

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	75
§ 8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
§ 9 开放式基金份额变动	76
§ 10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	81
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	84
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	84
§ 12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录	85
12.2 存放地点	85
12.3 查阅方式	85

§ 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	58,728,030.54 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	51,725,301.61 份	7,002,728.93 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
本期已实现收益	-77,954,552.14	-2,604,332.09
本期利润	-78,630,478.28	-5,268,009.94
加权平均基金份额本期利润	-0.7176	-0.3482
本期加权平均净值利润率	-68.76%	-25.23%
本期基金份额净值增长率	-17.33%	-17.54%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-2,526,384.32	1,958,079.15
期末可供分配基金份额利润	-0.0488	0.2796
期末基金资产净值	49,198,917.29	8,960,808.08
期末基金份额净值	0.9512	1.2796

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	27.47%	-17.73%

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
过去一个月	-8.39%	1.74%	-8.70%	1.76%	0.31%	-0.02%
过去三个月	-9.18%	1.85%	-13.06%	1.91%	3.88%	-0.06%
过去六个月	-17.33%	2.34%	-22.11%	2.38%	4.78%	-0.04%
过去一年	-10.76%	1.78%	-27.73%	1.72%	16.97%	0.06%
过去三年	-16.31%	1.38%	-31.65%	1.14%	15.34%	0.24%
自基金合同生效起至今	27.47%	1.31%	-23.93%	1.01%	51.40%	0.30%

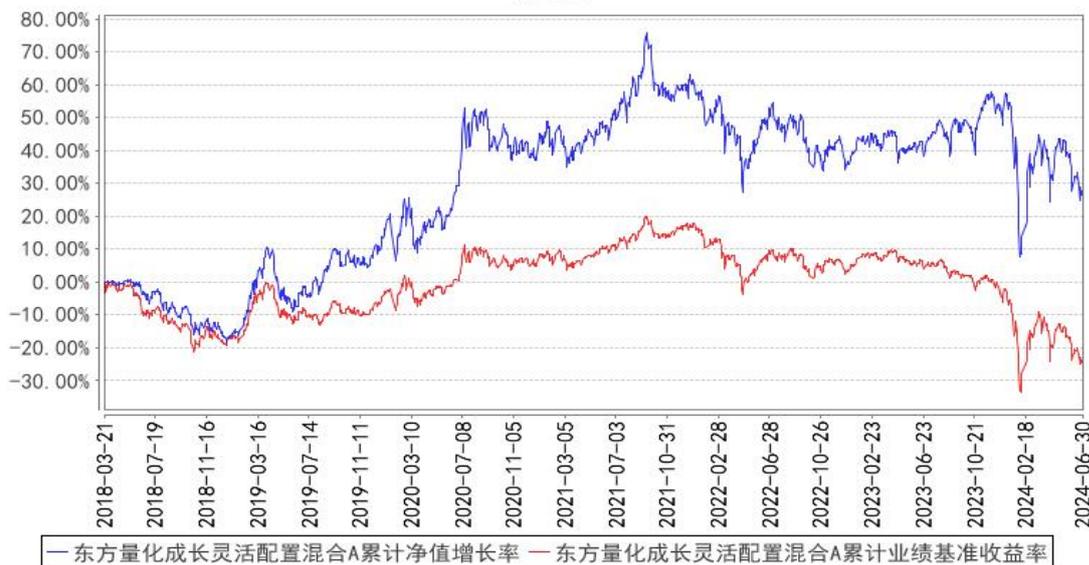
东方量化成长灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.43%	1.74%	-8.70%	1.76%	0.27%	-0.02%
过去三个月	-9.30%	1.85%	-13.06%	1.91%	3.76%	-0.06%
过去六个月	-17.54%	2.34%	-22.11%	2.38%	4.57%	-0.04%
自基金合同生效起	-17.73%	2.15%	-24.90%	2.18%	7.17%	-0.03%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

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



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本公司注册资本 3.3333 亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份 19200 万股，持股比例 57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份 8100 万股，持股比例 24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份 2700 万股，持股比例 8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1170 万股，持股比例 3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1123 万股，持股比例 3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1040 万股，持股比例 3.12%。

截止 2024 年 6 月 30 日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券

投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛泽	本基金基金经理、量化投资部总经理、资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员	2018 年 8 月 13 日	-	9 年	量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，9 年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018 年 7 月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。
王怀勋	本基金基金经理	2022 年 5 月 17 日	-	9 年	中国人民大学金融专业硕士，9 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基

					金经理。
--	--	--	--	--	------

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-17.33%，业绩比较基准收益率为-22.11%，高于业绩比较基准 4.78%；本基金 C 类净值增长率为-17.54%，业绩比较基准收益率为-22.11%，高于业绩比较基准 4.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、

投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

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

2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

(5) 负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

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

4. 合规法务部、风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	649,922.39	4,171,394.15
结算备付金		2,362,497.21	5,132,890.33
存出保证金		210,358.96	123,607.75
交易性金融资产	6.4.7.2	55,164,837.43	400,982,549.19
其中：股票投资		51,827,188.26	378,907,887.82
基金投资		-	-
债券投资		3,337,649.17	22,074,661.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		255,174.71	2,553,804.08
应收股利		-	-
应收申购款		51,724.30	831,792.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		58,694,515.00	413,796,038.13
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,835,591.82
应付赎回款		261,830.17	1,261,664.05
应付管理人报酬		60,370.41	438,896.39
应付托管费		10,061.74	73,149.42
应付销售服务费		4,037.93	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	6.4.7.7	198,489.38	1,001,028.44
负债合计		534,789.63	5,614,204.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	58,728,030.54	351,763,880.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	-568,305.17	56,417,952.82
净资产合计		58,159,725.37	408,181,833.24
负债和净资产总计		58,694,515.00	413,796,038.13

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，东方量化成长灵活配置混合 A 基金份额净值 0.9512 元，基金份额总额 51,725,301.61 份；东方量化成长灵活配置混合 C 基金份额净值 1.2796 元，基金份额总额 7,002,728.93 份。东方量化成长灵活配置混合份额总额合计为 58,728,030.54 份。

6.2 利润表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-82,835,608.31	961,962.70
1. 利息收入		42,365.11	1,345.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	42,365.11	1,345.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-81,209,145.82	1,112,346.27
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-82,030,143.87	968,044.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	128,624.78	8,390.46
资产支持证券投 资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	110,286.30	-
股利收益	6.4.7.16	582,086.97	135,911.12
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,339,603.99	-152,433.06
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	1,670,776.39	703.98
减：二、营业总支出		1,062,879.91	142,377.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	796,622.49	94,188.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	132,770.40	19,622.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	50,895.42	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,217.91	-

其中：卖出回购金融资产支出		6,217.91	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		397.47	-
8. 其他费用	6.4.7.20	75,976.22	28,566.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-83,898,488.22	819,584.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-83,898,488.22	819,584.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-83,898,488.22	819,584.88

6.3 净资产变动表

会计主体：东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,763,880.42	-	56,417,952.82	408,181,833.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-293,035,849.88	-	-56,986,257.99	-350,022,107.87
（一）、综合收益总额	-	-	-83,898,488.22	-83,898,488.22
（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）	-293,035,849.88	-	26,912,230.23	-266,123,619.65
其中：1. 基金申购款	155,793,197.04	-	33,017,642.28	188,810,839.32
2. 基金赎回	-448,829,046.9	-	-6,105,412.05	-454,934,458.97

回款	2			
(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	58,728,030.54	-	-568,305.17	58,159,725.37
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-1,040,428.33	-	378,445.57	-661,982.76
(一)、综合收益总额	-	-	819,584.88	819,584.88
(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)	-1,040,428.33	-	-441,139.31	-1,481,567.64
其中：1. 基金申购款	704,366.82	-	306,171.46	1,010,538.28
2. 基金赎回款	-1,744,795.15	-	-747,310.77	-2,492,105.92
(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	10,887,109.66	-	4,664,292.60	15,551,402.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1419 号文和证监许可[2017]1557 号文准予募集注册，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 694,463,618.20 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者，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》

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化

个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

(2) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌

公司”)取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	649,922.39
等于: 本金	649,845.93
加: 应计利息	76.46
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	649,922.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	54,968,451.00	-	51,827,188.26	-3,141,262.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	29,999.17	3,337,649.17	275.66
	银行间市场	-	-	-
	合计	29,999.17	3,337,649.17	275.66
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,275,825.34	29,999.17	55,164,837.43	-3,140,987.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	132,244.53
其中：交易所市场	132,244.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	66,186.22
合计	198,489.38

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	343,192,547.80	343,192,547.80
本期申购	70,023,799.06	70,023,799.06
本期赎回（以“-”号填列）	-361,491,045.25	-361,491,045.25
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	51,725,301.61	51,725,301.61

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,571,332.62	8,571,332.62
本期申购	85,769,397.98	85,769,397.98
本期赎回（以“-”号填列）	-87,338,001.67	-87,338,001.67
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	7,002,728.93	7,002,728.93

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方量化成长灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	172,807,339.88	-121,118,153.46	51,689,186.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	172,807,339.88	-121,118,153.46	51,689,186.42
本期利润	-77,954,552.14	-675,926.14	-78,630,478.28
本期基金份额交易产生的变动数	-79,241,497.46	103,656,405.00	24,414,907.54
其中：基金申购款	23,938,538.31	-22,935,440.78	1,003,097.53
基金赎回款	-103,180,035.77	126,591,845.78	23,411,810.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,611,290.28	-18,137,674.60	-2,526,384.32

东方量化成长灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,650,375.16	-2,921,608.76	4,728,766.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,650,375.16	-2,921,608.76	4,728,766.40
本期利润	-2,604,332.09	-2,663,677.85	-5,268,009.94
本期基金份额交易产生的变动数	-723,016.12	3,220,338.81	2,497,322.69
其中：基金申购款	53,317,595.02	-21,303,050.27	32,014,544.75
基金赎回款	-54,040,611.14	24,523,389.08	-29,517,222.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,323,026.95	-2,364,947.80	1,958,079.15

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	18,476.85
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	21,864.08
其他	2,024.18
合计	42,365.11

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-82,030,143.87
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	-82,030,143.87

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,450,912,831.80
减：卖出股票成本总额	1,530,410,682.17
减：交易费用	2,532,293.50
买卖股票差价收入	-82,030,143.87

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	75,236.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	53,388.06
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	128,624.78

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,490,930.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,153,075.94
减：应计利息总额	284,466.06
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	53,388.06

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	110,286.30

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	582,086.97
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	582,086.97

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,339,603.99
股票投资	-3,306,941.93
债券投资	-32,662.06
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	-3,339,603.99
----	---------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,610,789.74
基金转换费收入	59,986.65
合计	1,670,776.39

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	190.00
账户维护费	18,600.00
合计	75,976.22

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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	243,358,079.32	9.16	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	5,502,089.00	16.26	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	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	230,209.61	14.07	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	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 (%)
-	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	796,622.49	94,188.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	179,400.73	45,816.59
应支付基金管理人的净管理费	617,221.76	48,371.66

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	132,770.40	19,622.58

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、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	5,420.37	5,420.37
合计	-	5,420.37	5,420.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化成长灵活配置混合 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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	649,922.39	18,476.85	584,086.82	887.94

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.81	138	3,865.38	5,217.78	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.22	87	3,460.84	7,936.14	-

