

东方量化多策略混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）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	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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	52
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方量化多策略混合型证券投资基金	
基金简称	东方量化多策略混合	
基金主代码	006785	
前端交易代码	006785	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 2 月 22 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	181,277,910.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
下属分级基金的交易代码	006785	014724
报告期末下属分级基金的份额总额	30,091,915.35 份	151,185,994.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	运用多种量化投资策略持续挖掘具有良好收益特征的投资标的，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金，其中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%。为更好地实现投资目标，在保持不低于 60%的股票资产基础上有 35%的大类资产配置空间，这部分资产称为“弹性配置资产”，其配置的主要方向是股票、债券、现金类资产等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李景岩	秦一楠
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼 远洋锐中心 26 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100073	100031
法定代表人	崔伟	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
本期已实现收益	-5,098,123.19	-3,487,338.13
本期利润	1,325,413.92	-3,218,213.71
加权平均基金份额 本期利润	0.0342	-0.0353
本期加权平均净 值利润率	4.14%	-4.34%
本期基金份额净 值增长率	-1.85%	-1.86%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-6,243,829.67	-40,450,709.67
期末可供分配基 金份额利润	-0.2075	-0.2676
期末基金资产净 值	23,848,085.68	119,756,144.01
期末基金份额净 值	0.7925	0.7921
3.1.3 累计期末	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-20.75%	-19.58%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方量化多策略混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.92%	0.80%	1.10%	0.83%	0.82%	-0.03%
过去三个月	-4.45%	0.75%	-4.88%	0.79%	0.43%	-0.04%
过去六个月	-1.85%	0.73%	-0.69%	0.80%	-1.16%	-0.07%
过去一年	-18.71%	0.90%	-13.60%	0.94%	-5.11%	-0.04%
过去三年	-25.68%	1.34%	-5.74%	0.99%	-19.94%	0.35%
自基金合同生效起至今	-20.75%	1.26%	13.44%	1.06%	-34.19%	0.20%

东方量化多策略混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.92%	0.80%	1.10%	0.83%	0.82%	-0.03%
过去三个月	-4.45%	0.75%	-4.88%	0.79%	0.43%	-0.04%
过去六个月	-1.86%	0.73%	-0.69%	0.80%	-1.17%	-0.07%
过去一年	-18.75%	0.90%	-13.60%	0.94%	-5.15%	-0.04%
自基金合同生效起	-19.58%	1.08%	-20.02%	1.10%	0.44%	-0.02%

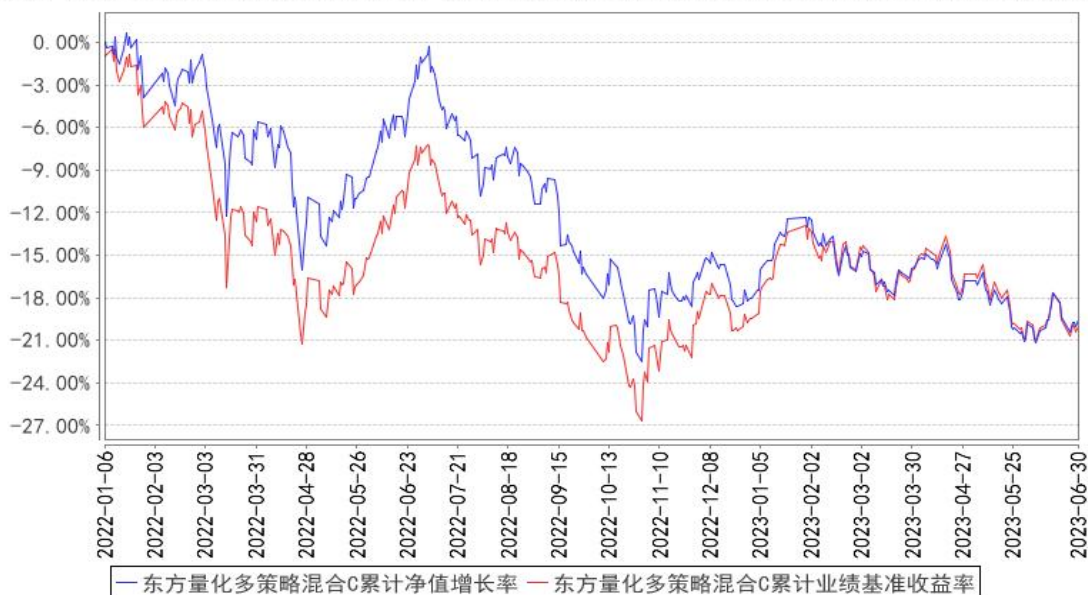
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东方量化多策略混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方量化多策略混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 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%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1170 万股，持股比例 3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1123 万股，持股比例 3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1040 万股，持股比例 3.12%。

截止 2023 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、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资

基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛泽	本基金基金经理、量化投资部总经理、资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员	2019 年 2 月 22 日	-	8 年	量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，8 年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018 年 7 月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理，现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
王怀勋	本基金基金经理	2022 年 5 月 17 日	-	8 年	中国人民大学金融专业硕士，8 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、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

报告期内，我们继续采用以多因子选股模型进行选股，因子库包括量价因子、财报基本面因子、资金流因子、研报类因子、舆情类因子等多个大类，再经过非线性的配权模型进行合成，最终形成对未来收益的预测，经由优化器基于对未来收益、交易成本、组合风险的综合权衡生成投资组合。

