光股份	1,447,902.00	8.93
327	603963	大理药业	1,441,310.00	8.89
328	000985	大庆华科	1,434,060.00	8.84
329	300611	美力科技	1,433,709.00	8.84
330	603499	翔港科技	1,427,460.44	8.80
331	688193	仁度生物	1,419,893.57	8.76
332	300897	山科智能	1,419,868.00	8.76
333	301126	达嘉维康	1,409,922.00	8.70
334	603458	勘设股份	1,408,912.50	8.69
335	002820	桂发祥	1,405,517.00	8.67
336	300501	海顺新材	1,405,104.00	8.67
337	301130	西点药业	1,394,380.00	8.60
338	300030	阳普医疗	1,384,473.00	8.54
339	002927	泰永长征	1,373,173.00	8.47
340	002207	准油股份	1,358,150.00	8.38
341	003025	思进智能	1,330,884.59	8.21
342	301209	联合化学	1,328,969.56	8.20
343	603716	塞力医疗	1,326,620.00	8.18
344	605259	绿田机械	1,323,571.00	8.16
345	600712	南宁百货	1,323,326.00	8.16
346	002828	贝肯能源	1,317,049.00	8.12
347	300963	中洲特材	1,307,970.00	8.07
348	603336	宏辉果蔬	1,307,636.00	8.07

349	600692	亚通股份	1,304,533.99	8.05
350	603578	三星新材	1,294,150.00	7.98
351	603176	汇通集团	1,265,908.00	7.81
352	300883	龙利得	1,248,591.00	7.70
353	603700	宁水集团	1,244,435.00	7.68
354	300647	超频三	1,241,096.00	7.65
355	301226	祥明智能	1,229,119.00	7.58
356	301022	海泰科	1,224,817.00	7.55
357	300701	森霸传感	1,222,860.00	7.54
358	002731	萃华珠宝	1,213,201.00	7.48
359	605001	威奥股份	1,201,214.00	7.41
360	002066	瑞泰科技	1,197,229.00	7.38
361	300960	通业科技	1,192,518.00	7.36
362	600379	宝光股份	1,189,316.00	7.34
363	002899	英派斯	1,187,489.00	7.32
364	300991	创益通	1,178,564.00	7.27
365	002571	德力股份	1,173,554.00	7.24
366	002661	克明食品	1,172,383.00	7.23
367	605336	帅丰电器	1,169,613.20	7.21
368	603066	音飞储存	1,167,219.00	7.20
369	002365	永安药业	1,159,511.00	7.15
370	688328	深科达	1,153,455.09	7.11
371	001218	丽臣实业	1,148,230.00	7.08
372	001202	炬申股份	1,147,725.58	7.08
373	688109	品茗科技	1,125,131.39	6.94
374	300004	南风股份	1,124,224.00	6.93
375	603825	华扬联众	1,123,248.00	6.93
376	002012	凯恩股份	1,121,837.00	6.92
377	300546	雄帝科技	1,116,786.80	6.89
378	301024	霍普股份	1,115,097.00	6.88
379	605169	洪通燃气	1,111,192.00	6.85
380	300246	宝莱特	1,109,793.00	6.84
381	002134	天津普林	1,108,811.00	6.84
382	603216	梦天家居	1,107,049.00	6.83
383	300242	佳云科技	1,101,089.00	6.79
384	603958	哈森股份	1,097,908.00	6.77
385	002574	明牌珠宝	1,095,992.00	6.76
386	603321	梅轮电梯	1,090,763.00	6.73
387	600697	欧亚集团	1,088,544.00	6.71
388	301326	捷邦科技	1,085,235.00	6.69
389	002513	蓝丰生化	1,075,955.00	6.64
390	002802	洪汇新材	1,075,791.40	6.64
391	688679	通源环境	1,075,786.49	6.64

392	002861	瀛通通讯	1,070,098.20	6.60
393	600359	新农开发	1,066,473.00	6.58
394	300543	朗科智能	1,060,572.00	6.54
395	300018	中元股份	1,059,366.00	6.53
396	300958	建工修复	1,057,481.00	6.52
397	603059	倍加洁	1,041,041.00	6.42
398	003004	声迅股份	1,032,055.00	6.37
399	300756	金马游乐	1,028,380.00	6.34
400	002857	三晖电气	1,023,614.00	6.31
401	301056	森赫股份	1,018,923.00	6.28
402	002442	龙星化工	1,018,921.00	6.28
403	300564	筑博设计	1,011,363.00	6.24
404	000608	阳光股份	1,007,164.00	6.21
405	002798	帝欧家居	996,557.00	6.15
406	300371	汇中股份	989,894.00	6.11
407	603089	正裕工业	988,128.00	6.09
408	000890	法尔胜	986,867.00	6.09
409	300334	津膜科技	986,191.00	6.08
410	002403	爱仕达	982,305.00	6.06
411	603829	洛凯股份	977,488.00	6.03
412	300597	吉大通信	974,684.00	6.01
413	605033	美邦股份	973,401.90	6.00
414	300871	回盛生物	965,537.00	5.96
415	301176	逸豪新材	963,438.00	5.94
416	600980	北矿科技	949,256.00	5.85
417	600573	惠泉啤酒	947,214.00	5.84
418	002084	海鸥住工	940,296.00	5.80
419	301053	远信工业	931,615.00	5.75
420	002989	中天精装	930,418.00	5.74
421	300419	浩丰科技	926,604.00	5.72
422	300675	建科院	918,616.00	5.67
423	300132	青松股份	908,537.00	5.60
424	001230	劲旅环境	908,244.00	5.60
425	603860	中公高科	907,788.00	5.60
426	688255	凯尔达	904,969.52	5.58
427	605378	野马电池	879,084.00	5.42
428	301396	宏景科技	878,153.00	5.42
429	002136	安纳达	873,427.00	5.39
430	300605	恒锋信息	868,775.00	5.36
431	688090	瑞松科技	863,815.94	5.33
432	300305	裕兴股份	863,469.00	5.33
433	300141	和顺电气	860,474.00	5.31
434	301192	泰祥股份	859,768.00	5.30