		日								
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.33	603	42,508.15	113,562.99	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.92	219	4,255.17	8,085.48	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.48	107	2,276.96	3,154.36	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.34	130	3,772.60	3,294.20	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.02	64	4,637.44	4,353.28	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.88	72	2,748.96	2,799.36	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.87	477	10,808.82	7,569.99	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.54	155	3,476.65	4,888.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600220	ST阳光	2024年6月14日	重大事项停牌	0.37	-	-	44,300	77,243.55	16,391.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	649,922.39	-	-	-	649,922.39
结算备付金	2,362,497.21	-	-	-	2,362,497.21
存出保证金	210,358.96	-	-	-	210,358.96
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	51,827,188.26	51,827,188.26
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	3,337,649.17	-	-	-	3,337,649.17
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	-	-	-	255,174.71	255,174.71
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	51,724.30	51,724.30
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,560,427.73	-	-	52,134,087.27	58,694,515.00
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	-	-	-	261,830.17	261,830.17
应付管理人报酬	-	-	-	60,370.41	60,370.41
应付托管费	-	-	-	10,061.74	10,061.74
应付销售服务费	-	-	-	4,037.93	4,037.93
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	-	-	-	198,489.38	198,489.38
负债总计	-	-	-	534,789.63	534,789.63
利率敏感度缺口	6,560,427.73	-	-	51,599,297.64	58,159,725.37
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日				
资产				
货币资金	4,171,394.15	-	-	4,171,394.15
结算备付金	5,132,890.33	-	-	5,132,890.33
存出保证金	123,607.75	-	-	123,607.75
交易性金融资产-股票投资	-	-	-378,907,887.82	378,907,887.82
交易性金融资产-债券投资	22,074,661.37	-	-	22,074,661.37
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	2,553,804.08	2,553,804.08
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	831,792.63	831,792.63
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	31,502,553.60	-	-382,293,484.53	413,796,038.13
负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	2,835,591.82	2,835,591.82
应付赎回款	-	-	1,261,664.05	1,261,664.05
应付管理人报酬	-	-	438,896.39	438,896.39
应付托管费	-	-	73,149.42	73,149.42
应付销售服务费	-	-	3,874.77	3,874.77
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	1,001,028.44	1,001,028.44
负债总计	-	-	5,614,204.89	5,614,204.89
利率敏感度缺口	31,502,553.60	-	-376,679,279.64	408,181,833.24

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响
----	--

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-4,634.63	-26,637.66
市场利率下调 0.25%	4,634.63	26,637.66	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	51,827,188.26	89.11	378,907,887.82	92.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,337,649.17	5.74	22,074,661.37	5.41
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	55,164,837.43	94.85	400,982,549.19	98.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到, 对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票, 默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%, 其他市场变量均不发生变化, 计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上涨 5%	4,077,354.18	13,476,940.84
	沪深 300 指数下跌 5%	-4,077,354.18	-13,476,940.84

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	51,649,934.98	378,849,204.77
第二层次	3,354,040.17	22,074,661.37
第三层次	160,862.28	58,683.05

合计	55,164,837.43	400,982,549.19
----	---------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	51,827,188.26	88.30
	其中：股票	51,827,188.26	88.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,337,649.17	5.69
	其中：债券	3,337,649.17	5.69
	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	3,012,419.60	5.13
8	其他各项资产	517,257.97	0.88
9	合计	58,694,515.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	540,471.00	0.93
B	采矿业	192,547.00	0.33
C	制造业	35,761,268.51	61.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,405,315.00	2.42
E	建筑业	720,482.00	1.24
F	批发和零售业	2,049,844.20	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	967,231.00	1.66
H	住宿和餐饮业	67,062.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,497,934.81	9.45
J	金融业	169,425.00	0.29
K	房地产业	891,854.00	1.53
L	租赁和商务服务业	598,160.60	1.03
M	科学研究和技术服务业	995,975.14	1.71
N	水利、环境和公共设施管理业	1,173,883.00	2.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	113,210.00	0.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	500,423.00	0.86
S	综合	182,102.00	0.31
	合计	51,827,188.26	89.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600125	铁龙物流	44,800	267,456.00	0.46
2	301185	鸥玛软件	16,200	232,146.00	0.40
3	003039	顺控发展	18,500	231,805.00	0.40
4	688380	中微半导	13,513	225,937.36	0.39
5	002441	众业达	28,100	212,998.00	0.37
6	300224	正海磁材	22,200	205,572.00	0.35
7	000544	中原环保	24,200	190,454.00	0.33
8	002782	可立克	16,800	186,144.00	0.32
9	600552	凯盛科技	19,100	180,113.00	0.31

10	002543	万和电气	17,800	177,288.00	0.30
11	300388	节能国祯	30,700	170,078.00	0.29
12	002757	南兴股份	14,100	169,905.00	0.29
13	601311	骆驼股份	20,700	166,014.00	0.29
14	000612	焦作万方	24,500	159,250.00	0.27
15	603693	江苏新能	13,600	158,032.00	0.27
16	603630	拉芳家化	15,000	157,650.00	0.27
17	300231	银信科技	20,900	153,615.00	0.26
18	000507	珠海港	34,400	152,392.00	0.26
19	603881	数据港	11,860	150,740.60	0.26
20	600235	民丰特纸	32,700	150,420.00	0.26
21	600897	厦门空港	11,900	150,059.00	0.26
22	300752	隆利科技	11,000	149,380.00	0.26
23	600133	东湖高新	13,800	144,072.00	0.25
24	300504	天邑股份	11,600	141,404.00	0.24
25	002053	云南能投	11,600	140,244.00	0.24
26	002135	东南网架	35,200	139,392.00	0.24
27	000517	荣安地产	51,900	139,092.00	0.24
28	603809	豪能股份	17,200	138,976.00	0.24
29	002707	众信旅游	24,200	138,908.00	0.24
30	600200	江苏吴中	15,500	138,880.00	0.24
31	688076	诺泰生物	1,771	138,633.88	0.24
32	000888	峨眉山 A	12,700	138,303.00	0.24
33	300166	东方国信	22,400	137,088.00	0.24
34	603158	腾龙股份	19,000	133,760.00	0.23
35	600694	大商股份	7,920	133,135.20	0.23
36	688138	清溢光电	6,190	133,085.00	0.23
37	688158	优刻得	12,975	132,734.25	0.23
38	002815	崇达技术	14,000	131,320.00	0.23
39	002189	中光学	9,400	131,036.00	0.23
40	603999	读者传媒	27,600	130,548.00	0.22
41	300048	合康新能	28,100	130,103.00	0.22
42	301028	东亚机械	14,800	129,796.00	0.22
43	300691	联合光电	8,600	129,430.00	0.22
44	000530	冰山冷热	35,600	128,872.00	0.22
45	300548	博创科技	6,600	128,634.00	0.22
46	300802	矩子科技	8,000	126,160.00	0.22
47	605166	聚合顺	12,000	125,880.00	0.22
48	603009	北特科技	7,000	125,510.00	0.22
49	605077	华康股份	8,230	125,507.50	0.22
50	603610	麒盛科技	12,700	125,476.00	0.22
51	300085	银之杰	15,500	125,240.00	0.22
52	603989	艾华集团	8,900	125,134.00	0.22

53	002115	三维通信	25,600	124,416.00	0.21
54	688210	统联精密	5,600	124,040.00	0.21
55	000551	创元科技	14,200	123,966.00	0.21
55	002282	博深股份	19,400	123,966.00	0.21
56	300331	苏大维格	7,700	123,816.00	0.21
57	603861	白云电器	14,700	123,039.00	0.21
58	002469	三维化学	21,400	121,980.00	0.21
59	300113	顺网科技	11,900	121,856.00	0.21
60	600262	北方股份	7,400	121,582.00	0.21
61	601700	风范股份	27,600	121,164.00	0.21
62	603229	奥翔药业	11,900	119,595.00	0.21
63	002580	圣阳股份	19,400	119,310.00	0.21
64	002635	安洁科技	7,700	118,888.00	0.20
65	002577	雷柏科技	9,600	118,752.00	0.20
66	600476	湘邮科技	9,800	117,600.00	0.20
67	002462	嘉事堂	10,700	117,058.00	0.20
68	300233	金城医药	7,800	116,376.00	0.20
69	603633	徕木股份	14,700	116,277.00	0.20
70	000777	中核科技	7,600	116,128.00	0.20
71	000880	潍柴重机	14,500	115,855.00	0.20
72	600961	株冶集团	12,200	115,168.00	0.20
73	300087	荃银高科	18,600	114,948.00	0.20
74	300978	东箭科技	12,400	114,452.00	0.20
75	300674	宇信科技	10,300	114,124.00	0.20
76	002017	东信和平	13,700	114,121.00	0.20
77	301589	诺瓦星云	603	113,562.99	0.20
78	000900	现代投资	31,000	113,460.00	0.20
79	300608	思特奇	12,500	112,250.00	0.19
80	002961	瑞达期货	10,200	111,690.00	0.19
81	300522	世名科技	10,100	111,605.00	0.19
82	601028	玉龙股份	8,900	111,250.00	0.19
83	300047	天源迪科	16,900	110,526.00	0.19
84	600215	派斯林	15,500	110,515.00	0.19
85	002962	五方光电	7,300	110,376.00	0.19
86	600797	浙大网新	23,700	109,731.00	0.19
87	600367	红星发展	11,000	109,010.00	0.19
88	002376	新北洋	20,100	108,339.00	0.19
89	001301	尚太科技	2,500	108,050.00	0.19
90	688252	天德钰	7,350	106,795.50	0.18
91	300011	鼎汉技术	21,300	106,287.00	0.18
92	300453	三鑫医疗	16,600	106,074.00	0.18
93	603367	辰欣药业	7,600	105,944.00	0.18
94	300179	四方达	15,900	105,099.00	0.18

95	300327	中颖电子	5,300	104,304.00	0.18
96	300235	方直科技	13,000	104,260.00	0.18
97	002512	达华智能	30,000	103,500.00	0.18
98	000045	深纺织 A	12,900	103,458.00	0.18
99	000969	安泰科技	13,000	103,090.00	0.18
100	300320	海达股份	12,600	102,816.00	0.18
101	002452	长高电新	12,400	102,672.00	0.18
102	002454	松芝股份	18,200	101,738.00	0.17
103	002980	华盛昌	4,600	100,694.00	0.17
104	688127	蓝特光学	5,472	100,630.08	0.17
105	002955	鸿合科技	4,300	100,534.00	0.17
106	600531	豫光金铅	15,500	99,820.00	0.17
107	603906	龙蟠科技	12,800	99,712.00	0.17
108	002785	万里石	4,000	99,400.00	0.17
109	300424	航新科技	8,100	99,063.00	0.17
110	002386	天原股份	25,900	98,938.00	0.17
111	600379	宝光股份	11,900	98,651.00	0.17
112	688595	芯海科技	3,268	98,040.00	0.17
113	002753	永东股份	16,800	97,608.00	0.17
114	300193	佳士科技	13,100	97,202.00	0.17
115	603018	华设集团	10,600	96,354.00	0.17
116	300304	云意电气	14,800	96,348.00	0.17
117	300659	中孚信息	7,400	95,978.00	0.17
118	002636	金安国纪	15,100	95,885.00	0.16
119	000905	厦门港务	16,900	95,485.00	0.16
120	002845	同兴达	7,200	95,184.00	0.16
121	600114	东睦股份	6,600	94,974.00	0.16
122	002166	莱茵生物	13,800	94,392.00	0.16
123	300545	联得装备	3,800	93,290.00	0.16
124	603360	百傲化学	7,900	92,825.00	0.16
125	002664	信质集团	7,800	92,820.00	0.16
126	603161	科华控股	6,200	92,814.00	0.16
127	002755	奥赛康	9,600	92,640.00	0.16
128	600366	宁波韵升	17,700	92,394.00	0.16
129	600189	泉阳泉	13,900	92,296.00	0.16
130	688800	瑞可达	3,283	92,186.64	0.16
131	300170	汉得信息	15,000	92,100.00	0.16
132	003000	劲仔食品	7,600	91,580.00	0.16
133	603686	福龙马	12,000	91,440.00	0.16
134	300019	硅宝科技	6,900	91,425.00	0.16
135	002935	天奥电子	7,560	91,324.80	0.16
136	603676	卫信康	11,400	91,314.00	0.16
137	001206	依依股份	7,000	91,140.00	0.16