报告期内，配权模型基于对市场表现的动态拟合，在因子选择上，开始侧重于以高频量价因子为主。从最终的收益预测和组合优化结果来看，模型最终倾向于选择小市值股票，这也与当前的市场风格较为契合，同时，由于无论是理论上还是经验上来看，量价类因子在中小市值股票中往往有更高的选股胜率，当前模型的选股结果也与这一规律相契合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-1.85%，业绩比较基准收益率为-0.69%，低于业绩比较基准 1.16%；本基金 C 类净值增长率为-1.86%，业绩比较基准收益率为-0.69%，低于业绩比较基准 1.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上来看，新冠带来的影响已经消退，经济的核心课题重新回到在人口、城镇化红利结束之后如何寻找新动能、新引擎上，这还需要较长时间的摸索，在宏观经济缺少主线和亮点的情况下，市场或难以再有像过去几年消费升级、防疫、新能源这样有明确基本面支撑的主线。在基本面出现新的明确方向之前，预计下半年仍会是一个情绪和交易驱动股价的阶段，基于实时发生的一些热点的追捧或反复的概念炒作可能会比较多，或更适合于量价类因子进行发挥。

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，本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续二十个工作日低于

五千万元的情形，持续期间为 2023 年 2 月 15 日至 2023 年 4 月 10 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理股份有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,700,765.66	1,680,161.86
结算备付金		47,923.52	91,106.46
存出保证金		62,579.79	37,520.44
交易性金融资产	6.4.7.2	139,149,316.09	120,898,264.58
其中：股票投资		130,336,947.40	114,152,328.28
基金投资		-	-

债券投资		8,812,368.69	6,745,936.30
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		-	-
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		141,836.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		48.82	146.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		144,102,470.55	122,707,199.91
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		8,007.21	622.27
应付管理人报酬		94,037.50	83,261.88
应付托管费		17,632.03	15,611.62
应付销售服务费		979.61	546.32
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	6.4.7.6	377,584.51	237,586.23
负债合计		498,240.86	337,628.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	181,277,910.00	151,592,240.01
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-37,673,680.31	-29,222,668.42
净资产合计		143,604,229.69	122,369,571.59
负债和净资产总计		144,102,470.55	122,707,199.91

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，东方量化多策略混合 A 基金份额净值 0.7925 元，基金份额

总额 30,091,915.35 份；东方量化多策略混合 C 基金份额净值 0.7921 元，基金份额总额 151,185,994.65 份。东方量化多策略混合份额总额合计 181,277,910.00 份。

6.2 利润表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,288,611.16	-7,925,001.18
1. 利息收入		15,530.51	9,592.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,530.51	9,592.09
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		-	-
证券出借利息收 入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-8,010,772.14	-5,757,226.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,590,223.36	-7,135,752.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	48,688.91	95,326.22
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,530,762.31	1,283,199.34
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）	6.4.7.16	6,692,661.53	-2,250,198.14
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	13,968.94	72,831.72
减：二、营业总支出		604,188.63	703,423.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	427,743.61	560,370.92

2. 托管费	6.4.10.2.2	80,201.94	104,412.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,711.50	6,152.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	92,531.58	32,486.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,892,799.79	-8,628,424.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,892,799.79	-8,628,424.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,892,799.79	-8,628,424.56

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方量化多策略混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	151,592,240.01	-	-29,222,668.42	122,369,571.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	151,592,240.01	-	-29,222,668.42	122,369,571.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	29,685,669.99	-	-8,451,011.89	21,234,658.10
（一）、综合收益总额	-	-	-1,892,799.79	-1,892,799.79
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	29,685,669.99	-	-6,558,212.10	23,127,457.89

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	154,431,724.18	-	-25,858,448.86	128,573,275.32
2. 基金赎回款	-124,746,054.19	-	19,300,236.76	-105,445,817.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	181,277,910.00	-	-37,673,680.31	143,604,229.69
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值)	150,439,476.35	-	3,347,567.97	153,787,044.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	150,439,476.35	-	3,347,567.97	153,787,044.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,760,924.35	-	-6,905,929.47	-15,666,853.82
(一)、综合收益总额	-	-	-8,628,424.56	-8,628,424.56
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,760,924.35	-	1,722,495.09	-7,038,429.26
其中：1. 基金申购款	24,871,847.27	-	-2,264,991.62	22,606,855.65
2. 基金赎回款	-33,632,771.62	-	3,987,486.71	-29,645,284.91

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	141,678,552.00	-	-3,558,361.50	138,120,190.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方量化多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 7 月 10 日中国证监会《关于准予东方量化多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1093 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 1 月 7 日至 2019 年 2 月 15 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 329,903,665.65 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2019]第 01210017 号”验资报告验证。

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

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

持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

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

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

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得

税。

5、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,700,765.66
等于：本金	4,700,011.34
加：应计利息	754.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,700,765.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	139,601,882.83	-	130,336,947.40	-9,264,935.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,695,048.91	100,438.69	8,812,368.69	16,881.09
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	8,695,048.91	100,438.69	8,812,368.69	16,881.09
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	148,296,931.74	100,438.69	139,149,316.09	-9,248,054.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	173,738.35
其中：交易所市场	173,738.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	203,843.16
合计	377,584.51

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和债券账户维护费。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东方量化多策略混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,891,621.51	70,891,621.51
本期申购	261,720.99	261,720.99
本期赎回（以“-”号填列）	-41,061,427.15	-41,061,427.15
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	30,091,915.35	30,091,915.35

东方量化多策略混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,700,618.50	80,700,618.50
本期申购	154,170,003.19	154,170,003.19
本期赎回（以“-”号填列）	-83,684,627.04	-83,684,627.04
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	151,185,994.65	151,185,994.65