435	600615	丰华股份	857,671.00	5.29
436	601007	金陵饭店	852,902.00	5.26
437	300262	巴安水务	847,222.00	5.23
438	603729	龙韵股份	845,350.00	5.21
439	600119	长江投资	843,152.00	5.20
440	300808	久量股份	841,278.00	5.19
441	688619	罗普特	832,078.46	5.13
442	000430	张家界	830,126.00	5.12
443	300391	长药控股	825,664.00	5.09
444	603016	新宏泰	825,413.00	5.09
445	301222	浙江恒威	824,674.00	5.09
446	002963	豪尔赛	820,990.00	5.06
447	001259	利仁科技	819,771.00	5.06
448	300652	雷迪克	812,551.00	5.01
449	002898	赛隆药业	810,006.00	5.00
450	002492	恒基达鑫	808,771.00	4.99
451	603909	建发合诚	801,187.00	4.94
452	301011	华立科技	797,991.00	4.92
453	688217	睿昂基因	794,718.15	4.90
454	300283	温州宏丰	793,435.00	4.89
455	300399	天利科技	789,673.00	4.87
456	002112	三变科技	786,505.00	4.85
457	300922	天秦装备	785,523.00	4.84
458	605028	世茂能源	768,409.00	4.74
459	300150	世纪瑞尔	754,994.00	4.66
460	603755	日辰股份	750,802.00	4.63
461	300998	宁波方正	749,185.00	4.62
462	688501	青达环保	744,207.29	4.59
463	603822	嘉澳环保	725,782.00	4.48
464	002296	辉煌科技	720,490.00	4.44
465	688026	洁特生物	715,708.06	4.41
466	603280	南方路机	710,758.00	4.38
467	301148	嘉戎技术	702,013.00	4.33
468	301276	嘉曼服饰	700,441.00	4.32
469	300710	万隆光电	700,054.00	4.32
470	301388	欣灵电气	697,920.00	4.30
471	603268	松发股份	697,725.00	4.30
472	002811	郑中设计	691,033.00	4.26
473	688069	德林海	690,089.10	4.26
474	603096	新经典	678,405.00	4.18
475	688175	高凌信息	676,586.68	4.17
476	300162	雷曼光电	674,844.00	4.16
477	600865	百大集团	674,729.00	4.16

478	301279	金道科技	662,756.00	4.09
479	301361	众智科技	660,794.00	4.08
480	003027	同兴环保	660,721.00	4.08
481	688571	杭华股份	660,714.84	4.08
482	603311	金海高科	655,524.00	4.04
483	301008	宏昌科技	651,316.00	4.02
484	600774	汉商集团	650,445.00	4.01
485	301135	瑞德智能	647,411.00	3.99
486	300422	博世科	640,795.00	3.95
487	603199	九华旅游	640,406.00	3.95
488	603488	展鹏科技	638,187.00	3.94
489	002357	富临运业	635,803.00	3.92
490	301082	久盛电气	634,459.00	3.91
491	002998	优彩资源	632,855.00	3.90
492	688011	新光光电	628,816.88	3.88
493	300350	华鹏飞	627,871.00	3.87
494	300637	扬帆新材	626,505.00	3.86
495	603335	迪生力	617,901.00	3.81
496	300254	仟源医药	616,500.00	3.80
497	003018	金富科技	615,136.00	3.79
498	002753	永东股份	607,449.00	3.75
499	300218	安利股份	605,043.00	3.73
500	002687	乔治白	601,429.00	3.71
501	688115	思林杰	601,143.59	3.71
502	002529	海源复材	599,542.00	3.70
503	002767	先锋电子	594,706.00	3.67
504	603721	中广天择	590,681.00	3.64
505	300641	正丹股份	585,420.00	3.61
506	000757	浩物股份	581,486.00	3.59
507	601609	金田股份	579,641.00	3.58
508	300107	建新股份	574,663.00	3.54
509	003023	彩虹集团	569,607.00	3.51
510	002316	亚联发展	563,823.00	3.48
511	001336	楚环科技	563,709.00	3.48
512	600593	大连圣亚	558,336.00	3.44
513	300839	博汇股份	555,036.00	3.42
514	000609	中迪投资	552,894.00	3.41
515	300901	中胤时尚	552,756.98	3.41
516	300643	万通智控	552,311.00	3.41
517	600305	恒顺醋业	550,178.00	3.39
518	600272	开开实业	545,794.00	3.37
519	605151	西上海	545,605.00	3.37
520	603797	联泰环保	538,576.00	3.32

521	688718	唯赛勃	535,377.98	3.30
522	605166	聚合顺	525,497.00	3.24
523	300517	海波重科	525,329.00	3.24
524	601798	蓝科高新	524,521.00	3.24
525	002394	联发股份	523,498.00	3.23
526	002238	天威视讯	520,610.00	3.21
527	605567	春雪食品	520,177.00	3.21
528	600661	昂立教育	514,264.00	3.17
529	001222	源飞宠物	513,468.00	3.17
530	605008	长鸿高科	511,576.00	3.16
531	001255	博菲电气	510,753.00	3.15
532	300885	海昌新材	510,551.00	3.15
533	000017	深中华 A	506,038.00	3.12
534	300980	祥源新材	505,470.00	3.12
535	605178	时空科技	505,207.00	3.12
536	000565	渝三峡 A	500,628.00	3.09
537	603518	锦泓集团	499,558.00	3.08
538	300615	欣天科技	494,912.00	3.05
539	301009	可靠股份	490,922.00	3.03
540	001268	联合精密	485,342.00	2.99
541	603726	朗迪集团	482,620.00	2.98
542	300932	三友联众	480,563.00	2.96
543	300621	维业股份	480,182.00	2.96
544	688229	博睿数据	476,898.22	2.94
545	002888	惠威科技	471,572.00	2.91
546	300694	蠡湖股份	470,201.00	2.90
547	002760	凤形股份	467,948.00	2.89
548	688466	金科环境	465,267.84	2.87
549	301065	本立科技	463,206.00	2.86
550	603978	深圳新星	462,439.00	2.85
551	300096	ST 易联众	460,000.00	2.84
552	002806	华锋股份	456,643.00	2.82
553	000159	国际实业	455,814.00	2.81
554	300771	智莱科技	450,551.00	2.78
555	603238	诺邦股份	443,059.00	2.73
556	603895	天永智能	442,533.00	2.73
557	000586	汇源通信	441,959.00	2.73
558	301313	凡拓数创	431,441.00	2.66
559	603201	常润股份	429,668.00	2.65
560	002999	天禾股份	429,610.00	2.65
561	603038	华立股份	426,709.00	2.63
562	002457	青龙管业	426,338.00	2.63
563	002636	金安国纪	423,709.00	2.61



564	300306	远方信息	423,186.00	2.61
565	301016	雷尔伟	422,542.00	2.61
566	000156	华数传媒	422,231.00	2.60
567	300486	东杰智能	419,753.00	2.59
568	300195	长荣股份	419,173.00	2.59
569	605100	华丰股份	417,939.00	2.58
570	003002	壶化股份	416,552.00	2.57
571	300789	唐源电气	414,200.00	2.55
572	600168	武汉控股	413,792.00	2.55
573	002165	红宝丽	413,328.00	2.55
574	300074	华平股份	412,781.00	2.55
575	000705	浙江震元	408,281.00	2.52
576	301259	艾布鲁	406,910.00	2.51
577	300425	中建环能	406,096.00	2.50
578	688613	奥精医疗	404,744.95	2.50
579	600500	中化国际	403,757.00	2.49
580	002397	梦洁股份	397,690.00	2.45
581	300264	佳创视讯	396,428.00	2.45
582	301113	雅艺科技	395,683.00	2.44
583	300295	三六五网	390,764.00	2.41
584	000678	襄阳轴承	388,514.00	2.40
585	603150	万朗磁塑	384,371.00	2.37
586	603677	奇精机械	384,279.00	2.37
587	002360	同德化工	384,111.00	2.37
588	000407	胜利股份	381,913.00	2.36
589	603182	嘉华股份	379,942.01	2.34
590	688057	金达莱	379,766.66	2.34
591	603836	海程邦达	379,280.00	2.34
592	301108	洁雅股份	373,499.00	2.30
593	002172	澳洋健康	371,528.00	2.29
594	301379	天山电子	369,979.00	2.28
595	301331	恩威医药	368,626.00	2.27
596	301160	翔楼新材	367,067.00	2.26
597	688218	江苏北人	366,948.72	2.26
598	603102	百合股份	366,925.00	2.26
599	301119	正强股份	366,558.00	2.26
600	300374	中铁装配	365,509.00	2.25
601	301121	紫建电子	364,390.00	2.25
602	300556	丝路视觉	363,150.00	2.24
603	002164	宁波东力	362,630.00	2.24
604	000421	南京公用	360,596.00	2.22
605	605507	国邦医药	360,394.00	2.22
606	603385	惠达卫浴	359,831.50	2.22