138	300729	乐歌股份	5,800	89,842.00	0.15
139	300025	华星创业	8,500	89,420.00	0.15
140	600955	维远股份	6,200	89,342.00	0.15
141	000973	佛塑科技	24,200	89,298.00	0.15
142	601500	通用股份	16,600	88,644.00	0.15
143	688219	会通股份	11,377	88,399.29	0.15
144	600218	全柴动力	13,100	87,901.00	0.15
145	002380	科远智慧	4,800	87,840.00	0.15
146	300634	彩讯股份	5,200	87,516.00	0.15
147	002967	广电计量	7,400	87,320.00	0.15
148	603667	五洲新春	5,300	86,920.00	0.15
149	300105	龙源技术	13,400	86,564.00	0.15
150	688362	甬矽电子	4,445	86,499.70	0.15
151	300491	通合科技	6,000	86,160.00	0.15
152	301019	宁波色母	4,600	86,020.00	0.15
153	603222	济民健康	15,600	85,800.00	0.15
154	002590	万安科技	6,500	85,670.00	0.15
155	603967	中创物流	9,200	85,560.00	0.15
156	000926	福星股份	26,900	85,273.00	0.15
157	300570	太辰光	2,600	84,916.00	0.15
158	002835	同为股份	5,000	84,450.00	0.15
159	605333	沪光股份	3,000	83,550.00	0.14
160	603663	三祥新材	5,800	83,462.00	0.14
161	603903	中持股份	11,800	82,718.00	0.14
162	300909	汇创达	3,700	82,658.00	0.14
163	600251	冠农股份	11,400	82,536.00	0.14
164	002579	中京电子	11,300	82,490.00	0.14
165	000524	岭南控股	10,000	80,600.00	0.14
166	688129	东来技术	6,452	80,585.48	0.14
167	002950	奥美医疗	12,200	80,520.00	0.14
168	002442	龙星化工	18,500	79,550.00	0.14
169	300872	天阳科技	6,000	79,500.00	0.14
170	603912	佳力图	13,200	79,200.00	0.14
171	300831	派瑞股份	7,000	79,170.00	0.14
172	301063	海锅股份	5,500	78,870.00	0.14
173	603507	振江股份	2,400	78,768.00	0.14
174	000758	中色股份	15,500	78,740.00	0.14
175	300615	欣天科技	8,200	78,474.00	0.13
176	600658	电子城	23,800	78,302.00	0.13
177	600523	贵航股份	7,900	78,210.00	0.13
178	000736	中交地产	8,800	78,144.00	0.13
179	300292	吴通控股	22,000	78,100.00	0.13
180	002947	恒铭达	2,200	77,440.00	0.13

181	002174	游族网络	10,200	77,418.00	0.13
182	002598	山东章鼓	10,400	77,168.00	0.13
183	002997	瑞鹄模具	2,400	76,728.00	0.13
184	600633	浙数文化	8,700	76,647.00	0.13
185	300783	三只松鼠	3,500	76,545.00	0.13
186	002669	康达新材	9,300	76,539.00	0.13
187	600054	黄山旅游	6,800	76,296.00	0.13
188	600718	东软集团	9,200	76,084.00	0.13
189	603220	中贝通信	2,800	76,048.00	0.13
190	300204	舒泰神	13,400	75,844.00	0.13
191	300131	英唐智控	17,000	75,650.00	0.13
192	300975	商络电子	8,300	75,032.00	0.13
193	605218	伟时电子	4,600	74,290.00	0.13
194	605299	舒华体育	9,100	73,892.00	0.13
195	688313	仕佳光子	7,758	73,856.16	0.13
196	300925	法本信息	7,300	73,657.00	0.13
197	688123	聚辰股份	1,208	73,482.64	0.13
198	002613	北玻股份	21,100	73,428.00	0.13
199	000965	天保基建	28,000	73,360.00	0.13
200	300318	博晖创新	14,900	72,712.00	0.13
201	600371	万向德农	10,500	72,660.00	0.12
202	002287	奇正藏药	3,700	72,446.00	0.12
203	603602	纵横通信	5,800	72,326.00	0.12
204	000795	英洛华	13,000	72,020.00	0.12
205	300290	荣科科技	7,700	71,687.00	0.12
206	300891	惠云钛业	9,200	71,576.00	0.12
207	300041	回天新材	9,000	71,460.00	0.12
208	300241	瑞丰光电	17,300	70,930.00	0.12
209	002101	广东鸿图	6,700	70,551.00	0.12
210	600636	国新文化	9,400	70,500.00	0.12
211	002660	茂硕电源	9,500	70,490.00	0.12
212	300349	金卡智能	5,900	70,328.00	0.12
213	300520	科大国创	4,400	70,180.00	0.12
214	300789	唐源电气	5,300	70,172.00	0.12
215	300213	佳讯飞鸿	12,300	70,110.00	0.12
216	002796	世嘉科技	8,800	69,960.00	0.12
217	603399	永杉锂业	11,300	69,947.00	0.12
218	002879	长缆科技	5,300	69,589.00	0.12
219	603527	众源新材	9,800	69,580.00	0.12
220	300895	铜牛信息	2,800	69,524.00	0.12
221	688107	安路科技	2,734	69,498.28	0.12
222	300437	清水源	8,600	69,316.00	0.12
223	300747	锐科激光	3,900	69,225.00	0.12

224	600980	北矿科技	5,300	69,059.00	0.12
225	300740	水羊股份	4,700	68,996.00	0.12
226	603926	铁流股份	8,300	68,890.00	0.12
227	301126	达嘉维康	7,600	68,628.00	0.12
228	002859	洁美科技	3,400	68,272.00	0.12
229	300455	航天智装	5,500	67,980.00	0.12
230	300648	星云股份	4,000	67,920.00	0.12
231	002972	科安达	7,400	67,784.00	0.12
232	603518	锦泓集团	7,700	67,760.00	0.12
233	000990	诚志股份	9,100	67,704.00	0.12
234	002527	新时达	11,300	67,687.00	0.12
235	600592	龙溪股份	7,800	67,626.00	0.12
236	300815	玉禾田	5,800	67,512.00	0.12
237	300315	掌趣科技	16,100	67,137.00	0.12
238	688253	英诺特	1,760	67,073.60	0.12
239	002745	木林森	8,300	66,898.00	0.12
240	002339	积成电子	11,100	66,822.00	0.11
241	001217	华尔泰	7,300	66,795.00	0.11
242	300243	瑞丰高材	7,200	66,096.00	0.11
243	300341	麦克奥迪	7,700	66,066.00	0.11
244	688222	成都先导	5,752	65,285.20	0.11
245	300829	金丹科技	4,500	65,160.00	0.11
246	002576	通达动力	5,700	64,695.00	0.11
247	002883	中设股份	7,300	64,605.00	0.11
248	000833	粤桂股份	13,800	64,584.00	0.11
249	600257	大湖股份	14,300	64,493.00	0.11
250	600894	广日股份	5,600	64,400.00	0.11
251	688022	瀚川智能	4,696	64,382.16	0.11
252	688596	正帆科技	1,947	64,251.00	0.11
253	001380	华纬科技	3,300	64,152.00	0.11
254	601566	九牧王	7,600	63,992.00	0.11
255	605098	行动教育	1,500	63,930.00	0.11
256	600088	中视传媒	3,900	63,843.00	0.11
257	300685	艾德生物	3,600	63,504.00	0.11
258	603950	长源东谷	4,700	63,356.00	0.11
259	688028	沃尔德	3,850	63,255.50	0.11
260	002167	东方锆业	11,100	63,159.00	0.11
261	600640	国脉文化	6,100	63,135.00	0.11
262	688159	有方科技	1,658	62,771.88	0.11
263	002905	金逸影视	10,100	62,620.00	0.11
264	300258	精锻科技	7,700	62,601.00	0.11
265	300900	广联航空	3,340	62,558.20	0.11
266	002346	柘中股份	8,200	62,484.00	0.11

267	000006	深振业 A	16,100	62,468.00	0.11
268	600152	维科技术	13,000	62,400.00	0.11
269	002616	长青集团	14,400	62,208.00	0.11
270	300636	同和药业	6,100	62,037.00	0.11
271	300127	银河磁体	4,100	61,705.00	0.11
272	603118	共进股份	9,200	61,640.00	0.11
273	300867	圣元环保	5,800	61,538.00	0.11
274	688687	凯因科技	2,411	61,504.61	0.11
275	002881	美格智能	3,100	61,504.00	0.11
276	002559	亚威股份	8,000	61,280.00	0.11
277	002970	锐明技术	1,700	61,251.00	0.11
278	002245	蔚蓝锂芯	7,900	61,225.00	0.11
279	603017	中衡设计	6,900	61,134.00	0.11
280	300797	钢研纳克	6,600	61,116.00	0.11
281	603383	顶点软件	1,900	60,933.00	0.10
282	300514	友讯达	4,000	60,520.00	0.10
283	000532	华金资本	5,000	60,300.00	0.10
284	603579	荣泰健康	3,890	60,139.40	0.10
285	300053	航宇微	6,600	60,126.00	0.10
286	000936	华西股份	10,500	60,060.00	0.10
287	002297	博云新材	10,000	60,000.00	0.10
288	301137	哈焊华通	4,100	59,737.00	0.10
289	603181	皇马科技	6,600	59,334.00	0.10
290	300813	泰林生物	3,500	59,325.00	0.10
291	300758	七彩化学	5,500	59,125.00	0.10
292	000065	北方国际	5,700	59,109.00	0.10
293	000899	赣能股份	6,100	58,987.00	0.10
294	600618	氯碱化工	6,700	58,826.00	0.10
295	603357	设计总院	6,400	58,816.00	0.10
296	300733	西菱动力	5,900	58,764.00	0.10
297	002846	英联股份	8,600	58,738.00	0.10
298	301187	欧圣电气	2,400	58,200.00	0.10
299	301071	力量钻石	2,100	58,191.00	0.10
300	002136	安纳达	6,400	57,984.00	0.10
301	603320	迪贝电气	4,100	57,974.00	0.10
302	600288	大恒科技	8,900	57,939.00	0.10
303	688418	震有科技	3,382	57,933.66	0.10
304	300335	迪森股份	14,900	57,663.00	0.10
305	300719	安达维尔	3,400	57,630.00	0.10
306	300580	贝斯特	3,900	57,330.00	0.10
307	600620	天宸股份	13,400	57,218.00	0.10
308	301277	新天地	4,400	57,112.00	0.10
309	603677	奇精机械	4,900	57,085.00	0.10

310	003002	壶化股份	5,200	57,044.00	0.10
311	300907	康平科技	3,000	56,970.00	0.10
312	000030	富奥股份	11,600	56,956.00	0.10
313	002033	丽江股份	6,500	56,940.00	0.10
314	002661	克明食品	7,600	56,772.00	0.10
315	003036	泰坦股份	7,100	56,729.00	0.10
316	605228	神通科技	6,600	56,628.00	0.10
317	300869	康泰医学	4,300	56,201.00	0.10
318	688007	光峰科技	3,490	56,189.00	0.10
319	600990	四创电子	3,200	56,160.00	0.10
320	002982	湘佳股份	3,700	55,796.00	0.10
321	301248	杰创智能	3,700	55,759.00	0.10
322	300703	创源股份	6,900	55,752.00	0.10
323	300447	全信股份	4,500	55,710.00	0.10
324	603636	南威软件	7,200	55,440.00	0.10
325	300918	南山智尚	5,800	55,332.00	0.10
326	300397	天和防务	6,000	55,200.00	0.09
327	300004	南风股份	12,700	55,118.00	0.09
328	603929	亚翔集成	2,300	54,970.00	0.09
329	300396	迪瑞医疗	2,700	54,837.00	0.09
330	603683	晶华新材	6,900	54,786.00	0.09
331	300738	奥飞数据	5,400	54,648.00	0.09
332	301396	宏景科技	2,800	54,628.00	0.09
333	600686	金龙汽车	7,400	54,464.00	0.09
334	000153	丰原药业	10,100	54,338.00	0.09
335	300692	中环环保	11,700	54,171.00	0.09
336	603969	银龙股份	10,900	54,064.00	0.09
337	688230	芯导科技	1,489	53,991.14	0.09
338	002877	智能自控	7,300	53,947.00	0.09
339	002885	京泉华	5,000	53,900.00	0.09
340	301123	奕东电子	3,000	53,850.00	0.09
341	002182	宝武镁业	4,760	53,692.80	0.09
342	603629	利通电子	2,900	53,534.00	0.09
343	605018	长华集团	5,900	53,454.00	0.09
344	300174	元力股份	3,900	53,235.00	0.09
345	300958	建工修复	5,000	53,150.00	0.09
346	603053	成都燃气	5,500	53,130.00	0.09
347	300119	瑞普生物	3,900	53,118.00	0.09
348	300523	辰安科技	3,500	52,815.00	0.09
349	300727	润禾材料	2,400	52,704.00	0.09
350	301188	力诺特玻	3,600	52,452.00	0.09
351	002999	天禾股份	9,800	52,430.00	0.09
352	300505	川金诺	4,300	52,417.00	0.09