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东方量化多策略混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,109,905.79	-26,762,543.49	-13,652,637.70
本期利润	-5,098,123.19	6,423,537.11	1,325,413.92
本期基金份额交易产生的变动数	-6,485,677.83	12,569,071.94	6,083,394.11
其中：基金申购款	26,264.79	-71,276.54	-45,011.75
基金赎回款	-6,511,942.62	12,640,348.48	6,128,405.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,526,104.77	-7,769,934.44	-6,243,829.67

东方量化多策略混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,761,295.08	-4,808,735.64	-15,570,030.72
本期利润	-3,487,338.13	269,124.42	-3,218,213.71
本期基金份额交易产生的变动数	-26,202,076.46	13,560,470.25	-12,641,606.21
其中：基金申购款	-41,621,630.77	15,808,193.66	-25,813,437.11
基金赎回款	15,419,554.31	-2,247,723.41	13,171,830.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,450,709.67	9,020,859.03	-31,429,850.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,669.46
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	2,478.97
其他	382.08
合计	15,530.51

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,590,223.36
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	-9,590,223.36

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	201,567,742.58
减：卖出股票成本总额	210,531,502.26
减：交易费用	626,463.68
买卖股票差价收入	-9,590,223.36

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	59,315.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,626.61
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	48,688.91

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,647,052.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,606,805.61
减：应计利息总额	50,873.32
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-10,626.61

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,530,762.31
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	1,530,762.31

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	6,692,661.53
股票投资	6,653,137.92
债券投资	39,523.61
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	6,692,661.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	13,968.94
合计	13,968.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,188.42
账户维护费	9,000.00
合计	92,531.58

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
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、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

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方的佣金费用，期末无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	427,743.61	560,370.92
其中：支付销售机构的客户维护费	16,419.85	11,851.79

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,201.94	104,412.89

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	3,330.83	3,330.83
合计	-	3,330.83	3,330.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C	合计
合计	-	-	-

注：计提标准：①本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.01% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③自 2022 年 8 月 16 日起 C 类基金实行销售服务费率优惠调整，费率由 0.40% 调整至 0.01%，

截止本报告期末优惠方案未结束。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日(2019年2月22日)持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.64%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月6日(基金合同生效日)至2022年6月30日
	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C

基金合同生效日（2019年2月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	24,732,161.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.42%	-

注：①基金管理人投资本基金时按照基金合同、招募说明书及相关公告约定的费率标准支付相应的手续费。

②报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,700,765.66	12,669.46	1,545,164.04	8,052.52

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(2023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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)				
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	33.10	124	5,263.80	4,104.40		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	35.61	119	4,046.00	4,237.59		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.71	103	5,961.64	5,120.13		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	34.28	156	5,562.96	5,347.68		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.48	66	4,785.00	3,859.68		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,014	37,416.60	37,416.60		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.97	199	6,013.78	5,168.03		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.57	183	6,977.79	5,777.31		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.42	128	8,611.84	8,373.76		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	41.11	94	3,671.64	3,864.34		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	17.23	264	4,633.20	4,548.72		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.57	172	4,241.52	3,882.04		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	180	8,308.80	6,429.60		-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	1,271	50,560.38	50,560.38		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	17.20	314	4,446.24	5,400.80		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	27.88	184	3,532.80	5,129.92		-

		日								
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	11.10	17.24	557	6,182.70	9,602.68	-
688523	航天环 宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流 通受限	21.86	25.43	238	5,202.68	6,052.34	-
688543	国科军 工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	43.67	53.72	103	4,498.01	5,533.16	-
688570	天玛智 控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	30.26	25.46	166	5,023.16	4,226.36	-
688623	双元科 技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	125.88	89.31	44	5,538.72	3,929.64	-
688631	莱斯信 息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流 通受限	25.28	30.89	130	3,286.40	4,015.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

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 2023 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 2023 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考

察。

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,700,765.66	-	-	-	4,700,765.66
结算备付金	47,923.52	-	-	-	47,923.52
存出保证金	62,579.79	-	-	-	62,579.79
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	130,336,947.40	130,336,947.40
交易性金融资产-债券投资	8,812,368.69	-	-	-	8,812,368.69
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	-	-	-	141,836.67	141,836.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	48.82	48.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,623,637.66	-	-	-130,478,832.89	144,102,470.55
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	-	-	-	8,007.21	8,007.21
应付管理人报酬	-	-	-	94,037.50	94,037.50
应付托管费	-	-	-	17,632.03	17,632.03
应付销售服务费	-	-	-	979.61	979.61
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	-	-	-	377,584.51	377,584.51
负债总计	-	-	-	498,240.86	498,240.86
利率敏感度缺口	13,623,637.66	-	-	-129,980,592.03	143,604,229.69
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,680,161.86	-	-	-	1,680,161.86
结算备付金	91,106.46	-	-	-	91,106.46
存出保证金	37,520.44	-	-	-	37,520.44
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-114,152,328.28	114,152,328.28
交易性金融资产-债券投资	6,745,936.30	-	-	-	6,745,936.30
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	146.57	146.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,554,725.06	-	-	-114,152,474.85	122,707,199.91
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	622.27	622.27
应付管理人报酬	-	-	83,261.88	83,261.88
应付托管费	-	-	15,611.62	15,611.62
应付销售服务费	-	-	546.32	546.32
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	-	-	237,586.23	237,586.23
负债总计	-	-	337,628.32	337,628.32
利率敏感度缺口	8,554,725.06	-	-113,814,846.53	122,369,571.59

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-9,009.67	-9,042.93
	市场利率下调 0.25%	9,009.67	9,042.93

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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	130,336,947.40	90.76	114,152,328.28	93.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,812,368.69	6.14	6,745,936.30	5.51
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	139,149,316.09	96.90	120,898,264.58	98.80