607	300165	天瑞仪器	357,582.00	2.21
608	002381	双箭股份	356,832.00	2.20
609	300335	迪森股份	355,940.00	2.20
610	300519	新光药业	353,141.00	2.18
611	688089	嘉必优	352,640.71	2.17
612	600192	长城电工	352,216.00	2.17
613	301075	多瑞医药	352,203.00	2.17
614	605488	福莱新材	351,190.00	2.17
615	688779	长远锂科	350,961.75	2.16
616	300410	正业科技	348,533.00	2.15
617	600962	国投中鲁	347,849.00	2.15
618	000663	永安林业	340,690.00	2.10
619	601616	广电电气	336,646.00	2.08
620	600097	开创国际	335,997.00	2.07
621	300966	共同药业	334,583.00	2.06
622	002347	泰尔股份	334,243.00	2.06
623	688203	海正生材	332,491.77	2.05
624	688511	天微电子	330,239.41	2.04
625	300876	蒙泰高新	329,447.00	2.03
626	300879	大叶股份	325,989.00	2.01

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

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300329	海伦钢琴	7,369,647.00	45.45
2	300961	深水海纳	6,903,095.00	42.58
3	688655	迅捷兴	5,822,605.60	35.91
4	600802	福建水泥	5,804,911.60	35.80
5	002890	弘宇股份	5,761,901.40	35.54
6	002058	威尔泰	5,641,674.00	34.80
7	600156	华升股份	5,608,563.25	34.59
8	002778	中晟高科	5,567,018.00	34.34
9	300405	科隆股份	5,466,434.10	33.72
10	603717	天域生态	5,283,583.00	32.59
11	603329	上海雅仕	5,280,028.00	32.57
12	600281	华阳新材	5,087,977.00	31.38
13	603226	菲林格尔	4,962,651.00	30.61
14	300743	天地数码	4,866,140.72	30.01
15	603810	丰山集团	4,679,311.00	28.86
16	002856	美芝股份	4,607,662.34	28.42

17	605303	园林股份	4,541,316.00	28.01
18	603696	安记食品	4,524,207.91	27.90
19	002836	新宏泽	4,522,274.00	27.89
20	002295	精艺股份	4,479,142.00	27.63
21	605298	必得科技	4,474,471.50	27.60
22	301107	瑜欣电子	4,473,491.00	27.59
23	300943	春晖智控	4,471,742.00	27.58
24	600232	金鹰股份	4,459,247.00	27.50
25	605180	华生科技	4,457,937.81	27.50
26	300927	江天化学	4,443,397.80	27.41
27	603389	亚振家居	4,406,739.80	27.18
28	603272	联翔股份	4,324,007.00	26.67
29	300732	设研院	4,250,900.40	26.22
30	000856	冀东装备	4,225,525.00	26.06
31	603577	汇金通	4,218,614.70	26.02
32	600444	国机通用	4,174,080.00	25.74
33	002921	联诚精密	4,134,552.81	25.50
34	600538	国发股份	4,125,721.00	25.45
35	300243	瑞丰高材	4,087,770.00	25.21
36	688296	和达科技	4,082,745.93	25.18
37	300076	GQY 视讯	4,019,391.00	24.79
38	002780	三夫户外	4,018,335.00	24.78
39	002199	东晶电子	4,004,265.00	24.70
40	603637	镇海股份	4,004,014.47	24.70
41	600493	凤竹纺织	3,967,085.00	24.47
42	301161	唯万密封	3,920,529.88	24.18
43	688067	爱威科技	3,898,102.99	24.04
44	002825	纳尔股份	3,864,466.40	23.84
45	300923	研奥股份	3,864,188.00	23.83
46	600235	民丰特纸	3,833,939.00	23.65
47	300849	锦盛新材	3,825,177.00	23.59
48	603289	泰瑞机器	3,812,777.00	23.52
49	688517	金冠电气	3,804,940.77	23.47
50	002848	高斯贝尔	3,798,924.30	23.43
51	300640	德艺文创	3,758,963.00	23.18
52	300753	爱朋医疗	3,744,586.00	23.10
53	688038	中科通达	3,702,209.47	22.83
54	002098	浔兴股份	3,679,447.81	22.69
55	000668	荣丰控股	3,670,891.00	22.64
56	300407	凯发电气	3,657,673.73	22.56
57	603021	山东华鹏	3,630,443.00	22.39
58	600149	廊坊发展	3,626,452.00	22.37
59	688565	力源科技	3,606,815.82	22.25

60	002209	达意隆	3,592,418.00	22.16
61	300865	大宏立	3,582,405.00	22.10
62	603789	星光农机	3,581,459.40	22.09
63	603580	艾艾精工	3,553,170.00	21.92
64	688251	井松智能	3,546,624.87	21.87
65	300321	同大股份	3,540,816.00	21.84
66	300956	英力股份	3,530,204.00	21.77
67	300478	杭州高新	3,525,545.00	21.74
68	301040	中环海陆	3,499,570.00	21.58
69	600128	苏豪弘业	3,492,517.00	21.54
70	603017	中衡设计	3,492,023.00	21.54
71	688681	科汇股份	3,480,271.84	21.47
72	000619	海螺新材	3,456,154.00	21.32
73	300417	南华仪器	3,387,238.45	20.89
74	600847	万里股份	3,379,317.00	20.84
75	603022	新通联	3,367,991.00	20.77
76	301037	保立佳	3,357,400.00	20.71
77	600455	博通股份	3,346,617.00	20.64
78	300509	新美星	3,315,253.00	20.45
79	600083	博信股份	3,294,096.00	20.32
80	688013	天臣医疗	3,265,384.17	20.14
81	300449	汉邦高科	3,233,432.00	19.94
82	688189	南新制药	3,223,503.03	19.88
83	688004	博汇科技	3,193,836.18	19.70
84	002871	伟隆股份	3,186,235.80	19.65
85	000605	渤海股份	3,155,082.00	19.46
86	688092	爱科科技	3,124,688.54	19.27
87	300749	顶固集创	3,118,321.00	19.23
88	688597	煜邦电力	3,080,495.19	19.00
89	300515	三德科技	3,075,048.00	18.97
90	688669	聚石化学	3,074,633.33	18.96
91	603536	惠发食品	3,070,515.60	18.94
92	300069	金利华电	3,038,443.00	18.74
93	301006	迈拓股份	3,037,329.00	18.73
94	301197	工大科雅	3,035,912.00	18.72
95	002809	红墙股份	3,027,407.00	18.67
96	603183	建研院	3,021,153.00	18.63
97	300717	华信新材	2,995,118.00	18.47
98	603079	圣达生物	2,974,304.60	18.34
99	603838	四通股份	2,966,936.00	18.30
100	603090	宏盛股份	2,960,191.00	18.26
101	600051	宁波联合	2,918,424.00	18.00
102	002862	实丰文化	2,889,190.00	17.82