353	000417	合百集团	12,600	52,290.00	0.09
354	300773	拉卡拉	4,200	52,206.00	0.09
355	300987	川网传媒	4,300	52,202.00	0.09
356	605337	李子园	5,300	52,046.00	0.09
357	300556	丝路视觉	3,100	51,863.00	0.09
358	300898	熊猫乳品	3,100	51,801.00	0.09
359	301321	翰博高新	4,500	51,795.00	0.09
360	301061	匠心家居	1,100	51,656.00	0.09
361	000701	厦门信达	13,800	51,612.00	0.09
362	688150	莱特光电	2,647	51,351.80	0.09
363	603611	诺力股份	3,000	51,120.00	0.09
364	300183	东软载波	4,400	50,952.00	0.09
365	000514	渝开发	16,200	50,868.00	0.09
366	301109	军信股份	3,400	50,830.00	0.09
367	605598	上海港湾	2,300	50,807.00	0.09
368	002034	旺能环境	3,900	50,739.00	0.09
369	605118	力鼎光电	3,400	50,626.00	0.09
370	300272	开能健康	10,300	50,470.00	0.09
371	300584	海辰药业	3,300	50,259.00	0.09
372	300771	智莱科技	5,700	50,103.00	0.09
373	301167	建研设计	4,300	50,052.00	0.09
374	003015	日久光电	5,500	49,940.00	0.09
375	003007	直真科技	2,000	49,900.00	0.09
376	002395	双象股份	3,300	49,599.00	0.09
377	300407	凯发电气	6,500	49,400.00	0.08
378	300493	润欣科技	6,100	49,349.00	0.08
379	300302	同有科技	5,400	49,302.00	0.08
380	000526	学大教育	800	49,280.00	0.08
381	001360	南矿集团	4,000	49,160.00	0.08
381	300532	今天国际	4,000	49,160.00	0.08
382	600727	鲁北化工	7,800	49,140.00	0.08
383	300151	昌红科技	3,100	49,042.00	0.08
384	600206	有研新材	5,500	48,950.00	0.08
385	300817	双飞集团	4,600	48,852.00	0.08
386	301120	新特电气	4,700	48,833.00	0.08
387	301111	粤万年青	3,500	48,825.00	0.08
388	300378	鼎捷软件	3,000	48,810.00	0.08
389	300632	光莆股份	4,900	48,755.00	0.08
390	605199	葫芦娃	5,000	48,750.00	0.08
391	002911	佛燃能源	5,300	48,442.00	0.08
392	603015	弘讯科技	6,400	48,384.00	0.08
393	301252	同星科技	1,600	48,176.00	0.08
394	603324	盛剑科技	1,800	48,078.00	0.08

395	301162	国能日新	1,100	47,916.00	0.08
396	600986	浙文互联	11,400	47,880.00	0.08
397	002357	富临运业	9,300	47,709.00	0.08
398	300566	激智科技	3,400	47,566.00	0.08
399	301020	密封科技	3,000	47,460.00	0.08
400	001268	联合精密	2,800	47,404.00	0.08
401	600697	欧亚集团	4,700	47,235.00	0.08
402	600557	康缘药业	3,000	47,100.00	0.08
403	000420	吉林化纤	14,900	47,084.00	0.08
404	000529	广弘控股	8,000	47,040.00	0.08
405	600586	金晶科技	8,100	46,980.00	0.08
406	300690	双一科技	2,500	46,975.00	0.08
407	300602	飞荣达	3,100	46,841.00	0.08
408	300265	通光线缆	6,700	46,766.00	0.08
409	603698	航天工程	3,900	46,683.00	0.08
410	605179	一鸣食品	5,100	46,563.00	0.08
411	300683	海特生物	2,200	46,552.00	0.08
412	603085	天成自控	5,200	46,488.00	0.08
413	002838	道恩股份	5,100	46,206.00	0.08
414	300120	经纬辉开	8,900	46,191.00	0.08
415	002957	科瑞技术	3,400	46,104.00	0.08
416	300991	创益通	2,900	46,081.00	0.08
417	300772	运达股份	4,800	46,080.00	0.08
418	603168	莎普爱思	6,100	45,933.00	0.08
419	300976	达瑞电子	1,000	45,850.00	0.08
420	300400	劲拓股份	4,000	45,760.00	0.08
421	603332	苏州龙杰	6,200	45,694.00	0.08
422	605100	华丰股份	3,900	45,357.00	0.08
423	300658	延江股份	10,700	45,154.00	0.08
424	002574	明牌珠宝	10,800	45,144.00	0.08
425	000014	沙河股份	4,700	44,979.00	0.08
426	000531	穗恒运 A	8,400	44,940.00	0.08
426	300039	上海凯宝	8,400	44,940.00	0.08
427	000779	甘咨询	6,400	44,864.00	0.08
428	603558	健盛集团	4,500	44,775.00	0.08
429	301288	清研环境	4,000	44,640.00	0.08
430	603681	永冠新材	3,500	44,625.00	0.08
431	000810	创维数字	5,200	44,616.00	0.08
432	301222	浙江恒威	1,800	44,568.00	0.08
433	300922	天秦装备	3,400	44,166.00	0.08
434	002733	雄韬股份	4,100	44,157.00	0.08
435	603112	华翔股份	4,200	44,142.00	0.08
436	600071	凤凰光学	2,700	44,091.00	0.08

437	002095	生意宝	3,600	44,064.00	0.08
437	603353	和顺石油	3,400	44,064.00	0.08
438	300439	美康生物	4,800	43,968.00	0.08
439	300722	新余国科	2,200	43,956.00	0.08
440	605305	中际联合	1,700	43,843.00	0.08
441	600888	新疆众和	6,200	43,834.00	0.08
442	003005	竞业达	2,100	43,764.00	0.08
443	300018	中元股份	9,500	43,700.00	0.08
444	001299	美能能源	3,700	43,660.00	0.08
445	603738	泰晶科技	3,200	43,648.00	0.08
446	000421	南京公用	9,800	43,512.00	0.07
447	301382	蜂助手	2,400	43,416.00	0.07
448	600354	敦煌种业	9,100	43,407.00	0.07
449	300818	耐普矿机	1,700	43,350.00	0.07
450	601121	宝地矿业	7,600	43,244.00	0.07
451	002103	广博股份	8,700	43,152.00	0.07
452	688322	奥比中光	1,613	43,083.23	0.07
453	601789	宁波建工	11,700	43,056.00	0.07
454	300403	汉字集团	6,300	43,029.00	0.07
455	601609	金田股份	7,600	43,016.00	0.07
456	688177	百奥泰	2,035	42,979.20	0.07
457	300484	蓝海华腾	3,100	42,749.00	0.07
458	603739	蔚蓝生物	3,300	42,636.00	0.07
459	600318	新力金融	6,700	42,478.00	0.07
460	000715	中兴商业	8,900	42,364.00	0.07
461	603217	元利科技	3,000	42,300.00	0.07
462	003017	大洋生物	2,600	42,276.00	0.07
463	300421	力星股份	4,600	42,182.00	0.07
464	300200	高盟新材	5,400	42,012.00	0.07
465	000791	甘肃能源	6,800	41,956.00	0.07
466	002051	中工国际	6,000	41,760.00	0.07
467	603823	百合花	4,300	41,581.00	0.07
468	600838	上海九百	7,700	41,426.00	0.07
469	001339	智微智能	1,500	41,415.00	0.07
470	002774	快意电梯	6,500	41,275.00	0.07
471	603717	天域生态	6,800	41,208.00	0.07
472	300007	汉威科技	3,000	41,160.00	0.07
473	688519	南亚新材	1,604	41,014.28	0.07
474	688136	科兴制药	2,434	40,793.84	0.07
475	300801	泰和科技	2,700	40,635.00	0.07
476	002749	国光股份	2,700	40,608.00	0.07
477	300196	长海股份	4,000	40,520.00	0.07
478	301093	华兰股份	2,100	40,446.00	0.07

479	603186	华正新材	1,700	40,426.00	0.07
480	600810	神马股份	6,500	40,300.00	0.07
481	300981	中红医疗	4,200	40,194.00	0.07
482	601089	福元医药	2,900	40,165.00	0.07
483	002022	科华生物	7,100	40,115.00	0.07
484	600882	妙可蓝多	3,200	39,904.00	0.07
485	000017	深中华 A	6,700	39,865.00	0.07
486	002369	卓翼科技	10,800	39,852.00	0.07
487	002761	浙江建投	5,100	39,831.00	0.07
488	601188	龙江交通	13,500	39,825.00	0.07
489	600127	金健米业	6,600	39,798.00	0.07
490	001256	炜冈科技	2,900	39,788.00	0.07
491	301258	富士莱	1,600	39,776.00	0.07
492	300261	雅本化学	7,500	39,750.00	0.07
493	300787	海能实业	3,200	39,712.00	0.07
494	002615	哈尔斯	6,400	39,680.00	0.07
495	300618	寒锐钴业	1,500	39,675.00	0.07
496	600769	祥龙电业	6,300	39,627.00	0.07
497	300415	伊之密	1,900	39,482.00	0.07
498	600962	国投中鲁	3,300	39,468.00	0.07
499	300610	晨化股份	4,500	39,465.00	0.07
500	300819	聚杰微纤	3,400	39,338.00	0.07
501	300160	秀强股份	8,400	39,312.00	0.07
502	300694	蠡湖股份	4,600	39,146.00	0.07
503	603595	东尼电子	1,900	39,121.00	0.07
504	688626	翔宇医疗	1,232	39,103.68	0.07
505	002952	亚世光电	1,900	39,045.00	0.07
506	605286	同力日升	1,600	38,928.00	0.07
507	300908	仲景食品	1,400	38,892.00	0.07
508	300485	赛升药业	6,300	38,682.00	0.07
509	002825	纳尔股份	6,200	38,626.00	0.07
510	688165	埃夫特	4,936	38,599.52	0.07
511	301007	德迈仕	3,300	38,544.00	0.07
512	300306	远方信息	4,100	38,417.00	0.07
513	002772	众兴菌业	6,400	38,336.00	0.07
514	000707	双环科技	5,600	38,304.00	0.07
515	002882	金龙羽	2,500	38,200.00	0.07
516	002582	好想你	7,100	38,127.00	0.07
516	600278	东方创业	7,100	38,127.00	0.07
517	300252	金信诺	6,100	38,125.00	0.07
518	002190	成飞集成	2,700	38,124.00	0.07
519	003010	若羽臣	3,600	38,088.00	0.07
520	300446	航天智造	3,200	38,080.00	0.07

521	688079	美迪凯	5,127	38,042.34	0.07
522	301091	深城交	1,400	37,996.00	0.07
523	002302	西部建设	7,300	37,960.00	0.07
524	300490	华自科技	5,300	37,948.00	0.07
525	603183	建研院	11,800	37,878.00	0.07
526	300860	锋尚文化	1,800	37,872.00	0.07
527	600736	苏州高新	9,100	37,856.00	0.07
528	600724	宁波富达	10,400	37,752.00	0.06
529	300322	硕贝德	4,500	37,710.00	0.06
530	300745	欣锐科技	2,600	37,596.00	0.06
531	600458	时代新材	3,700	37,370.00	0.06
532	600826	兰生股份	6,920	37,229.60	0.06
533	002083	孚日股份	8,800	37,224.00	0.06
534	600229	城市传媒	5,400	37,206.00	0.06
535	301328	维峰电子	1,000	36,910.00	0.06
536	300075	数字政通	2,500	36,875.00	0.06
537	301256	华融化学	6,000	36,840.00	0.06
538	603982	泉峰汽车	4,600	36,800.00	0.06
539	600619	海立股份	7,100	36,707.00	0.06
540	688105	诺唯赞	1,830	36,618.30	0.06
541	600714	金瑞矿业	5,100	36,618.00	0.06
542	300950	德固特	2,400	36,576.00	0.06
543	300913	兆龙互连	1,100	36,542.00	0.06
544	300093	金刚光伏	2,600	36,530.00	0.06
545	002728	特一药业	4,700	36,425.00	0.06
546	002041	登海种业	4,500	36,360.00	0.06
547	688506	百利天恒	200	36,280.00	0.06
548	002148	北纬科技	7,800	36,270.00	0.06
549	002536	飞龙股份	3,800	36,176.00	0.06
550	600185	格力地产	8,500	36,125.00	0.06
551	300657	弘信电子	2,400	36,048.00	0.06
552	001373	翔腾新材	1,400	35,826.00	0.06
553	301408	华人健康	3,500	35,805.00	0.06
554	300945	曼卡龙	4,000	35,640.00	0.06
555	002682	龙洲股份	10,000	35,600.00	0.06
556	301098	金埔园林	4,700	35,579.00	0.06
557	603016	新宏泰	2,300	35,558.00	0.06
558	300768	迪普科技	3,000	35,550.00	0.06
559	000993	闽东电力	3,700	35,483.00	0.06
560	300445	康斯特	2,200	35,420.00	0.06
561	300106	西部矿业	5,900	35,400.00	0.06
562	300967	晓鸣股份	3,900	35,373.00	0.06
563	300858	科拓生物	2,400	35,328.00	0.06