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)	
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	沪深 300 指数上涨 5%	6,553,984.05	5,134,309.42
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,553,984.05	-5,134,309.42

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	130,144,366.54	113,701,384.82
第二层次	8,900,345.67	6,745,936.30
第三层次	104,603.88	450,943.46
合计	139,149,316.09	120,898,264.58

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	130,336,947.40	90.45
	其中：股票	130,336,947.40	90.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,812,368.69	6.12
	其中：债券	8,812,368.69	6.12
	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	4,748,689.18	3.30
8	其他各项资产	204,465.28	0.14
9	合计	144,102,470.55	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	1,602,835.00	1.12
B	采矿业	4,442,967.00	3.09
C	制造业	73,824,540.81	51.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,780,307.00	2.63
E	建筑业	3,255,123.60	2.27
F	批发和零售业	298,798.04	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	3,714,791.00	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,569,275.80	4.57
J	金融业	27,177,858.00	18.93
K	房地产业	2,015,694.00	1.40
L	租赁和商务服务业	1,291,844.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	1,314,895.80	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	56,659.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	773,786.35	0.54
R	文化、体育和娱乐业	217,572.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	130,336,947.40	90.76

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	600519	贵州茅台	4,300	7,271,300.00	5.06
2	300750	宁德时代	18,880	4,319,555.20	3.01
3	601318	中国平安	80,200	3,721,280.00	2.59
4	600036	招商银行	93,900	3,076,164.00	2.14
5	000858	五粮液	16,400	2,682,548.00	1.87
6	000333	美的集团	38,300	2,256,636.00	1.57
7	002594	比亚迪	7,300	1,885,371.00	1.31
8	600900	长江电力	68,200	1,504,492.00	1.05
9	600276	恒瑞医药	30,400	1,456,160.00	1.01
10	601398	工商银行	301,300	1,452,266.00	1.01
11	601166	兴业银行	92,400	1,446,060.00	1.01
12	600030	中信证券	69,900	1,382,622.00	0.96
13	000568	泸州老窖	6,500	1,362,205.00	0.95
14	300059	东方财富	95,020	1,349,284.00	0.94
15	000001	平安银行	119,800	1,345,354.00	0.94
16	000651	格力电器	36,700	1,339,917.00	0.93
17	601012	隆基绿能	43,172	1,237,741.24	0.86
18	601328	交通银行	213,300	1,237,140.00	0.86
19	002475	立讯精密	36,700	1,190,915.00	0.83
20	000725	京东方 A	287,000	1,173,830.00	0.82
21	601899	紫金矿业	103,000	1,171,110.00	0.82
22	300760	迈瑞医疗	3,900	1,169,220.00	0.81
23	002415	海康威视	35,300	1,168,783.00	0.81
24	600309	万华化学	13,100	1,150,704.00	0.80
25	000063	中兴通讯	23,900	1,088,406.00	0.76
26	600887	伊利股份	34,900	988,368.00	0.69
27	002352	顺丰控股	21,500	969,435.00	0.68
28	002230	科大讯飞	13,600	924,256.00	0.64
29	601668	中国建筑	159,900	917,826.00	0.64
30	300124	汇川技术	14,200	911,782.00	0.63
31	601816	京沪高铁	171,100	899,986.00	0.63
32	300274	阳光电源	7,600	886,388.00	0.62
33	603259	药明康德	14,100	878,571.00	0.61
34	002714	牧原股份	20,700	872,505.00	0.61
35	000002	万科 A	60,200	844,004.00	0.59

36	002304	洋河股份	6,400	840,640.00	0.59
37	003816	中国广核	269,100	836,901.00	0.58
38	002142	宁波银行	32,100	812,130.00	0.57
39	002129	TCL 中环	24,000	796,800.00	0.55
40	000776	广发证券	53,200	782,572.00	0.54
41	601888	中国中免	6,800	751,604.00	0.52
42	601088	中国神华	24,400	750,300.00	0.52
43	300498	温氏股份	39,800	730,330.00	0.51
44	688981	中芯国际	14,139	714,302.28	0.50
45	601138	工业富联	27,800	700,560.00	0.49
46	600016	民生银行	176,800	663,000.00	0.46
47	300015	爱尔眼科	35,621	660,769.55	0.46
48	600031	三一重工	39,700	660,211.00	0.46
49	600000	浦发银行	90,500	655,220.00	0.46
50	600438	通威股份	18,900	648,459.00	0.45
51	002460	赣锋锂业	10,600	646,176.00	0.45
52	002736	国信证券	73,800	644,274.00	0.45
53	601728	中国电信	113,600	639,568.00	0.45
54	600050	中国联通	132,900	637,920.00	0.44
55	002371	北方华创	2,000	635,300.00	0.44
56	000895	双汇发展	25,800	631,842.00	0.44
57	600406	国电南瑞	27,340	631,554.00	0.44
58	601601	中国太保	24,100	626,118.00	0.44
59	000166	申万宏源	132,800	613,536.00	0.43
60	600048	保利发展	46,900	611,107.00	0.43
61	600436	片仔癀	2,100	601,356.00	0.42
62	600028	中国石化	94,200	599,112.00	0.42
63	601390	中国中铁	77,900	590,482.00	0.41
64	000768	中航西飞	21,600	577,800.00	0.40
65	601857	中国石油	77,100	575,937.00	0.40
66	688111	金山办公	1,197	565,247.34	0.39
67	300014	亿纬锂能	9,300	562,650.00	0.39
68	002466	天齐锂业	8,000	559,280.00	0.39
69	002673	西部证券	88,000	558,800.00	0.39
70	600089	特变电工	25,000	557,250.00	0.39
71	000625	长安汽车	42,700	552,111.00	0.38
72	000338	潍柴动力	44,100	549,486.00	0.38
73	600690	海尔智家	23,100	542,388.00	0.38
74	601766	中国中车	83,400	542,100.00	0.38
75	300447	全信股份	27,800	533,482.00	0.37
76	603288	海天味业	11,160	522,846.00	0.36
77	601988	中国银行	130,900	511,819.00	0.36
78	002027	分众传媒	73,400	499,854.00	0.35