103	002879	长缆科技	2,887,438.00	17.81
104	600302	标准股份	2,884,219.00	17.79
105	300716	泉为科技	2,882,499.00	17.78
106	688081	兴图新科	2,868,931.42	17.69
107	603161	科华控股	2,827,384.00	17.44
108	300907	康平科技	2,818,123.48	17.38
109	688350	富淼科技	2,815,116.24	17.36
110	000632	三木集团	2,805,258.00	17.30
111	300686	智动力	2,774,583.00	17.11
112	300845	捷安高科	2,768,552.00	17.08
113	002887	绿茵生态	2,739,525.00	16.90
114	300013	新宁物流	2,731,705.00	16.85
115	002231	奥维通信	2,719,527.00	16.77
116	688227	品高股份	2,713,297.88	16.73
117	600506	统一股份	2,697,931.00	16.64
118	001210	金房能源	2,696,592.80	16.63
119	300838	浙江力诺	2,693,376.00	16.61
120	600371	万向德农	2,673,254.40	16.49
121	600082	海泰发展	2,672,702.90	16.48
122	300610	晨化股份	2,664,416.00	16.43
123	002114	罗平锌电	2,651,972.00	16.36
124	300689	澄天伟业	2,650,520.00	16.35
125	301079	邵阳液压	2,649,832.00	16.34
126	688178	万德斯	2,636,571.22	16.26
127	002652	扬子新材	2,632,534.40	16.24
128	688163	赛伦生物	2,632,415.05	16.24
129	688659	元琛科技	2,622,183.70	16.17
130	002633	申科股份	2,616,702.00	16.14
131	600234	科新发展	2,605,489.00	16.07
132	002598	山东章鼓	2,590,039.00	15.97
133	003001	中岩大地	2,566,667.41	15.83
134	000419	通程控股	2,536,358.00	15.64
135	605081	太和水	2,522,551.65	15.56
136	603776	永安行	2,519,682.24	15.54
137	603332	苏州龙杰	2,515,314.40	15.51
138	688329	艾隆科技	2,505,964.19	15.46
139	002817	黄山胶囊	2,487,018.00	15.34
140	605255	天普股份	2,480,642.00	15.30
141	300810	中科海讯	2,438,353.00	15.04
142	300462	华铭智能	2,430,077.00	14.99
143	300535	达威股份	2,421,774.00	14.94
144	688367	工大高科	2,390,414.98	14.74
145	002105	信隆健康	2,386,796.00	14.72

146	600889	南京化纤	2,384,751.00	14.71
147	000929	兰州黄河	2,384,277.00	14.71
148	603608	天创时尚	2,380,250.47	14.68
149	001231	农心科技	2,374,088.00	14.64
150	600791	京能置业	2,349,887.00	14.49
151	300920	润阳科技	2,348,735.00	14.49
152	300644	南京聚隆	2,342,608.00	14.45
153	603900	莱绅通灵	2,336,688.00	14.41
154	301002	崧盛股份	2,333,662.00	14.39
155	002883	中设股份	2,319,642.60	14.31
156	002842	翔鹭钨业	2,319,569.00	14.31
157	002620	瑞和股份	2,317,136.00	14.29
158	603041	美思德	2,307,061.00	14.23
159	688096	京源环保	2,305,666.08	14.22
160	300720	海川智能	2,302,019.00	14.20
161	603320	迪贝电气	2,283,606.00	14.08
162	300387	富邦股份	2,280,924.00	14.07
163	000679	大连友谊	2,271,550.00	14.01
164	300599	雄塑科技	2,261,087.00	13.95
165	600714	金瑞矿业	2,258,166.00	13.93
166	003017	大洋生物	2,228,768.80	13.75
167	301055	张小泉	2,223,940.00	13.72
168	688395	正弦电气	2,203,269.51	13.59
169	688360	德马科技	2,193,575.45	13.53
170	301098	金埔园林	2,186,997.00	13.49
171	301032	新柴股份	2,176,377.00	13.42
172	300819	聚杰微纤	2,157,812.00	13.31
173	300665	飞鹿股份	2,157,012.00	13.30
174	603903	中持股份	2,156,834.00	13.30
175	605155	西大门	2,150,990.00	13.27
176	300022	吉峰科技	2,138,344.00	13.19
177	600356	恒丰纸业	2,135,762.00	13.17
178	300281	金明精机	2,128,052.00	13.13
179	300703	创源股份	2,115,681.00	13.05
180	301057	汇隆新材	2,097,701.54	12.94
181	603188	亚邦股份	2,081,077.00	12.84
182	002629	仁智股份	2,079,399.00	12.83
183	603040	新坐标	2,062,713.00	12.72
184	300464	星徽股份	2,051,427.00	12.65
185	603657	春光科技	2,045,430.00	12.62
186	603333	尚纬股份	2,041,936.00	12.59
187	603988	中电电机	2,040,591.00	12.59
188	002696	百洋股份	2,038,198.00	12.57