564	301379	天山电子	1,900	35,036.00	0.06
565	600513	联环药业	4,300	34,873.00	0.06
566	002873	新天药业	4,200	34,860.00	0.06
567	688020	方邦股份	1,043	34,794.48	0.06
568	002393	力生制药	2,200	34,782.00	0.06
569	002788	鹭燕医药	4,400	34,672.00	0.06
570	301012	扬电科技	1,400	34,664.00	0.06
571	300074	华平股份	10,600	34,662.00	0.06
572	300718	长盛轴承	2,500	34,550.00	0.06
573	301302	华如科技	2,000	34,500.00	0.06
574	603211	晋拓股份	2,500	34,275.00	0.06
575	300968	格林精密	3,700	34,262.00	0.06
576	300650	太龙股份	3,200	34,016.00	0.06
577	301116	益客食品	3,800	33,934.00	0.06
578	002059	云南旅游	7,200	33,912.00	0.06
579	002333	罗普斯金	6,300	33,831.00	0.06
580	002931	锋龙股份	3,300	33,627.00	0.06
581	300675	建科院	3,000	33,600.00	0.06
582	603230	内蒙新华	2,900	33,466.00	0.06
583	603286	日盈电子	2,100	33,453.00	0.06
584	300881	盛德鑫泰	1,300	33,397.00	0.06
585	002140	东华科技	4,300	33,325.00	0.06
586	600630	龙头股份	4,100	33,128.00	0.06
587	000801	四川九洲	3,300	33,000.00	0.06
588	603139	康惠制药	2,600	32,994.00	0.06
589	300547	川环科技	2,000	32,700.00	0.06
590	000561	烽火电子	5,100	32,691.00	0.06
591	600782	新钢股份	9,800	32,536.00	0.06
592	002830	名雕股份	3,300	32,472.00	0.06
593	600638	新黄浦	8,600	32,422.00	0.06
594	600081	东风科技	3,700	32,375.00	0.06
595	000823	超声电子	3,800	32,338.00	0.06
596	603013	亚普股份	2,400	32,328.00	0.06
597	300022	吉峰科技	9,100	32,305.00	0.06
598	002801	微光股份	1,700	32,232.00	0.06
599	300776	帝尔激光	700	32,172.00	0.06
600	600818	中路股份	2,300	32,154.00	0.06
601	688116	天奈科技	1,390	32,081.20	0.06
602	002235	安妮股份	8,100	32,076.00	0.06
603	001331	胜通能源	2,300	31,855.00	0.05
604	688101	三达膜	2,792	31,772.96	0.05
605	688566	吉贝尔	1,412	31,770.00	0.05
606	601595	上海电影	1,600	31,648.00	0.05

607	301177	迪阿股份	1,700	31,620.00	0.05
608	001201	东瑞股份	1,700	31,518.00	0.05
609	688737	中自科技	1,939	31,411.80	0.05
610	001216	华瓷股份	2,500	31,400.00	0.05
611	300083	创世纪	5,100	31,263.00	0.05
612	603988	中电电机	4,000	31,240.00	0.05
613	002900	哈三联	3,400	31,212.00	0.05
614	300550	和仁科技	3,300	31,185.00	0.05
615	603151	邦基科技	2,700	31,158.00	0.05
616	002082	万邦德	7,400	31,154.00	0.05
617	000721	西安饮食	4,500	31,095.00	0.05
617	300906	日月明	1,500	31,095.00	0.05
618	300800	力合科技	3,000	31,080.00	0.05
619	000029	深深房 A	2,900	30,827.00	0.05
620	300593	新雷能	3,100	30,814.00	0.05
621	002324	普利特	3,600	30,780.00	0.05
622	300380	安硕信息	2,000	30,720.00	0.05
622	301217	铜冠铜箔	3,200	30,720.00	0.05
623	002149	西部材料	2,200	30,712.00	0.05
624	000919	金陵药业	4,900	30,674.00	0.05
625	600649	城投控股	9,200	30,544.00	0.05
626	601512	中新集团	4,000	30,480.00	0.05
627	601116	三江购物	4,000	30,440.00	0.05
628	003019	宸展光电	1,200	30,396.00	0.05
629	688006	杭可科技	1,740	30,363.00	0.05
630	301337	亚华电子	1,100	30,338.00	0.05
631	300916	朗特智能	1,200	30,216.00	0.05
632	600665	天地源	13,600	30,192.00	0.05
633	600874	创业环保	5,400	30,186.00	0.05
634	603380	易德龙	1,500	30,120.00	0.05
635	301263	泰恩康	2,400	30,072.00	0.05
636	603508	思维列控	1,600	30,000.00	0.05
637	002552	宝鼎科技	2,300	29,946.00	0.05
638	603199	九华旅游	1,000	29,800.00	0.05
639	300549	优德精密	2,200	29,744.00	0.05
640	605162	新中港	4,100	29,643.00	0.05
641	300542	新晨科技	2,400	29,496.00	0.05
642	000035	中国天楹	6,500	29,445.00	0.05
643	605389	长龄液压	1,400	29,386.00	0.05
644	300248	新开普	4,500	29,205.00	0.05
645	300572	安车检测	2,500	29,050.00	0.05
646	601133	柏诚股份	2,700	28,863.00	0.05
647	688179	阿拉丁	2,975	28,768.25	0.05

648	603968	醋化股份	2,900	28,768.00	0.05
649	300927	江天化学	2,100	28,707.00	0.05
650	002378	章源钨业	5,000	28,700.00	0.05
651	301149	隆华新材	3,100	28,644.00	0.05
652	300749	顶固集创	5,400	28,620.00	0.05
653	002093	国脉科技	4,700	28,529.00	0.05
654	603648	畅联股份	3,600	28,512.00	0.05
655	300664	鹏鹞环保	6,400	28,480.00	0.05
656	300905	宝丽迪	1,000	28,410.00	0.05
657	603666	亿嘉和	1,800	28,404.00	0.05
658	301008	宏昌科技	1,620	28,285.20	0.05
659	002413	雷科防务	7,900	28,282.00	0.05
660	000705	浙江震元	4,000	28,280.00	0.05
661	002521	齐峰新材	2,400	28,200.00	0.05
662	301186	超达装备	900	28,170.00	0.05
663	300351	永贵电器	1,900	28,120.00	0.05
664	301156	美农生物	2,300	28,106.00	0.05
665	688238	和元生物	6,067	28,090.21	0.05
666	300121	阳谷华泰	3,600	28,080.00	0.05
667	001333	光华股份	1,700	28,050.00	0.05
668	300931	通用电梯	5,100	27,948.00	0.05
669	300246	宝莱特	4,600	27,830.00	0.05
670	300184	力源信息	6,000	27,780.00	0.05
671	300353	东土科技	3,800	27,778.00	0.05
672	600966	博汇纸业	5,800	27,724.00	0.05
673	000020	深华发 A	2,800	27,720.00	0.05
674	300079	数码视讯	6,800	27,608.00	0.05
675	300443	金雷股份	1,800	27,594.00	0.05
676	603048	浙江黎明	1,900	27,588.00	0.05
677	002300	太阳电缆	5,200	27,456.00	0.05
678	002298	中电兴发	6,200	27,404.00	0.05
679	600222	太龙药业	6,500	27,300.00	0.05
680	000521	长虹美菱	3,600	27,288.00	0.05
681	603319	湘油泵	1,700	27,183.00	0.05
682	688419	耐科装备	908	27,167.36	0.05
683	300537	广信材料	1,700	27,098.00	0.05
684	300986	志特新材	4,000	27,080.00	0.05
685	600880	博瑞传播	7,200	27,072.00	0.05
686	300416	苏试试验	2,100	27,006.00	0.05
687	000632	三木集团	10,000	27,000.00	0.05
688	301265	华新环保	3,400	26,894.00	0.05
689	300314	戴维医疗	2,600	26,884.00	0.05
690	002923	润都股份	2,900	26,854.00	0.05

691	300062	中能电气	5,500	26,785.00	0.05
692	300642	透景生命	2,300	26,772.00	0.05
693	300276	三丰智能	7,600	26,752.00	0.05
694	003029	吉大正元	1,500	26,685.00	0.05
695	002057	中钢天源	3,800	26,600.00	0.05
696	300687	赛意信息	1,900	26,448.00	0.05
697	300481	濮阳惠成	1,900	26,220.00	0.05
698	603308	应流股份	2,100	26,082.00	0.04
699	002365	永安药业	3,600	25,992.00	0.04
700	601226	华电重工	5,300	25,970.00	0.04
701	002553	南方精工	2,800	25,956.00	0.04
702	301192	泰祥股份	1,500	25,890.00	0.04
703	600463	空港股份	3,400	25,874.00	0.04
704	002403	爱仕达	3,900	25,818.00	0.04
705	688597	煜邦电力	3,703	25,772.88	0.04
706	600698	湖南天雁	7,600	25,764.00	0.04
707	600058	五矿发展	3,900	25,740.00	0.04
708	000548	湖南投资	6,400	25,728.00	0.04
709	603920	世运电路	1,300	25,662.00	0.04
710	301332	德尔玛	2,900	25,636.00	0.04
711	301309	万得凯	1,000	25,560.00	0.04
712	002777	久远银海	1,700	25,483.00	0.04
713	300563	神宇股份	1,000	25,450.00	0.04
714	603701	德宏股份	2,400	25,392.00	0.04
715	002826	易明医药	3,200	25,376.00	0.04
716	688247	宣泰医药	3,085	25,358.70	0.04
717	301303	真兰仪表	2,200	25,344.00	0.04
718	688199	久日新材	1,885	25,259.00	0.04
719	300655	晶瑞电材	3,500	25,200.00	0.04
720	002805	丰元股份	2,400	25,128.00	0.04
721	002327	富安娜	2,500	25,125.00	0.04
722	300519	新光药业	2,300	24,955.00	0.04
723	301367	怡和嘉业	400	24,880.00	0.04
724	300328	宜安科技	5,800	24,824.00	0.04
725	603773	沃格光电	1,200	24,780.00	0.04
726	688010	福光股份	1,589	24,740.73	0.04
727	300766	每日互动	2,500	24,725.00	0.04
728	300629	新劲刚	1,400	24,724.00	0.04
729	000501	武商集团	3,700	24,679.00	0.04
730	300995	奇德新材	1,600	24,672.00	0.04
731	603177	德创环保	3,500	24,605.00	0.04
732	002963	豪尔赛	2,400	24,552.00	0.04
733	300822	贝仕达克	2,100	24,486.00	0.04

734	002949	华阳国际	2,600	24,466.00	0.04
735	002548	金新农	6,000	24,360.00	0.04
736	600228	返利科技	5,000	24,300.00	0.04
737	300299	富春股份	7,000	24,290.00	0.04
737	301235	华康医疗	1,400	24,290.00	0.04
738	002169	智光电气	5,500	24,255.00	0.04
739	002184	海得控制	2,700	24,246.00	0.04
740	301298	东利机械	1,900	24,225.00	0.04
741	688037	芯源微	272	24,208.00	0.04
742	002090	金智科技	2,800	24,192.00	0.04
743	605339	南侨食品	1,700	24,174.00	0.04
744	301209	联合化学	1,100	24,090.00	0.04
745	002907	华森制药	1,900	23,978.00	0.04
746	002983	芯瑞达	1,439	23,959.35	0.04
747	603768	常青股份	2,100	23,814.00	0.04
748	300470	中密控股	700	23,667.00	0.04
749	000852	石化机械	4,400	23,584.00	0.04
750	300254	仟源医药	3,000	23,580.00	0.04
751	002609	捷顺科技	3,100	23,498.00	0.04
752	300112	万讯自控	3,400	23,460.00	0.04
753	300291	百纳千成	5,500	23,430.00	0.04
754	301006	迈拓股份	2,000	23,380.00	0.04
755	300884	狄耐克	2,700	23,274.00	0.04
756	603860	中公高科	800	23,200.00	0.04
757	002186	全聚德	2,700	23,139.00	0.04
758	300440	运达科技	4,400	23,100.00	0.04
759	002795	永和智控	6,200	23,064.00	0.04
760	300697	电工合金	2,100	22,974.00	0.04
761	002767	先锋电子	1,900	22,895.00	0.04
762	603258	电魂网络	1,400	22,610.00	0.04
763	300239	东宝生物	4,800	22,608.00	0.04
764	605399	晨光新材	2,100	22,575.00	0.04
765	300483	首华燃气	3,100	22,413.00	0.04
766	002478	常宝股份	4,500	22,410.00	0.04
767	603727	博迈科	1,700	22,372.00	0.04
768	603815	交建股份	3,900	22,308.00	0.04
769	000948	南天信息	1,800	22,230.00	0.04
770	002662	京威股份	7,300	22,192.00	0.04
771	688557	兰剑智能	955	22,136.90	0.04
772	300603	立昂技术	3,200	22,112.00	0.04
773	300923	研奥股份	1,300	22,100.00	0.04
774	002449	国星光电	3,100	22,072.00	0.04
775	688699	明微电子	695	22,066.25	0.04