79	688012	中微公司	3,142	491,565.90	0.34
80	600919	江苏银行	66,100	485,835.00	0.34
81	603986	兆易创新	4,500	478,125.00	0.33
82	002049	紫光国微	5,100	475,575.00	0.33
83	000938	紫光股份	14,800	471,380.00	0.33
84	603501	韦尔股份	4,800	470,592.00	0.33
85	002050	三花智控	14,700	444,822.00	0.31
86	603019	中科曙光	8,600	437,740.00	0.30
87	000100	TCL 科技	109,890	432,966.60	0.30
88	601225	陕西煤业	23,700	431,103.00	0.30
89	600809	山西汾酒	2,300	425,661.00	0.30
90	600941	中国移动	4,500	419,850.00	0.29
91	002459	晶澳科技	9,980	416,166.00	0.29
92	002271	东方雨虹	15,100	411,626.00	0.29
93	300122	智飞生物	9,150	404,430.00	0.28
94	600570	恒生电子	9,100	403,039.00	0.28
95	601919	中远海控	42,600	400,440.00	0.28
96	600104	上汽集团	28,200	399,594.00	0.28
97	601985	中国核电	56,600	399,030.00	0.28
98	601211	国泰君安	28,000	391,720.00	0.27
99	300316	晶盛机电	5,500	389,950.00	0.27
100	002812	恩捷股份	4,000	385,400.00	0.27
101	601658	邮储银行	78,600	384,354.00	0.27
102	002179	中航光电	8,450	383,207.50	0.27
103	001979	招商蛇口	28,700	373,961.00	0.26
104	603799	华友钴业	8,100	371,871.00	0.26
105	002709	天赐材料	8,900	366,591.00	0.26
106	300896	爱美客	800	355,960.00	0.25
107	000977	浪潮信息	7,300	354,050.00	0.25
108	000425	徐工机械	51,600	349,332.00	0.24
109	002555	三七互娱	10,000	348,800.00	0.24
110	601186	中国铁建	35,200	346,720.00	0.24
111	600150	中国船舶	10,400	342,264.00	0.24
112	000538	云南白药	6,500	341,120.00	0.24
113	600958	东方证券	34,900	338,530.00	0.24
114	601229	上海银行	58,700	337,525.00	0.24
115	300142	沃森生物	12,700	335,915.00	0.23
116	002410	广联达	10,080	327,499.20	0.23
117	002920	德赛西威	2,100	327,201.00	0.23
118	000661	长春高新	2,400	327,120.00	0.23
119	000596	古井贡酒	1,300	321,594.00	0.22
120	688599	天合光能	7,487	319,021.07	0.22
121	688008	澜起科技	5,544	318,336.48	0.22

122	600111	北方稀土	13,200	316,536.00	0.22
123	002966	苏州银行	48,000	314,400.00	0.22
124	002311	海大集团	6,700	313,828.00	0.22
125	601169	北京银行	66,900	309,747.00	0.22
126	300408	三环集团	10,500	308,175.00	0.21
127	688036	传音控股	2,086	306,642.00	0.21
128	000157	中联重科	45,200	305,100.00	0.21
129	002241	歌尔股份	17,000	301,750.00	0.21
130	601989	中国重工	62,200	299,804.00	0.21
131	000963	华东医药	6,800	294,916.00	0.21
132	002602	世纪华通	38,600	292,974.00	0.20
133	600019	宝钢股份	51,900	291,678.00	0.20
134	300450	先导智能	8,000	289,360.00	0.20
135	002493	荣盛石化	24,800	288,672.00	0.20
136	600009	上海机场	6,300	286,146.00	0.20
137	600585	海螺水泥	12,000	284,880.00	0.20
138	601800	中国交建	25,800	281,478.00	0.20
139	300033	同花顺	1,600	280,448.00	0.20
140	601669	中国电建	48,400	277,816.00	0.19
141	600547	山东黄金	11,800	277,064.00	0.19
142	002236	大华股份	13,900	274,525.00	0.19
143	600588	用友网络	13,300	272,650.00	0.19
144	600015	华夏银行	50,200	271,582.00	0.19
145	600584	长电科技	8,700	271,179.00	0.19
146	600999	招商证券	19,900	270,043.00	0.19
147	000733	振华科技	2,800	268,380.00	0.19
148	601939	建设银行	42,200	264,172.00	0.18
149	601818	光大银行	85,300	261,871.00	0.18
150	600011	华能国际	28,000	259,280.00	0.18
151	300347	泰格医药	4,000	258,160.00	0.18
152	600426	华鲁恒升	8,200	251,166.00	0.17
153	601360	三六零	19,500	244,530.00	0.17
154	603993	洛阳钼业	45,800	244,114.00	0.17
155	002202	金风科技	22,900	243,198.00	0.17
156	000750	国海证券	71,700	240,195.00	0.17
157	300782	卓胜微	2,400	231,912.00	0.16
158	002001	新和成	15,040	231,616.00	0.16
159	600660	福耀玻璃	6,400	229,440.00	0.16
160	002074	国轩高科	8,300	229,246.00	0.16
161	601377	兴业证券	37,200	227,664.00	0.16
162	600845	宝信软件	4,440	225,596.40	0.16
163	300496	中科创达	2,300	221,605.00	0.15
164	601618	中国中冶	54,400	215,968.00	0.15