189	002591	恒大高新	2,033,595.00	12.54
190	002748	世龙实业	2,022,685.00	12.48
191	688215	瑞晟智能	2,018,574.52	12.45
192	300635	中达安	1,988,402.00	12.26
193	301156	美农生物	1,984,937.80	12.24
194	301059	金三江	1,975,684.90	12.19
195	000622	恒立实业	1,966,917.00	12.13
196	300970	华绿生物	1,963,215.00	12.11
197	600883	博闻科技	1,949,329.00	12.02
198	300906	日月明	1,943,890.00	11.99
199	301273	瑞晨环保	1,940,241.00	11.97
200	300658	延江股份	1,924,710.00	11.87
201	002718	友邦吊顶	1,908,484.00	11.77
202	688685	迈信林	1,859,000.10	11.47
203	603331	百达精工	1,830,153.00	11.29
204	300889	爱克股份	1,825,491.00	11.26
205	002494	华斯股份	1,823,718.00	11.25
206	002910	庄园牧场	1,809,048.00	11.16
207	300992	泰福泵业	1,795,545.00	11.07
208	300929	华骐环保	1,795,396.00	11.07
209	600969	郴电国际	1,794,483.00	11.07
210	300692	中环环保	1,791,893.00	11.05
211	002732	燕塘乳业	1,778,474.00	10.97
212	300886	华业香料	1,776,968.00	10.96
213	600470	六国化工	1,774,295.00	10.94
214	300594	朗进科技	1,761,167.00	10.86
215	603045	福达合金	1,759,704.00	10.85
216	605055	迎丰股份	1,752,952.00	10.81
217	300106	西部牧业	1,749,122.00	10.79
218	000952	广济药业	1,748,581.00	10.78
219	300484	蓝海华腾	1,748,329.00	10.78
220	603500	祥和实业	1,747,116.00	10.78
221	603316	诚邦股份	1,743,366.00	10.75
222	300242	佳云科技	1,739,918.00	10.73
223	003041	真爱美家	1,737,298.00	10.72
224	301300	远翔新材	1,734,999.00	10.70
225	002972	科安达	1,733,648.00	10.69
226	300234	开尔新材	1,733,010.00	10.69
227	002830	名雕股份	1,728,049.00	10.66
228	300984	金沃股份	1,707,355.00	10.53
229	002927	泰永长征	1,706,087.84	10.52
230	300562	乐心医疗	1,687,578.00	10.41
231	002734	利民股份	1,684,528.00	10.39

232	688393	安必平	1,673,720.75	10.32
233	300736	百邦科技	1,671,703.00	10.31
234	603655	朗博科技	1,661,223.00	10.25
235	300950	德固特	1,661,207.00	10.25
236	300626	华瑞股份	1,655,871.00	10.21
237	300103	达刚控股	1,648,827.00	10.17
238	600148	长春一东	1,646,693.00	10.16
239	605189	富春染织	1,643,324.40	10.14
240	600243	青海华鼎	1,643,299.00	10.14
241	688021	奥福环保	1,642,430.50	10.13
242	301163	宏德股份	1,634,770.00	10.08
243	603286	日盈电子	1,634,572.00	10.08
244	603499	翔港科技	1,619,698.08	9.99
245	603963	大理药业	1,605,106.00	9.90
246	603813	原尚股份	1,600,922.00	9.87
247	603879	永悦科技	1,600,472.00	9.87
248	600137	浪莎股份	1,590,872.00	9.81
249	688701	卓锦股份	1,588,865.07	9.80
250	600854	春兰股份	1,588,360.00	9.80
251	002893	京能热力	1,585,831.00	9.78
252	603221	爱丽家居	1,577,705.00	9.73
253	002691	冀凯股份	1,563,136.00	9.64
254	605069	正和生态	1,551,795.00	9.57
255	000638	万方发展	1,551,674.00	9.57
256	300385	雪浪环境	1,545,155.00	9.53
257	603029	天鹅股份	1,537,967.90	9.49
258	002247	聚力文化	1,530,478.00	9.44
259	603839	安正时尚	1,530,134.60	9.44
260	605258	协和电子	1,524,568.00	9.40
261	301309	万得凯	1,518,080.36	9.36
262	600858	银座股份	1,516,008.00	9.35
263	003003	天元股份	1,515,792.00	9.35
264	600561	江西长运	1,514,458.00	9.34
265	000985	大庆华科	1,507,024.00	9.29
266	002820	桂发祥	1,505,138.00	9.28
267	603214	爱婴室	1,493,581.00	9.21
268	603656	泰禾智能	1,481,959.40	9.14
269	600448	华纺股份	1,472,312.00	9.08
270	000573	粤宏远 A	1,467,842.00	9.05
271	603336	宏辉果蔬	1,457,911.00	8.99
272	300163	先锋新材	1,429,749.00	8.82
273	603937	丽岛新材	1,425,299.00	8.79
274	002826	易明医药	1,422,635.00	8.77



275	300333	兆日科技	1,422,504.00	8.77
276	603356	华菱精工	1,413,998.00	8.72
277	301126	达嘉维康	1,396,708.00	8.61
278	688616	西力科技	1,396,511.79	8.61
279	300030	阳普医疗	1,395,256.00	8.61
280	300501	海顺新材	1,394,448.00	8.60
281	600692	亚通股份	1,390,320.00	8.58
282	688455	科捷智能	1,387,615.47	8.56
283	605318	法狮龙	1,386,101.00	8.55
284	600712	南宁百货	1,378,380.00	8.50
285	603716	塞力医疗	1,377,928.00	8.50
286	688607	康众医疗	1,371,425.79	8.46
287	603458	勘设股份	1,368,430.09	8.44
288	301081	严牌股份	1,366,711.00	8.43
289	002207	准油股份	1,341,789.60	8.28
290	301118	恒光股份	1,338,446.00	8.26
291	300824	北鼎股份	1,326,801.00	8.18
292	003025	思进智能	1,320,634.00	8.15
293	300935	盈建科	1,314,224.00	8.11
294	301130	西点药业	1,313,020.00	8.10
295	300963	中洲特材	1,301,702.00	8.03
296	000590	启迪药业	1,288,917.00	7.95
297	603578	三星新材	1,287,173.00	7.94
298	300521	爱司凯	1,285,917.00	7.93
299	300883	龙利得	1,266,040.00	7.81
300	688328	深科达	1,265,405.39	7.80
301	688109	品茗科技	1,262,940.10	7.79
302	603086	先达股份	1,261,449.00	7.78
303	605259	绿田机械	1,261,050.40	7.78
304	002205	国统股份	1,246,412.00	7.69
305	605001	威奥股份	1,241,823.00	7.66
306	688129	东来技术	1,237,281.54	7.63
307	301226	祥明智能	1,227,283.00	7.57
308	301182	凯旺科技	1,224,796.00	7.55
309	603176	汇通集团	1,208,461.00	7.45
310	300960	通业科技	1,206,445.00	7.44
311	301049	超越科技	1,205,012.00	7.43
312	300647	超频三	1,204,473.00	7.43
313	300991	创益通	1,203,682.00	7.42
314	603700	宁水集团	1,202,173.00	7.41
315	603066	音飞储存	1,197,485.00	7.39
316	002861	瀛通通讯	1,196,846.00	7.38
317	603825	华扬联众	1,195,938.00	7.38