776	301345	涛涛车业	400	22,040.00	0.04
777	300926	博俊科技	1,100	22,022.00	0.04
778	300436	广生堂	1,400	21,994.00	0.04
779	000488	晨鸣纸业	6,300	21,798.00	0.04
780	301268	铭利达	1,400	21,770.00	0.04
781	301198	喜悦智行	2,700	21,627.00	0.04
782	300864	南大环境	1,100	21,560.00	0.04
783	600509	天富能源	3,900	21,489.00	0.04
784	002868	绿康生化	1,600	21,280.00	0.04
785	300279	和晶科技	5,100	21,267.00	0.04
786	600429	三元股份	5,700	21,261.00	0.04
787	002810	山东赫达	1,800	21,204.00	0.04
788	300972	万辰集团	1,000	21,130.00	0.04
789	600292	远达环保	4,500	21,105.00	0.04
790	000031	大悦城	9,000	21,060.00	0.04
791	301158	德石股份	1,700	21,029.00	0.04
792	301319	唯特偶	700	21,021.00	0.04
793	000862	银星能源	4,400	20,988.00	0.04
794	603601	再升科技	7,600	20,976.00	0.04
795	002292	奥飞娱乐	3,500	20,930.00	0.04
796	301100	风光股份	1,600	20,784.00	0.04
797	688226	威腾电气	1,188	20,766.24	0.04
798	001209	洪兴股份	1,500	20,700.00	0.04
799	002691	冀凯股份	4,700	20,633.00	0.04
800	002283	天润工业	4,800	20,592.00	0.04
801	000570	苏常柴 A	4,600	20,562.00	0.04
802	000920	沃顿科技	2,800	20,524.00	0.04
803	300940	南极光	1,600	20,384.00	0.04
804	300513	恒实科技	2,500	20,375.00	0.04
805	301216	万凯新材	1,800	20,142.00	0.03
806	600785	新华百货	1,500	20,130.00	0.03
807	300516	久之洋	700	20,097.00	0.03
808	300435	中泰股份	1,700	20,009.00	0.03
809	605298	必得科技	2,400	19,920.00	0.03
810	301283	聚胶股份	700	19,859.00	0.03
811	002922	伊戈尔	900	19,674.00	0.03
812	002928	华夏航空	3,100	19,654.00	0.03
813	688663	新风光	843	19,616.61	0.03
814	300960	通业科技	1,300	19,591.00	0.03
815	600184	光电股份	2,300	19,573.00	0.03
816	300402	宝色股份	1,500	19,470.00	0.03
817	301296	新巨丰	2,700	19,467.00	0.03
818	688135	利扬芯片	1,212	19,416.24	0.03

819	002061	浙江交科	5,300	19,345.00	0.03
820	301199	迈赫股份	800	19,344.00	0.03
821	603928	兴业股份	2,470	19,340.10	0.03
822	000037	深南电 A	2,200	19,250.00	0.03
822	600617	国新能源	7,700	19,250.00	0.03
823	000935	四川双马	1,600	19,216.00	0.03
824	002617	露笑科技	4,000	19,200.00	0.03
825	603239	浙江仙通	1,400	19,194.00	0.03
826	603214	爱婴室	1,700	19,193.00	0.03
827	301211	亨迪药业	1,300	18,993.00	0.03
828	002492	恒基达鑫	4,100	18,860.00	0.03
829	000856	冀东装备	3,100	18,848.00	0.03
830	603080	新疆火炬	1,400	18,844.00	0.03
831	300515	三德科技	1,900	18,753.00	0.03
832	603330	天洋新材	3,900	18,681.00	0.03
833	603153	上海建科	1,100	18,601.00	0.03
834	600055	万东医疗	1,500	18,525.00	0.03
835	605378	野马电池	1,200	18,504.00	0.03
836	003027	同兴环保	1,500	18,450.00	0.03
837	603256	宏和科技	2,600	18,356.00	0.03
838	688053	思科瑞	739	18,194.18	0.03
839	688277	天智航	2,341	18,119.34	0.03
840	301117	佳缘科技	700	18,060.00	0.03
841	000576	甘化科工	3,000	18,000.00	0.03
842	688201	信安世纪	1,513	17,868.53	0.03
843	600137	浪莎股份	1,500	17,805.00	0.03
844	605289	罗曼股份	700	17,780.00	0.03
845	301228	实朴检测	1,900	17,765.00	0.03
846	603901	永创智能	2,500	17,725.00	0.03
847	603162	海通发展	1,900	17,670.00	0.03
848	300611	美力科技	2,300	17,526.00	0.03
849	002649	博彦科技	2,200	17,512.00	0.03
850	301246	宏源药业	1,300	17,498.00	0.03
851	002272	川润股份	3,900	17,472.00	0.03
852	600560	金自天正	1,300	17,420.00	0.03
853	300046	台基股份	1,100	17,380.00	0.03
854	603066	音飞储存	1,900	17,347.00	0.03
855	603682	锦和商管	4,300	17,157.00	0.03
856	603095	越剑智能	1,300	17,043.00	0.03
857	003013	地铁设计	1,200	17,016.00	0.03
858	688011	新光光电	1,122	16,998.30	0.03
859	002658	雪迪龙	3,300	16,929.00	0.03
859	605580	恒盛能源	1,900	16,929.00	0.03

860	300539	横河精密	2,100	16,905.00	0.03
861	603960	克来机电	800	16,880.00	0.03
862	002344	海宁皮城	5,500	16,830.00	0.03
863	300263	隆华科技	3,000	16,800.00	0.03
864	002686	亿利达	4,000	16,760.00	0.03
865	605566	福莱茵特	1,100	16,753.00	0.03
866	002927	泰永长征	1,400	16,716.00	0.03
867	600722	金牛化工	4,400	16,676.00	0.03
868	002734	利民股份	2,400	16,536.00	0.03
869	600780	通宝能源	2,800	16,520.00	0.03
870	002981	朝阳科技	900	16,479.00	0.03
871	300848	美瑞新材	1,000	16,440.00	0.03
872	600220	ST 阳光	44,300	16,391.00	0.03
873	688026	洁特生物	1,643	16,364.28	0.03
874	002886	沃特股份	1,200	16,344.00	0.03
875	300448	浩云科技	3,900	16,341.00	0.03
876	688478	晶升股份	560	16,307.20	0.03
877	001212	中旗新材	800	16,240.00	0.03
878	000601	韶能股份	4,400	16,236.00	0.03
879	001324	长青科技	1,000	16,200.00	0.03
880	301151	冠龙节能	1,100	16,192.00	0.03
881	603898	好莱客	2,200	16,170.00	0.03
882	600979	广安爱众	4,800	16,128.00	0.03
883	300970	华绿生物	1,400	16,058.00	0.03
884	688677	海泰新光	409	16,045.07	0.03
885	600113	浙江东日	2,100	16,002.00	0.03
886	603776	永安行	1,600	15,872.00	0.03
887	301067	显盈科技	800	15,768.00	0.03
888	603839	安正时尚	3,600	15,732.00	0.03
889	002735	王子新材	1,600	15,728.00	0.03
890	001316	润贝航科	500	15,655.00	0.03
891	300639	凯普生物	3,400	15,640.00	0.03
892	002265	建设工业	1,800	15,534.00	0.03
893	600987	航民股份	2,200	15,532.00	0.03
894	002448	中原内配	2,700	15,498.00	0.03
895	603933	睿能科技	1,200	15,432.00	0.03
896	603998	方盛制药	1,500	15,405.00	0.03
897	301548	崇德科技	290	15,393.20	0.03
898	600053	九鼎投资	1,100	15,257.00	0.03
899	603977	国泰集团	1,500	15,255.00	0.03
900	300414	中光防雷	2,300	15,203.00	0.03
901	603206	嘉环科技	1,200	15,156.00	0.03
902	301139	元道通信	700	15,057.00	0.03

903	605066	天正电气	2,700	15,039.00	0.03
904	603607	京华激光	1,200	15,012.00	0.03
905	000593	德龙汇能	3,200	14,912.00	0.03
906	301419	阿莱德	600	14,898.00	0.03
907	301388	欣灵电气	600	14,826.00	0.03
908	000533	顺钠股份	4,500	14,805.00	0.03
909	300102	乾照光电	2,300	14,766.00	0.03
910	002890	弘宇股份	1,820	14,596.40	0.03
911	300247	融捷健康	6,000	14,580.00	0.03
911	688507	索辰科技	300	14,580.00	0.03
912	688286	敏芯股份	306	14,565.60	0.03
913	002088	鲁阳节能	1,200	14,508.00	0.02
914	001366	播恩集团	1,300	14,430.00	0.02
915	002743	富煌钢构	3,900	14,391.00	0.02
916	301550	斯菱股份	300	14,373.00	0.02
917	003023	彩虹集团	900	14,355.00	0.02
918	301052	果麦文化	700	14,350.00	0.02
919	300173	福能东方	3,800	14,326.00	0.02
920	300129	泰胜风能	2,100	14,322.00	0.02
921	600668	尖峰集团	1,800	14,310.00	0.02
922	301077	星华新材	800	14,288.00	0.02
923	301059	金三江	1,600	14,256.00	0.02
924	688038	中科通达	1,496	14,241.92	0.02
925	688533	上声电子	549	14,202.63	0.02
926	603221	爱丽家居	1,600	14,192.00	0.02
927	000881	中广核技	2,200	14,168.00	0.02
928	600876	凯盛新能	1,500	14,160.00	0.02
929	001231	农心科技	1,000	14,070.00	0.02
930	603917	合力科技	1,300	14,066.00	0.02
931	000058	深赛格	2,600	13,962.00	0.02
932	603238	诺邦股份	1,400	13,944.00	0.02
933	605189	富春染织	1,300	13,858.00	0.02
934	001282	三联锻造	500	13,855.00	0.02
935	301429	森泰股份	900	13,770.00	0.02
936	603615	茶花股份	1,300	13,689.00	0.02
937	603126	中材节能	2,500	13,625.00	0.02
938	002091	江苏国泰	2,000	13,620.00	0.02
939	603042	华脉科技	1,300	13,572.00	0.02
940	300920	润阳科技	900	13,536.00	0.02
941	300389	艾比森	1,100	13,508.00	0.02
942	601515	东峰集团	3,700	13,505.00	0.02
943	002836	新宏泽	2,300	13,501.00	0.02
944	603798	康普顿	1,600	13,472.00	0.02