165	300999	金龙鱼	5,400	215,946.00	0.15
166	002180	纳思达	6,300	215,775.00	0.15
167	300454	深信服	1,900	215,175.00	0.15
168	600745	闻泰科技	4,400	215,160.00	0.15
169	000876	新希望	18,400	214,912.00	0.15
170	601633	长城汽车	8,500	213,945.00	0.15
171	002007	华兰生物	9,400	210,654.00	0.15
172	603659	璞泰来	5,510	210,592.20	0.15
173	601006	大秦铁路	27,700	205,811.00	0.14
174	300661	圣邦股份	2,470	202,861.10	0.14
175	002648	卫星化学	13,500	201,960.00	0.14
176	000783	长江证券	34,700	201,260.00	0.14
177	600029	南方航空	33,300	200,799.00	0.14
178	601117	中国化学	24,200	200,376.00	0.14
179	600039	四川路桥	20,160	197,769.60	0.14
180	000786	北新建材	8,000	196,080.00	0.14
181	601600	中国铝业	35,300	193,797.00	0.13
182	601009	南京银行	24,000	192,000.00	0.13
183	601995	中金公司	5,400	191,808.00	0.13
184	300751	迈为股份	1,120	189,705.60	0.13
185	002821	凯莱英	1,600	188,576.00	0.13
186	002601	龙佰集团	11,400	188,100.00	0.13
187	601868	中国能建	80,300	187,902.00	0.13
188	601100	恒立液压	2,900	186,557.00	0.13
189	000708	中信特钢	11,300	178,992.00	0.12
190	000301	东方盛虹	15,100	178,482.00	0.12
191	600176	中国巨石	12,600	178,416.00	0.12
192	300413	芒果超媒	5,200	177,892.00	0.12
193	300223	北京君正	2,000	176,620.00	0.12
194	601111	中国国航	21,400	176,336.00	0.12
195	600346	恒力石化	11,900	170,527.00	0.12
196	300207	欣旺达	10,200	166,464.00	0.12
197	300433	蓝思科技	14,000	164,640.00	0.11
198	600989	宝丰能源	13,000	163,930.00	0.11
199	000877	天山股份	20,100	163,614.00	0.11
200	605117	德业股份	1,080	161,514.00	0.11
201	000069	华侨城 A	36,200	159,280.00	0.11
202	300769	德方纳米	1,440	158,731.20	0.11
203	600188	兖矿能源	5,300	158,576.00	0.11
204	601336	新华保险	4,300	158,111.00	0.11
205	300763	锦浪科技	1,500	156,150.00	0.11
206	600795	国电电力	38,500	147,455.00	0.10
207	002008	大族激光	5,600	146,720.00	0.10

208	688126	沪硅产业	6,994	146,174.60	0.10
209	300759	康龙化成	3,800	145,464.00	0.10
210	300601	康泰生物	5,700	144,723.00	0.10
211	000723	美锦能源	19,100	144,014.00	0.10
212	600741	华域汽车	7,800	143,988.00	0.10
213	601877	正泰电器	5,200	143,780.00	0.10
214	002064	华峰化学	20,800	142,688.00	0.10
215	001965	招商公路	14,500	139,200.00	0.10
216	000155	川能动力	9,600	138,240.00	0.10
217	002841	视源股份	2,000	133,680.00	0.09
218	000408	藏格矿业	5,900	133,163.00	0.09
219	002958	青农商行	48,800	132,736.00	0.09
220	002756	永兴材料	2,120	132,733.20	0.09
221	600115	中国东航	27,500	130,900.00	0.09
222	603806	福斯特	3,500	130,165.00	0.09
223	000426	兴业银锡	14,300	126,984.00	0.09
224	002938	鹏鼎控股	5,100	123,879.00	0.09
225	601998	中信银行	20,700	123,786.00	0.09
226	300628	亿联网络	3,500	122,745.00	0.09
227	601319	中国人保	20,900	122,056.00	0.08
228	002797	第一创业	20,900	119,548.00	0.08
229	000027	深圳能源	18,100	119,279.00	0.08
230	601615	明阳智能	6,900	116,472.00	0.08
231	601838	成都银行	9,500	115,995.00	0.08
232	002414	高德红外	14,820	115,151.40	0.08
233	600460	士兰微	3,800	115,026.00	0.08
234	002916	深南电路	1,500	113,055.00	0.08
235	601689	拓普集团	1,400	112,980.00	0.08
236	002120	韵达股份	11,700	111,852.00	0.08
237	600893	航发动力	2,500	105,650.00	0.07
238	688396	华润微	1,985	104,033.85	0.07
239	300595	欧普康视	3,400	102,646.00	0.07
240	000883	湖北能源	22,500	102,600.00	0.07
241	002500	山西证券	17,100	95,418.00	0.07
242	000563	陕国投 A	31,100	94,855.00	0.07
243	603392	万泰生物	1,407	93,945.39	0.07
244	300919	中伟股份	1,500	90,375.00	0.06
245	600763	通策医疗	900	87,174.00	0.06
246	000800	一汽解放	10,300	86,211.00	0.06
247	600600	青岛啤酒	800	82,904.00	0.06
248	600886	国投电力	6,500	82,225.00	0.06
249	000987	越秀资本	12,900	81,915.00	0.06
250	002085	万丰奥威	11,500	79,695.00	0.06