318	600379	宝光股份	1,195,340.20	7.37
319	002066	瑞泰科技	1,194,366.00	7.37
320	002571	德力股份	1,194,199.00	7.37
321	002661	克明食品	1,191,782.00	7.35
322	300701	森霸传感	1,181,742.00	7.29
323	301003	江苏博云	1,180,710.00	7.28
324	002731	萃华珠宝	1,173,330.00	7.24
325	001202	炬申股份	1,172,724.00	7.23
326	301022	海泰科	1,171,626.00	7.23
327	002012	凯恩股份	1,129,379.00	6.97
328	605336	帅丰电器	1,124,559.00	6.94
329	688528	秦川物联	1,122,990.68	6.93
330	603139	康惠制药	1,122,730.00	6.92
331	605169	洪通燃气	1,117,790.00	6.89
332	301326	捷邦科技	1,116,063.00	6.88
333	603828	柯利达	1,110,312.00	6.85
334	002899	英派斯	1,106,339.00	6.82
335	001218	丽臣实业	1,105,695.00	6.82
336	300004	南风股份	1,105,446.00	6.82
337	002134	天津普林	1,104,350.00	6.81
338	603321	梅轮电梯	1,103,309.00	6.80
339	002802	洪汇新材	1,098,199.00	6.77
340	002365	永安药业	1,095,492.00	6.76
341	300546	雄帝科技	1,089,254.60	6.72
342	300246	宝莱特	1,089,076.00	6.72
343	688679	通源环境	1,076,716.42	6.64
344	002193	如意集团	1,076,489.00	6.64
345	300543	朗科智能	1,074,204.00	6.63
346	002574	明牌珠宝	1,071,497.00	6.61
347	603958	哈森股份	1,069,782.00	6.60
348	600359	新农开发	1,056,270.00	6.51
349	603216	梦天家居	1,054,786.00	6.51
350	000890	法尔胜	1,046,547.00	6.45
351	003004	声迅股份	1,036,042.00	6.39
352	002513	蓝丰生化	1,035,193.00	6.38
353	300018	中元股份	1,031,292.00	6.36
354	300958	建工修复	1,026,254.00	6.33
355	300597	吉大通信	1,012,788.00	6.25
356	603059	倍加洁	1,004,806.00	6.20
357	603089	正裕工业	1,003,998.00	6.19
358	603829	洛凯股份	1,003,342.00	6.19
359	002442	龙星化工	998,357.00	6.16
360	688193	仁度生物	996,529.26	6.15

361	603159	上海亚虹	996,166.60	6.14
362	002798	帝欧家居	989,582.00	6.10
363	300334	津膜科技	981,801.00	6.06
364	301056	森赫股份	980,747.00	6.05
365	301209	联合化学	976,848.00	6.02
366	002403	爱仕达	968,813.00	5.98
367	300756	金马游乐	967,021.00	5.96
368	002989	中天精装	966,503.00	5.96
369	000608	阳光股份	966,358.00	5.96
370	603729	龙韵股份	962,400.00	5.94
371	600980	北矿科技	956,307.00	5.90
372	300419	浩丰科技	954,913.00	5.89
373	600573	惠泉啤酒	953,993.00	5.88
374	301053	远信工业	953,731.00	5.88
375	002898	赛隆药业	938,383.00	5.79
376	605033	美邦股份	938,376.20	5.79
377	300871	回盛生物	937,484.00	5.78
378	300995	奇德新材	928,502.00	5.73
379	300605	恒锋信息	926,363.00	5.71
380	300611	美力科技	924,256.00	5.70
381	301043	绿岛风	924,105.00	5.70
382	688255	凯尔达	922,823.19	5.69
383	002084	海鸥住工	919,969.00	5.67
384	600615	丰华股份	917,868.00	5.66
385	301396	宏景科技	914,927.00	5.64
386	001230	劲旅环境	913,995.00	5.64
387	300931	通用电梯	912,411.00	5.63
388	605378	野马电池	905,669.00	5.59
389	301176	逸豪新材	901,171.00	5.56
390	300955	嘉亨家化	898,573.90	5.54
391	600119	长江投资	895,183.00	5.52
392	301024	霍普股份	893,888.00	5.51
393	300141	和顺电气	891,732.00	5.50
394	300391	长药控股	886,443.00	5.47
395	002136	安纳达	877,861.00	5.41
396	300399	天利科技	874,120.00	5.39
397	688090	瑞松科技	872,750.86	5.38
398	301192	泰祥股份	871,819.00	5.38
399	601007	金陵饭店	867,285.00	5.35
400	600697	欧亚集团	860,258.00	5.31
401	688619	罗普特	857,540.17	5.29
402	300836	佰奥智能	846,860.00	5.22
403	002492	恒基达鑫	842,104.00	5.19

404	301198	喜悦智行	838,424.00	5.17
405	301011	华立科技	832,894.00	5.14
406	300808	久量股份	831,756.00	5.13
407	300262	巴安水务	830,502.00	5.12
408	300283	温州宏丰	827,817.00	5.11
409	001259	利仁科技	826,889.00	5.10
410	300305	裕兴股份	826,130.00	5.10
411	002112	三变科技	825,900.00	5.09
412	603016	新宏泰	822,117.00	5.07
413	300649	杭州园林	816,590.00	5.04
414	301222	浙江恒威	816,263.00	5.03
415	301336	趣睡科技	815,560.00	5.03
416	000430	张家界	809,876.00	5.00
417	300652	雷迪克	805,876.00	4.97
418	300922	天秦装备	803,773.20	4.96
419	605028	世茂能源	802,141.00	4.95
420	002144	宏达高科	783,625.00	4.83
421	603909	建发合诚	773,921.96	4.77
422	300823	建科机械	765,247.00	4.72
423	300816	艾可蓝	761,721.00	4.70
424	300150	世纪瑞尔	759,215.00	4.68
425	300670	大烨智能	758,334.00	4.68
426	300162	雷曼光电	757,583.00	4.67
427	603860	中公高科	738,660.00	4.56
428	688115	思林杰	728,866.73	4.50
429	300675	建科院	728,191.00	4.49
430	300998	宁波方正	719,683.00	4.44
431	002296	辉煌科技	715,448.00	4.41
432	603096	新经典	714,220.00	4.41
433	300637	扬帆新材	713,962.00	4.40
434	300710	万隆光电	712,400.00	4.39
435	002811	郑中设计	702,167.00	4.33
436	301276	嘉曼服饰	701,195.00	4.32
437	603280	南方路机	696,243.00	4.29
438	603721	中广天择	690,428.00	4.26
439	688026	洁特生物	688,444.53	4.25
440	300132	青松股份	680,716.00	4.20
441	603506	南都物业	680,132.00	4.19
442	603755	日辰股份	677,860.00	4.18
443	301148	嘉戎技术	671,709.00	4.14
444	002963	豪尔赛	669,104.00	4.13
445	600865	百大集团	663,486.00	4.09
446	300254	仟源医药	661,528.00	4.08