945	688267	中触媒	675	13,405.50	0.02
946	688302	海创药业	568	13,382.08	0.02
947	300984	金沃股份	600	13,314.00	0.02
948	300712	永福股份	600	13,050.00	0.02
949	300870	欧陆通	300	13,014.00	0.02
950	600746	江苏索普	2,200	12,958.00	0.02
951	300164	通源石油	3,700	12,950.00	0.02
952	002347	泰尔股份	3,400	12,818.00	0.02
953	603612	索通发展	1,000	12,760.00	0.02
954	600389	江山股份	900	12,699.00	0.02
955	605016	百龙创园	620	12,629.40	0.02
956	000913	钱江摩托	800	12,608.00	0.02
957	300932	三友联众	1,300	12,519.00	0.02
958	300577	开润股份	600	12,498.00	0.02
959	002706	良信股份	1,800	12,348.00	0.02
960	300824	北鼎股份	1,700	12,325.00	0.02
961	688678	福立旺	1,135	12,292.05	0.02
962	002989	中天精装	800	12,168.00	0.02
963	300211	亿通科技	2,300	12,167.00	0.02
964	301078	孩子王	2,400	12,144.00	0.02
965	688182	灿勤科技	914	12,101.36	0.02
966	301270	汉仪股份	500	12,065.00	0.02
967	002075	沙钢股份	3,200	12,064.00	0.02
968	603729	龙韵股份	900	11,934.00	0.02
969	300997	欢乐家	1,000	11,820.00	0.02
970	605055	迎丰股份	2,900	11,803.00	0.02
971	300535	达威股份	1,000	11,800.00	0.02
972	300723	一品红	600	11,790.00	0.02
972	301102	兆讯传媒	1,000	11,790.00	0.02
972	600716	凤凰股份	4,500	11,790.00	0.02
973	603938	三孚股份	1,000	11,750.00	0.02
974	002255	海陆重工	2,400	11,736.00	0.02
975	001287	中电港	700	11,571.00	0.02
976	001314	亿道信息	300	11,529.00	0.02
977	603696	安记食品	1,700	11,526.00	0.02
978	603918	金桥信息	1,100	11,495.00	0.02
979	300517	海波重科	1,300	11,141.00	0.02
980	300456	赛微电子	700	11,109.00	0.02
980	605365	立达信	700	11,109.00	0.02
981	002828	贝肯能源	1,300	11,102.00	0.02
982	601086	国芳集团	3,000	11,070.00	0.02
983	301389	隆扬电子	700	11,060.00	0.02
984	002675	东诚药业	900	11,034.00	0.02

985	301311	昆船智能	600	11,028.00	0.02
986	001222	源飞宠物	900	11,025.00	0.02
987	301073	君亭酒店	600	10,920.00	0.02
988	688307	中润光学	515	10,655.35	0.02
989	002899	英派斯	800	10,536.00	0.02
990	002242	九阳股份	1,000	10,480.00	0.02
991	300194	福安药业	2,800	10,472.00	0.02
992	688529	豪森智能	776	10,429.44	0.02
993	002458	益生股份	1,200	10,392.00	0.02
994	600865	百大集团	1,600	10,352.00	0.02
995	002412	汉森制药	2,000	10,340.00	0.02
996	301316	慧博云通	700	10,276.00	0.02
997	002644	佛慈制药	1,600	10,272.00	0.02
998	300540	蜀道装备	500	10,180.00	0.02
999	300444	双杰电气	1,600	10,160.00	0.02
1,000	002398	垒知集团	2,700	10,044.00	0.02
1,001	301107	瑜欣电子	400	10,040.00	0.02
1,002	002578	闽发铝业	3,800	9,994.00	0.02
1,003	603329	上海雅仕	900	9,918.00	0.02
1,004	603309	维力医疗	900	9,909.00	0.02
1,005	603697	有友食品	1,700	9,860.00	0.02
1,006	300993	玉马遮阳	1,100	9,834.00	0.02
1,007	603948	建业股份	600	9,768.00	0.02
1,008	688611	杭州柯林	366	9,753.90	0.02
1,009	300845	捷安高科	900	9,747.00	0.02
1,010	605122	四方新材	1,000	9,720.00	0.02
1,011	301310	鑫宏业	400	9,640.00	0.02
1,012	688262	国芯科技	528	9,614.88	0.02
1,013	301323	新莱福	300	9,474.00	0.02
1,014	688209	英集芯	763	9,468.83	0.02
1,015	688606	奥泰生物	200	9,426.00	0.02
1,016	301227	森鹰窗业	500	9,405.00	0.02
1,017	000151	中成股份	900	9,306.00	0.02
1,018	688553	汇宇制药	749	9,302.58	0.02
1,019	603121	华培动力	1,300	9,256.00	0.02
1,020	002843	泰嘉股份	600	9,186.00	0.02
1,021	300710	万隆光电	600	9,102.00	0.02
1,022	301004	嘉益股份	100	9,100.00	0.02
1,023	600973	宝胜股份	2,500	9,025.00	0.02
1,024	002170	芭田股份	1,500	9,015.00	0.02
1,025	603949	雪龙集团	800	9,008.00	0.02
1,026	002912	中新赛克	500	8,860.00	0.02
1,027	002194	武汉凡谷	1,100	8,855.00	0.02

1,028	300795	米奥会展	500	8,765.00	0.02
1,029	003016	欣贺股份	1,400	8,764.00	0.02
1,030	300286	安科瑞	400	8,656.00	0.01
1,031	300876	蒙泰高新	500	8,590.00	0.01
1,032	300786	国林科技	700	8,582.00	0.01
1,033	688369	致远互联	543	8,541.39	0.01
1,034	301577	美信科技	100	8,500.00	0.01
1,035	600551	时代出版	1,200	8,496.00	0.01
1,036	688799	华纳药厂	200	8,486.00	0.01
1,037	600158	中体产业	1,100	8,459.00	0.01
1,038	603661	恒林股份	200	8,442.00	0.01
1,039	300598	诚迈科技	300	8,424.00	0.01
1,040	688377	迪威尔	641	8,397.10	0.01
1,041	605128	上海沿浦	300	8,367.00	0.01
1,042	603810	丰山集团	1,000	8,360.00	0.01
1,043	688579	山大地纬	1,060	8,321.00	0.01
1,044	603808	歌力思	1,300	8,229.00	0.01
1,045	301031	中熔电气	100	8,220.00	0.01
1,046	688767	博拓生物	323	8,097.61	0.01
1,047	301591	肯特股份	219	8,085.48	0.01
1,048	603836	海程邦达	600	8,082.00	0.01
1,049	603078	江化微	600	8,034.00	0.01
1,050	300865	大宏立	500	8,020.00	0.01
1,051	605138	盛泰集团	1,600	8,016.00	0.01
1,052	000062	深圳华强	900	8,010.00	0.01
1,053	688195	腾景科技	326	7,990.26	0.01
1,054	600446	金证股份	800	7,944.00	0.01
1,055	301538	骏鼎达	87	7,936.14	0.01
1,056	300855	图南股份	300	7,932.00	0.01
1,057	688030	山石网科	758	7,921.10	0.01
1,058	603109	神驰机电	600	7,866.00	0.01
1,059	300582	英飞特	900	7,704.00	0.01
1,060	300660	江苏雷利	300	7,656.00	0.01
1,061	600657	信达地产	2,500	7,625.00	0.01
1,062	002154	报喜鸟	1,400	7,616.00	0.01
1,063	301305	朗坤环境	500	7,605.00	0.01
1,064	301233	盛帮股份	200	7,604.00	0.01
1,065	688584	上海合晶	477	7,569.99	0.01
1,066	600488	津药药业	2,200	7,546.00	0.01
1,067	000059	华锦股份	1,800	7,542.00	0.01
1,068	688051	佳华科技	453	7,510.74	0.01
1,069	603500	祥和实业	1,100	7,480.00	0.01
1,070	603165	荣晟环保	700	7,434.00	0.01

1,071	603191	望变电气	500	7,400.00	0.01
1,072	300101	振芯科技	500	7,385.00	0.01
1,073	002792	通宇通讯	700	7,308.00	0.01
1,074	300622	博士眼镜	600	7,302.00	0.01
1,075	002763	汇洁股份	1,100	7,293.00	0.01
1,076	603339	四方科技	800	7,256.00	0.01
1,077	001311	多利科技	300	7,254.00	0.01
1,078	300543	朗科智能	900	7,200.00	0.01
1,079	688338	赛科希德	332	7,187.80	0.01
1,080	688306	均普智能	1,770	7,186.20	0.01
1,081	002809	红墙股份	1,000	7,170.00	0.01
1,082	300497	富祥药业	800	7,144.00	0.01
1,083	605180	华生科技	600	7,110.00	0.01
1,084	002561	徐家汇	1,000	6,960.00	0.01
1,085	688087	英科再生	266	6,884.08	0.01
1,086	300726	宏达电子	300	6,840.00	0.01
1,086	603086	先达股份	1,800	6,840.00	0.01
1,087	601999	出版传媒	1,300	6,786.00	0.01
1,088	301333	诺思格	200	6,722.00	0.01
1,089	688258	卓易信息	200	6,680.00	0.01
1,090	002014	永新股份	700	6,636.00	0.01
1,091	300613	富瀚微	200	6,582.00	0.01
1,092	300812	易天股份	300	6,543.00	0.01
1,093	002106	莱宝高科	600	6,540.00	0.01
1,094	600287	ST 舜天	1,800	6,390.00	0.01
1,095	300289	利德曼	1,600	6,160.00	0.01
1,096	688110	东芯股份	322	6,140.54	0.01
1,097	301056	森赫股份	800	6,136.00	0.01
1,098	688207	格灵深瞳	531	6,090.57	0.01
1,099	300055	万邦达	1,500	6,075.00	0.01
1,100	688132	邦彦技术	348	6,037.80	0.01
1,101	000915	华特达因	200	6,032.00	0.01
1,102	301113	雅艺科技	300	5,967.00	0.01
1,103	688636	智明达	261	5,950.80	0.01
1,104	300774	倍杰特	900	5,877.00	0.01
1,105	300342	天银机电	400	5,852.00	0.01
1,106	000698	沈阳化工	1,900	5,776.00	0.01
1,107	688528	秦川物联	721	5,760.79	0.01
1,108	300871	回盛生物	600	5,724.00	0.01
1,109	301257	普蕊斯	200	5,650.00	0.01
1,110	000678	襄阳轴承	1,500	5,640.00	0.01
1,111	002208	合肥城建	1,300	5,603.00	0.01
1,112	603081	大丰实业	600	5,592.00	0.01

1,113	605318	法狮龙	400	5,556.00	0.01
1,114	300933	中辰股份	900	5,535.00	0.01
1,115	300471	厚普股份	700	5,516.00	0.01
1,116	002780	三夫户外	600	5,418.00	0.01
1,117	688345	博力威	320	5,404.80	0.01
1,118	002054	德美化工	1,100	5,401.00	0.01
1,119	601015	陕西黑猫	1,900	5,320.00	0.01
1,120	301377	鼎泰高科	300	5,265.00	0.01
1,121	301081	严牌股份	700	5,250.00	0.01
1,122	301502	华阳智能	138	5,217.78	0.01
1,123	300358	楚天科技	700	5,208.00	0.01
1,124	688382	益方生物	718	5,191.14	0.01
1,125	688068	热景生物	200	5,166.00	0.01
1,126	688229	博睿数据	200	5,144.00	0.01
1,127	300082	奥克股份	1,200	5,112.00	0.01
1,128	603318	水发燃气	900	5,094.00	0.01
1,129	002446	盛路通信	900	5,085.00	0.01
1,130	300791	仙乐健康	200	5,040.00	0.01
1,131	300528	幸福蓝海	800	5,024.00	0.01
1,132	603135	中重科技	400	5,012.00	0.01
1,133	300405	科隆股份	1,400	4,970.00	0.01
1,134	300788	中信出版	200	4,962.00	0.01
1,135	300141	和顺电气	600	4,926.00	0.01
1,136	688695	中创股份	155	4,888.70	0.01
1,137	605011	杭州热电	200	4,866.00	0.01
1,138	688739	成大生物	200	4,848.00	0.01
1,139	600604	市北高新	1,400	4,844.00	0.01
1,140	300779	惠城环保	100	4,840.00	0.01
1,140	603201	常润股份	200	4,840.00	0.01
1,141	603100	川仪股份	200	4,702.00	0.01
1,142	688609	九联科技	529	4,665.78	0.01
1,143	300425	中建环能	1,100	4,631.00	0.01
1,144	301026	浩通科技	200	4,592.00	0.01
1,144	603685	晨丰科技	400	4,592.00	0.01
1,145	300326	凯利泰	1,200	4,560.00	0.01
1,146	002695	煌上煌	700	4,543.00	0.01
1,147	002998	优彩资源	800	4,536.00	0.01
1,148	603326	我乐家居	800	4,448.00	0.01
1,149	605050	福然德	500	4,405.00	0.01
1,150	603325	博隆技术	64	4,353.28	0.01
1,151	603718	海利生物	700	4,319.00	0.01
1,152	003030	祖名股份	300	4,311.00	0.01
1,153	605089	味知香	200	4,268.00	0.01