251	600018	上港集团	15,100	79,275.00	0.06
252	300529	健帆生物	3,400	78,812.00	0.05
253	000060	中金岭南	16,100	76,475.00	0.05
254	688561	奇安信	1,473	76,316.13	0.05
255	300957	贝泰妮	800	71,104.00	0.05
256	002939	长城证券	8,500	69,105.00	0.05
257	002926	华西证券	8,200	68,142.00	0.05
258	000559	万向钱潮	12,200	66,490.00	0.05
259	600196	复星医药	2,100	64,890.00	0.05
260	000728	国元证券	9,900	64,548.00	0.04
261	002048	宁波华翔	4,800	64,320.00	0.04
262	000959	首钢股份	18,200	63,700.00	0.04
263	000630	铜陵有色	21,900	63,291.00	0.04
264	688169	石头科技	195	62,532.60	0.04
265	002032	苏泊尔	1,200	60,000.00	0.04
266	603185	弘元绿能	800	59,640.00	0.04
267	601865	福莱特	1,400	53,914.00	0.04
268	000932	华菱钢铁	11,300	53,901.00	0.04
269	000898	鞍钢股份	19,300	53,654.00	0.04
270	600332	白云山	1,600	51,008.00	0.04
271	301488	豪恩汽电	1,271	50,560.38	0.04
272	600760	中航沈飞	1,120	50,400.00	0.04
273	000738	航发控制	2,000	48,800.00	0.03
274	300979	华利集团	1,000	48,740.00	0.03
275	688187	时代电气	1,123	47,008.78	0.03
276	601698	中国卫通	2,300	45,724.00	0.03
277	002608	江苏国信	5,900	44,663.00	0.03
278	002340	格林美	6,000	41,460.00	0.03
279	600905	三峡能源	7,600	40,812.00	0.03
280	000739	普洛药业	2,300	40,802.00	0.03
281	002312	川发龙蟒	5,000	40,650.00	0.03
282	000785	居然之家	10,600	40,386.00	0.03
283	300144	宋城演艺	3,200	39,680.00	0.03
284	002081	金螳螂	8,600	38,786.00	0.03
285	301261	恒工精密	1,014	37,416.60	0.03
286	002028	思源电气	800	37,376.00	0.03
287	002126	银轮股份	2,100	37,170.00	0.03
288	600362	江西铜业	1,900	36,062.00	0.03
289	001289	龙源电力	1,600	36,000.00	0.03
290	002439	启明星辰	1,200	35,712.00	0.02
291	002985	北摩高科	800	35,296.00	0.02
292	002839	张家港行	8,300	35,109.00	0.02
293	002185	华天科技	3,800	34,960.00	0.02

294	000598	兴蓉环境	6,400	34,752.00	0.02
295	000591	太阳能	5,100	34,578.00	0.02
296	002294	信立泰	1,100	34,309.00	0.02
297	002497	雅化集团	1,900	33,782.00	0.02
298	002625	光启技术	2,200	33,572.00	0.02
299	300777	中简科技	700	33,082.00	0.02
300	000682	东方电子	3,300	32,076.00	0.02
301	000807	云铝股份	2,500	31,825.00	0.02
302	300003	乐普医疗	1,400	31,654.00	0.02
303	300034	钢研高纳	800	31,512.00	0.02
304	000513	丽珠集团	800	31,128.00	0.02
305	688065	凯赛生物	495	30,818.70	0.02
306	000089	深圳机场	4,400	30,580.00	0.02
307	002531	天顺风能	2,000	30,460.00	0.02
308	300775	三角防务	900	30,402.00	0.02
309	300861	美畅股份	700	30,359.00	0.02
310	000999	华润三九	500	30,330.00	0.02
311	300699	光威复材	980	30,233.00	0.02
312	300009	安科生物	3,000	30,000.00	0.02
313	002422	科伦药业	1,000	29,680.00	0.02
314	300054	鼎龙股份	1,200	29,676.00	0.02
315	300395	菲利华	600	29,520.00	0.02
316	002266	浙富控股	7,100	29,323.00	0.02
317	300294	博雅生物	800	29,024.00	0.02
318	002318	久立特材	1,700	28,951.00	0.02
319	601021	春秋航空	500	28,735.00	0.02
320	002945	华林证券	2,100	28,728.00	0.02
321	002240	盛新锂能	900	28,683.00	0.02
322	002773	康弘药业	1,500	28,680.00	0.02
323	300390	天华新能	800	28,640.00	0.02
324	300604	长川科技	600	28,494.00	0.02
325	300373	扬杰科技	700	28,399.00	0.02
326	002690	美亚光电	1,100	28,325.00	0.02
327	002653	海思科	1,200	28,320.00	0.02
328	002603	以岭药业	1,100	28,259.00	0.02
329	002595	豪迈科技	800	28,104.00	0.02
330	000975	银泰黄金	2,400	28,080.00	0.02
331	000960	锡业股份	1,800	27,990.00	0.02
332	002407	多氟多	1,400	27,804.00	0.02
333	002078	太阳纸业	2,600	27,794.00	0.02
334	002128	电投能源	2,100	27,762.00	0.02
335	002262	恩华药业	900	27,747.00	0.02
336	600233	圆通速递	1,900	27,664.00	0.02