447	003008	开普检测	658,377.00	4.06
448	301082	久盛电气	658,162.00	4.06
449	301279	金道科技	657,916.00	4.06
450	301008	宏昌科技	656,014.00	4.05
451	301388	欣灵电气	654,577.00	4.04
452	603311	金海高科	647,995.00	4.00
453	603488	展鹏科技	646,026.00	3.98
454	688571	杭华股份	645,008.94	3.98
455	600774	汉商集团	642,721.00	3.96
456	688175	高凌信息	642,432.85	3.96
457	002767	先锋电子	639,634.00	3.95
458	301135	瑞德智能	638,746.00	3.94
459	003027	同兴环保	638,673.00	3.94
460	002357	富临运业	635,140.00	3.92
461	603199	九华旅游	634,317.00	3.91
462	605151	西上海	632,238.00	3.90
463	300422	博世科	631,154.00	3.89
464	301361	众智科技	613,144.00	3.78
465	300350	华鹏飞	611,101.00	3.77
466	301010	晶雪节能	609,974.00	3.76
467	002998	优彩资源	608,456.00	3.75
468	002687	乔治白	604,239.00	3.73
469	300643	万通智控	603,929.00	3.72
470	000757	浩物股份	603,548.00	3.72
471	003018	金富科技	595,921.00	3.68
472	002753	永东股份	594,517.00	3.67
473	603335	迪生力	594,141.00	3.66
474	688011	新光光电	589,765.49	3.64
475	300218	安利股份	586,999.00	3.62
476	000609	中迪投资	583,122.00	3.60
477	002316	亚联发展	580,943.00	3.58
478	600593	大连圣亚	576,758.00	3.56
479	001336	楚环科技	572,282.00	3.53
480	300641	正丹股份	568,071.00	3.50
481	300564	筑博设计	561,155.00	3.46
482	300107	建新股份	560,813.00	3.46
483	002529	海源复材	557,850.00	3.44
484	601609	金田股份	557,267.00	3.44
485	003023	彩虹集团	554,064.00	3.42
486	002806	华锋股份	551,104.00	3.40
487	601798	蓝科高新	540,180.00	3.33
488	603797	联泰环保	540,018.00	3.33
489	600661	昂立教育	535,072.00	3.30

490	600305	恒顺醋业	533,563.80	3.29
491	002394	联发股份	530,893.00	3.27
492	605178	时空科技	530,547.00	3.27
493	300885	海昌新材	527,020.00	3.25
494	605567	春雪食品	526,745.00	3.25
495	600272	开开实业	526,722.00	3.25
496	300839	博汇股份	526,369.00	3.25
497	605008	长鸿高科	525,310.00	3.24
498	300517	海波重科	524,785.00	3.24
499	603518	锦泓集团	517,462.00	3.19
500	002238	天威视讯	510,269.00	3.15
501	605166	聚合顺	509,152.00	3.14
502	300980	祥源新材	500,609.00	3.09
503	001222	源飞宠物	499,476.80	3.08
504	000017	深中华 A	498,854.00	3.08
505	000565	渝三峡 A	498,755.00	3.08
506	688718	唯赛勃	497,441.70	3.07
507	300932	三友联众	497,099.00	3.07
508	001255	博菲电气	494,207.00	3.05
509	002888	惠威科技	493,363.00	3.04
510	001268	联合精密	493,285.00	3.04
511	301237	和顺科技	490,518.00	3.03
512	688229	博睿数据	489,640.29	3.02
513	603726	朗迪集团	480,656.00	2.96
514	300621	维业股份	477,363.00	2.94
515	688217	睿昂基因	475,814.53	2.93
516	002789	建艺集团	472,474.00	2.91
517	688501	青达环保	472,240.97	2.91
518	002760	凤形股份	469,452.00	2.90
519	301009	可靠股份	469,114.00	2.89
520	300694	蠡湖股份	462,923.00	2.86
521	300615	欣天科技	462,785.00	2.85
522	300195	长荣股份	460,461.00	2.84
523	603038	华立股份	458,692.00	2.83
524	300096	ST 易联众	456,322.00	2.81
525	688466	金科环境	454,670.81	2.80
526	301313	凡拓数创	450,247.00	2.78
527	300854	中兰环保	449,608.00	2.77
528	603978	深圳新星	446,405.00	2.75
529	300771	智莱科技	443,225.00	2.73
530	603238	诺邦股份	443,177.00	2.73
531	688069	德林海	442,707.88	2.73
532	002999	天禾股份	441,050.00	2.72

533	002636	金安国纪	440,246.55	2.72
534	000159	国际实业	439,991.00	2.71
535	300971	博亚精工	437,118.00	2.70
536	300264	佳创视讯	436,284.00	2.69
537	603895	天永智能	435,992.00	2.69
538	601699	潞安环能	432,223.70	2.67
539	600168	武汉控股	425,398.00	2.62
540	300789	唐源电气	424,824.00	2.62
541	002457	青龙管业	424,504.00	2.62
542	603201	常润股份	420,453.60	2.59
543	605100	华丰股份	419,896.00	2.59
544	300306	远方信息	419,630.00	2.59
545	300948	冠中生态	414,033.00	2.55
546	300074	华平股份	413,820.00	2.55
547	300295	三六五网	410,218.00	2.53
548	300425	中建环能	408,050.00	2.52
549	301259	艾布鲁	406,011.20	2.50
550	000705	浙江震元	404,784.00	2.50
551	002165	红宝丽	403,324.00	2.49
552	301016	雷尔伟	400,004.00	2.47
553	600867	通化东宝	399,095.00	2.46
554	300486	东杰智能	395,923.00	2.44
555	000156	华数传媒	392,837.00	2.42
556	002397	梦洁股份	391,926.00	2.42
557	301113	雅艺科技	391,087.00	2.41
558	301160	翔楼新材	390,321.00	2.41
559	300901	中胤时尚	389,822.00	2.40
560	603228	景旺电子	387,889.00	2.39
561	600500	中化国际	386,791.00	2.39
562	603836	海程邦达	385,453.00	2.38
563	000407	胜利股份	382,955.00	2.36
564	000678	襄阳轴承	382,767.00	2.36
565	603150	万朗磁塑	382,677.00	2.36
566	688057	金达莱	382,600.23	2.36
567	688379	华光新材	382,019.52	2.36
568	002360	同德化工	381,854.00	2.36
569	603182	嘉华股份	379,798.00	2.34
570	003002	壶化股份	377,491.00	2.33
571	688613	奥精医疗	376,568.86	2.32
572	603955	大千生态	374,846.00	2.31
573	000421	南京公用	372,644.00	2.30
574	300519	新光药业	372,330.00	2.30
575	603677	奇精机械	371,822.00	2.29