1,154	000599	青岛双星	1,200	4,236.00	0.01
1,155	301486	致尚科技	100	4,231.00	0.01
1,156	002335	科华数据	200	4,226.00	0.01
1,157	301070	开勒股份	100	4,211.00	0.01
1,158	688505	复旦张江	649	4,153.60	0.01
1,159	688420	美腾科技	200	4,136.00	0.01
1,160	688066	航天宏图	230	4,094.00	0.01
1,161	301398	星源卓镁	100	4,055.00	0.01
1,162	600419	天润乳业	500	3,985.00	0.01
1,163	002995	天地在线	300	3,960.00	0.01
1,164	605068	明新旭腾	300	3,954.00	0.01
1,165	300384	三联虹普	300	3,936.00	0.01
1,166	688118	普元信息	266	3,838.38	0.01
1,167	300631	久吾高科	200	3,830.00	0.01
1,168	600628	新世界	700	3,794.00	0.01
1,169	001330	博纳影业	700	3,787.00	0.01
1,170	688468	科美诊断	597	3,779.01	0.01
1,171	601968	宝钢包装	800	3,744.00	0.01
1,172	002116	中国海诚	400	3,724.00	0.01
1,173	002993	奥海科技	100	3,720.00	0.01
1,174	300512	中亚股份	600	3,552.00	0.01
1,175	603897	长城科技	200	3,510.00	0.01
1,176	603166	福达股份	700	3,430.00	0.01
1,177	601200	上海环境	400	3,400.00	0.01
1,178	603282	亚光股份	200	3,372.00	0.01
1,179	300616	尚品宅配	300	3,318.00	0.01
1,180	603312	西典新能	130	3,294.20	0.01
1,181	605388	均瑶健康	600	3,288.00	0.01
1,182	301157	华塑科技	100	3,260.00	0.01
1,183	603036	如通股份	300	3,195.00	0.01
1,184	600794	保税科技	1,000	3,170.00	0.01
1,185	603082	北自科技	107	3,154.36	0.01
1,186	603307	扬州金泉	100	3,144.00	0.01
1,187	300098	高新兴	700	3,101.00	0.01
1,188	603123	翠微股份	500	2,970.00	0.01
1,189	603073	彩蝶实业	200	2,892.00	0.00
1,190	688203	海正生材	340	2,890.00	0.00
1,191	003026	中晶科技	100	2,887.00	0.00
1,192	603908	牧高笛	140	2,808.40	0.00
1,193	300510	金冠股份	800	2,800.00	0.00
1,194	603375	盛景微	72	2,799.36	0.00
1,195	688119	中钢洛耐	839	2,760.31	0.00
1,196	603216	梦天家居	300	2,754.00	0.00

1,197	601065	江盐集团	300	2,601.00	0.00
1,198	600526	菲达环保	700	2,597.00	0.00
1,199	605599	菜百股份	200	2,546.00	0.00
1,200	300805	电声股份	400	2,544.00	0.00
1,201	300138	晨光生物	300	2,529.00	0.00
1,202	603089	正裕工业	300	2,508.00	0.00
1,203	002930	宏川智慧	200	2,480.00	0.00
1,204	300553	集智股份	100	2,449.00	0.00
1,205	688227	品高股份	200	2,422.00	0.00
1,206	002871	伟隆股份	300	2,400.00	0.00
1,207	002942	新农股份	200	2,358.00	0.00
1,207	600858	银座股份	600	2,358.00	0.00
1,208	300816	艾可蓝	100	2,330.00	0.00
1,209	301181	标榜股份	100	2,268.00	0.00
1,210	300753	爱朋医疗	200	2,190.00	0.00
1,211	301234	五洲医疗	100	2,165.00	0.00
1,212	002852	道道全	300	2,160.00	0.00
1,213	002855	捷荣技术	100	2,102.00	0.00
1,214	000751	锌业股份	800	2,096.00	0.00
1,215	300837	浙矿股份	100	2,076.00	0.00
1,216	301068	大地海洋	100	2,074.00	0.00
1,217	300937	药易购	100	2,038.00	0.00
1,218	300488	恒锋工具	100	2,035.00	0.00
1,219	301399	英特科技	100	1,968.00	0.00
1,220	002641	公元股份	500	1,965.00	0.00
1,221	601007	金陵饭店	300	1,908.00	0.00
1,222	600706	曲江文旅	200	1,902.00	0.00
1,223	002893	京能热力	200	1,892.00	0.00
1,224	002790	瑞尔特	200	1,806.00	0.00
1,225	002973	侨银股份	200	1,788.00	0.00
1,226	300702	天宇股份	100	1,783.00	0.00
1,227	605319	无锡振华	100	1,770.00	0.00
1,228	603995	甬金股份	100	1,752.00	0.00
1,229	605086	龙高股份	100	1,726.00	0.00
1,230	300662	科锐国际	100	1,613.00	0.00
1,231	600051	宁波联合	300	1,581.00	0.00
1,232	605169	洪通燃气	200	1,568.00	0.00
1,233	002494	华斯股份	500	1,560.00	0.00
1,234	600470	六国化工	400	1,528.00	0.00
1,235	001313	粤海饲料	200	1,504.00	0.00
1,236	603038	华立股份	200	1,462.00	0.00
1,237	603976	正川股份	100	1,411.00	0.00
1,238	001260	坤泰股份	100	1,393.00	0.00

1,239	000790	华神科技	400	1,384.00	0.00
1,240	600302	标准股份	400	1,376.00	0.00
1,241	603127	昭衍新药	100	1,327.00	0.00
1,242	605500	森林包装	200	1,230.00	0.00
1,243	002818	富森美	100	1,226.00	0.00
1,243	603291	联合水务	100	1,226.00	0.00
1,244	688033	天宜上佳	200	1,200.00	0.00
1,245	001219	青岛食品	100	1,177.00	0.00
1,246	603110	东方材料	100	1,113.00	0.00
1,247	002040	南京港	200	1,092.00	0.00
1,248	000811	冰轮环境	100	965.00	0.00
1,249	601599	浙文影业	300	864.00	0.00
1,250	603466	风语筑	100	854.00	0.00
1,251	300195	长荣股份	200	838.00	0.00
1,252	002394	联发股份	100	616.00	0.00
1,253	300128	锦富技术	200	594.00	0.00
1,254	603660	苏州科达	100	546.00	0.00
1,255	600210	紫江企业	100	532.00	0.00
1,256	002474	榕基软件	100	436.00	0.00
1,257	000702	正虹科技	100	425.00	0.00
1,258	000565	渝三峡 A	100	403.00	0.00
1,259	600561	江西长运	100	364.00	0.00
1,260	002678	珠江钢琴	100	362.00	0.00
1,261	600853	龙建股份	100	307.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688038	中科通达	5,469,032.72	1.34
2	300665	飞鹿股份	5,291,488.00	1.30
3	688041	海光信息	5,224,370.87	1.28
4	688681	科汇股份	4,877,464.08	1.19
5	002883	中设股份	4,702,506.40	1.15
6	300992	泰福泵业	4,363,302.00	1.07
7	300703	创源股份	4,338,923.00	1.06
8	603139	康惠制药	4,147,530.00	1.02
9	300329	海伦钢琴	4,126,467.00	1.01
10	600302	标准股份	4,036,871.00	0.99
11	300923	研奥股份	3,907,184.00	0.96
12	300640	德艺文创	3,850,629.00	0.94
13	603931	格林达	3,830,967.00	0.94
14	300626	华瑞股份	3,767,641.27	0.92

15	301040	中环海陆	3,710,740.00	0.91
16	603637	镇海股份	3,677,067.00	0.90
17	000526	学大教育	3,652,540.00	0.89
18	603320	迪贝电气	3,633,297.00	0.89
19	002826	易明医药	3,590,879.00	0.88
20	600883	博闻科技	3,578,329.00	0.88

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300665	飞鹿股份	11,108,074.00	2.72
2	300816	艾可蓝	7,598,132.00	1.86
3	300329	海伦钢琴	6,930,007.00	1.70
4	603320	迪贝电气	6,780,058.70	1.66
5	301198	喜悦智行	6,722,004.42	1.65
6	301098	金埔园林	6,602,637.07	1.62
7	301167	建研设计	6,562,846.00	1.61
8	300929	华骐环保	6,478,564.40	1.59
9	300640	德艺文创	6,218,505.00	1.52
10	300649	杭州园林	6,154,282.00	1.51
11	002633	申科股份	6,134,357.00	1.50
12	300478	杭州高新	5,970,108.00	1.46
13	300931	通用电梯	5,872,575.00	1.44
14	688041	海光信息	5,807,286.83	1.42
15	300746	汉嘉设计	5,691,487.22	1.39
16	300823	建科智能	5,680,671.56	1.39
17	688092	爱科科技	5,678,895.72	1.39
18	600455	博通股份	5,586,613.00	1.37
19	300535	达威股份	5,544,414.67	1.36
20	301040	中环海陆	5,539,964.34	1.36

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,206,636,924.54
卖出股票收入（成交）总额	1,450,912,831.80

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

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,337,649.17	5.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,337,649.17	5.74

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	30,000	3,032,192.05	5.21
2	019727	23 国债 24	3,000	305,457.12	0.53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	210,358.96
2	应收清算款	255,174.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,724.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	517,257.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
东方量化 成长灵活 配置混合 A	40,983	1,262.12	17,986,786.15	34.77	33,738,515.46	65.23

东方量化成长灵活配置混合 C	2,196	3,188.86	170,909.14	2.44	6,831,819.79	97.56
合计	43,179	1,360.11	18,157,695.29	30.92	40,570,335.25	69.08

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方量化成长灵活配置混合 A	454,785.90	0.88
	东方量化成长灵活配置混合 C	11,501.98	0.16
	合计	466,287.88	0.79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化成长灵活配置混合 A	东方量化成长灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2018年3月21日) 基金份额总额	694,463,618.20	-
本报告期期初基金份额总额	343,192,547.80	8,571,332.62
本报告期基金总申购份额	70,023,799.06	85,769,397.98
减：本报告期基金总赎回份额	361,491,045.25	87,338,001.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	51,725,301.61	7,002,728.93
-------------	---------------	--------------

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华鑫证券	2	1,191,023,59	44.82	292,878.35	17.90	-

有限责任公司		7.06				
中信建投证券股份有限公司	2	596,258,011.96	22.44	564,011.00	34.47	-
东北证券股份有限公司	2	243,358,079.32	9.16	230,209.61	14.07	-
国投证券股份有限公司	1	210,650,790.44	7.93	199,256.94	12.18	-
国泰君安证券股份有限公司	1	155,165,951.51	5.84	146,772.28	8.97	-
东方财富证券股份有限公司	2	143,081,988.97	5.38	135,342.16	8.27	-
国联证券股份有限公司	2	72,115,678.97	2.71	24,944.59	1.52	-
华西证券股份有限公司	2	45,419,306.11	1.71	42,961.60	2.63	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-

招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
华鑫证 券有限 责任公 司	22,514,321. 00	66.55	5,440,000.00	63.70	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	5,502,089.0 0	16.26	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	601,608.00	1.78	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	5,211,564.0 0	15.41	3,100,000.00	36.30	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-

司						
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 2 日
2	关于增加国金证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 C 类销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 12 日

3	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金(A类)恢复10万元以上申购、转换转入、定期定额投资公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月15日
4	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金2023年第4季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月20日
5	关于增加兴业证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月24日
6	关于增加中信建投证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金C类销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月31日
7	关于增加华西证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月31日
8	关于增加上海大智慧基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月5日
9	东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月23日
10	关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月23日
11	关于增加华泰证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月26日
12	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年2月28日
13	关于旗下部分基金参与深圳前海微众	证券时报、证券日报、	2024年2月29日

	银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
14	关于增加中国银河证券股份有限公司为东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 8 日
15	关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 14 日
16	关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 15 日
17	关于增加粤开证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 19 日
18	关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 27 日
19	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 30 日
20	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 2 日
21	东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 10 日
22	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 20 日

23	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 30 日
24	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 30 日
25	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 17 日
26	东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 27 日
27	关于增加东方证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240223 - 20240227	-	21,369,547.76	21,369,547.76	-	0.00
	2	20240229 - 20240304	-	21,369,547.76	21,369,547.76	-	0.00
	3	20240101 - 20240220	101,476,445.29	-	101,476,445.29	-	0.00
	4	20240101 - 20240205	101,476,445.29	-	101,476,445.29	-	0.00
	5	20240416 - 20240630	-	32,484,421.28	14,500,000.00	17,984,421.28	30.62
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日