576	301119	正强股份	371,020.00	2.29
577	301331	恩威医药	370,628.00	2.29
578	300374	中铁装配	370,346.00	2.28
579	300165	天瑞仪器	368,685.00	2.27
580	300877	金春股份	368,596.00	2.27
581	002690	美亚光电	368,287.00	2.27
582	600141	兴发集团	366,014.00	2.26
583	301108	洁雅股份	365,013.00	2.25
584	300556	丝路视觉	364,609.00	2.25
585	300966	共同药业	364,494.00	2.25
586	603268	松发股份	363,901.00	2.24
587	603385	惠达卫浴	363,695.00	2.24
588	300952	恒辉安防	363,640.00	2.24
589	002172	澳洋健康	362,847.00	2.24
590	603102	百合股份	362,833.00	2.24
591	688183	生益电子	360,267.23	2.22
592	600097	开创国际	360,059.00	2.22
593	002164	宁波东力	358,440.00	2.21
594	688218	江苏北人	356,324.54	2.20
595	002381	双箭股份	353,348.00	2.18
596	300335	迪森股份	350,513.00	2.16
597	688171	纬德信息	349,688.60	2.16
598	301065	本立科技	348,631.00	2.15
599	600192	长城电工	348,201.00	2.15
600	301379	天山电子	347,942.00	2.15
601	688089	嘉必优	346,995.55	2.14
602	300410	正业科技	346,320.00	2.14
603	600962	国投中鲁	346,279.00	2.14
604	301121	紫建电子	343,445.00	2.12
605	600820	隧道股份	339,792.00	2.10
606	605488	福莱新材	339,598.00	2.09
607	601231	环旭电子	339,074.00	2.09
608	002347	泰尔股份	337,996.00	2.08
609	688203	海正生材	337,932.83	2.08
610	601616	广电电气	335,953.00	2.07
611	600873	梅花生物	334,209.00	2.06
612	603080	新疆火炬	334,201.00	2.06
613	603225	新凤鸣	334,059.00	2.06
614	600507	方大特钢	333,565.51	2.06
615	600089	特变电工	331,929.00	2.05
616	300539	横河精密	331,190.00	2.04
617	300563	神宇股份	326,719.00	2.02
618	688511	天微电子	325,832.49	2.01



619	000028	国药一致	325,573.00	2.01
-----	--------	------	------------	------

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	1,441,754,034.72
卖出股票收入（成交）总额	1,099,293,285.69

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	22,074,661.37	5.41
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	22,074,661.37	5.41

### 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	019709	23 国债 16	152,000	15,279,539.73	3.74
2	019703	23 国债 10	67,000	6,795,121.64	1.66

### 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	123,607.75
2	应收清算款	2,553,804.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	831,792.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,509,204.46

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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	52,902	6,487.33	303,520,592.68	88.44	39,671,955.12	11.56
东方量化 成长灵活 配置混合 C	2,115	4,052.64	31,869.46	0.37	8,539,463.16	99.63
合计	55,017	6,393.73	303,552,462.14	86.29	48,211,418.28	13.71

### 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	590,295.10	0.17
	东方量化成长灵活配置混合 C	11,572.64	0.14
	合计	601,867.74	0.17

### 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	10~50
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	10~50
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	10~50
	东方量化成长灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

## § 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)	694,463,618.20	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	11,927,537.99	-
本报告期基金总申购份额	391,716,391.68	10,551,999.11
减：本报告期基金总赎回份额	60,451,381.87	1,980,666.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	343,192,547.80	8,571,332.62

注：基金总申购份额包含基金转换入、红利再投资份额，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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产管理业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 20,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供 6 年的审计服务。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	1,809,284,435.64	71.21	444,899.55	39.21	-
中信建投证券股份有限公司	1	310,111,340.64	12.21	293,338.44	25.85	-
东北证券股份有限公司	2	224,961,740.38	8.85	212,815.67	18.76	-
招商证券股份有限公司	1	100,181,277.78	3.94	93,998.31	8.28	-
华西证券股份有限公司	2	44,319,373.90	1.74	41,274.67	3.64	-
华创证券有限责任公司	1	30,909,683.13	1.22	28,785.22	2.54	-
国金证券股份有限公司	1	20,063,516.19	0.79	18,685.34	1.65	-
国投证券股份有限公司	1	901,889.00	0.04	839.90	0.07	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	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资历雄厚，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，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、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研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内本基金新增交易单元 5 个，分别为华鑫证券有限责任公司上海、深圳交易单元各 1 个，国联证券股份有限公司上海、深圳交易单元各 1 个，长城证券股份有限公司深圳交易单元 1 个。

### 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	30,688,585.00	73.26	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	5,491,781.00	13.11	900,000.00	91.84	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	5,711,223.00	13.63	80,000.00	8.16	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方财 富证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证 券股 份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财 富证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 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	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 19 日
2	关于增加平安银行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、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	2023 年 2 月 9 日
3	关于增加和合期货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	2023 年 2 月 10 日
4	关于增加平安银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
5	关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 2 日
6	关于增加深圳新华信通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	2023 年 3 月 9 日
7	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 29 日
8	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 22 日
9	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	2023 年 5 月 4 日
10	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）（2023 年	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网	2023 年 5 月 4 日

	第 1 号)	站	
11	关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司行 E 通平台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	2023 年 5 月 31 日
12	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为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	2023 年 5 月 31 日
13	关于增加华西证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
14	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为公司旗下部分基金销售机构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	2023 年 6 月 19 日
15	关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	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	2023 年 6 月 30 日
16	关于增加民生证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、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	2023 年 7 月 13 日
17	关于增加安信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	2023 年 7 月 13 日
18	关于增加杭州银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
19	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 7 月 21 日
20	关于增加九州证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2023 年 8 月 1 日

	投及转换业务的公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
21	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 1 日
22	关于增加海通证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 19 日
23	关于增加海通证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 24 日
24	关于增加宁波银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 24 日
25	东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	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	2023 年 8 月 25 日
26	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2023 年 8 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
27	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 8 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
28	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	2023 年 8 月 29 日
29	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）（2023 年第 2 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
30	关于增加国金证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日

		露网站	
31	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 8 月 31 日
32	东方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信(海口)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	2023 年 9 月 1 日
33	关于增加招商银行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	2023 年 9 月 4 日
34	关于增加甬兴证券有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2023 年 9 月 14 日
35	关于增加麦高证券有限责任公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务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	2023 年 10 月 19 日
36	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务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	2023 年 10 月 24 日
37	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 10 月 25 日
38	关于增加长江证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 30 日
39	东方基金管理股份有限公司关于恢复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	2023 年 11 月 3 日
40	关于增加长江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	2023 年 11 月 3 日

		中国证监会基金电子披露网站	
41	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金暂停 10 万元以上（不含 10 万元）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	2023 年 11 月 14 日
42	关于增加德邦证券股份有限公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务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	2023 年 11 月 16 日
43	东方基金管理股份有限公司关于公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日
44	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 11 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 23 日
45	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2023 年 11 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 23 日
46	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	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	2023 年 11 月 23 日
47	关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任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	2023 年 11 月 24 日
48	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）（2023 年第 3 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 24 日
49	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	2023 年 11 月 24 日
50	关于增加上海天天基金销售有限公司等 44 家机构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	2023 年 11 月 27 日
51	关于旗下部分基金参与东兴证券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	2023 年 11 月 28 日

		中国证监会基金电子披露网站	
52	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 次分红公告	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	2023 年 12 月 7 日
53	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 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	20231027-20231231	0.00	101,476,445.29	0.00	101,476,445.29	28.85
	2	20231027-20231231	0.00	101,476,445.29	0.00	101,476,445.29	28.85
	3	20230928-20231026	0.00	10,094,898.37	10,094,898.37	0.00	0.00
个人	1	20230717-20230723	0.00	13,738,407.63	13,738,407.63	0.00	0.00
	2	20230928-20231026	0.00	10,094,898.37	10,094,898.37	0.00	0.00

#### 产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。

(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。

## § 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

2024 年 3 月 30 日