337	002353	杰瑞股份	1,100	27,643.00	0.02
338	001872	招商港口	1,600	27,632.00	0.02
339	000878	云南铜业	2,500	27,625.00	0.02
340	000887	中鼎股份	2,100	27,489.00	0.02
341	002430	杭氧股份	800	27,488.00	0.02
342	002244	滨江集团	3,100	27,342.00	0.02
343	300070	碧水源	5,100	27,336.00	0.02
344	300012	华测检测	1,400	27,300.00	0.02
345	002506	协鑫集成	9,300	27,249.00	0.02
346	601216	君正集团	6,600	27,060.00	0.02
347	601788	光大证券	1,700	27,013.00	0.02
348	000778	新兴铸管	6,600	26,928.00	0.02
349	002030	达安基因	2,700	26,919.00	0.02
350	000039	中集集团	3,900	26,871.00	0.02
351	000762	西藏矿业	900	26,667.00	0.02
352	000937	冀中能源	4,100	26,158.00	0.02
353	301267	华夏眼科	424	25,842.80	0.02
354	688472	阿特斯	557	9,602.68	0.01
355	301310	鑫宏业	128	8,373.76	0.01
356	301383	天键股份	180	6,429.60	0.00
357	688523	航天环宇	238	6,052.34	0.00
358	301291	明阳电气	183	5,777.31	0.00
359	688543	国科军工	103	5,533.16	0.00
360	688334	西高院	314	5,400.80	0.00
361	301225	恒勃股份	156	5,347.68	0.00
362	301262	海看股份	199	5,168.03	0.00
363	688429	时创能源	184	5,129.92	0.00
364	301210	金杨股份	103	5,120.13	0.00
365	688041	海光信息	69	4,710.63	0.00
366	301355	南王科技	264	4,548.72	0.00
367	301170	锡南科技	119	4,237.59	0.00
368	688570	天玛智控	166	4,226.36	0.00
369	300804	广康生化	124	4,104.40	0.00
370	688631	莱斯信息	130	4,015.70	0.00
371	688623	双元科技	44	3,929.64	0.00
372	301376	致欧科技	172	3,882.04	0.00
373	301323	新莱福	94	3,864.34	0.00
374	301232	飞沃科技	66	3,859.68	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	600519	贵州茅台	6,130,223.00	5.01
2	601318	中国平安	4,453,292.00	3.64
3	300750	宁德时代	3,744,246.00	3.06
4	000858	五粮液	3,105,662.00	2.54
5	600036	招商银行	2,887,592.58	2.36
6	002594	比亚迪	2,526,918.00	2.06
7	000333	美的集团	2,413,643.50	1.97
8	600900	长江电力	2,217,377.00	1.81
9	000895	双汇发展	2,133,980.00	1.74
10	601398	工商银行	2,096,918.00	1.71
11	600276	恒瑞医药	2,040,853.53	1.67
12	601138	工业富联	2,036,731.00	1.66
13	000768	中航西飞	2,034,228.00	1.66
14	601919	中远海控	1,930,586.00	1.58
15	601166	兴业银行	1,857,966.00	1.52
16	601012	隆基绿能	1,822,213.72	1.49
17	601939	建设银行	1,786,676.00	1.46
18	000001	平安银行	1,773,139.00	1.45
19	300059	东方财富	1,773,082.00	1.45
20	002352	顺丰控股	1,681,216.00	1.37

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	600519	贵州茅台	7,055,459.00	5.77
2	300750	宁德时代	4,062,310.00	3.32
3	601318	中国平安	3,750,480.00	3.06
4	600036	招商银行	3,417,178.00	2.79
5	000568	泸州老窖	3,279,604.00	2.68
6	601939	建设银行	3,179,331.00	2.60
7	000792	盐湖股份	2,902,517.03	2.37
8	601398	工商银行	2,840,279.00	2.32
9	002304	洋河股份	2,655,374.76	2.17
10	600030	中信证券	2,597,187.40	2.12
11	688981	中芯国际	2,566,419.36	2.10
12	601600	中国铝业	2,447,585.99	2.00
13	600089	特变电工	2,440,620.00	1.99
14	600900	长江电力	2,437,169.00	1.99
15	002714	牧原股份	2,429,836.36	1.99
16	600941	中国移动	2,416,535.90	1.97

17	600438	通威股份	2,278,272.00	1.86
18	600028	中国石化	2,224,544.00	1.82
19	002466	天齐锂业	2,099,733.00	1.72
20	300122	智飞生物	2,030,672.00	1.66

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	220,062,983.46
卖出股票收入（成交）总额	201,567,742.58

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,812,368.69	6.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,812,368.69	6.14

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	019694	23 国债 01	64,000	6,471,017.21	4.51
2	019679	22 国债 14	23,000	2,341,351.48	1.63
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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

本基金所持有的招商银行(600036.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被中国银行保险监督管理委员会多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的工商银行(601398.SH)于近一年内公告了中国工商银行股份有限公司云南省分行等多个分支机构及其高管被中国银行保险监督管理委员会云南监管局等监管机构分别处以处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

以上事项不会对各公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告或者量化投资策略，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、合规法务部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资上述公司主要基于以下原因：该基金基于基本面进行选股，选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

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	62,579.79
2	应收清算款	141,836.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	204,465.28

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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
东方量化多策略混合 A	608	49,493.28	24,732,161.50	82.19	5,359,753.85	17.81
东方量化多策略混合 C	50	3,023,719.89	151,122,822.56	99.96	63,172.09	0.04
合计	658	275,498.34	175,854,984.06	97.01	5,422,925.94	2.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	东方量化多策略混合 A	763,599.36	2.54
	东方量化多策略混合 C	1.01	0.00
	合计	763,600.37	0.42

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方量化多策略混合 A	东方量化多策略混合 C
基金合同生效日 (2019年2月22日) 基金份额总额	330,005,184.34	-
本报告期期初基金份额总额	70,891,621.51	80,700,618.50
本报告期基金总申购份额	261,720.99	154,170,003.19
减：本报告期基金总赎回份额	41,061,427.15	83,684,627.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,091,915.35	151,185,994.65

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，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、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、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

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 (%)	
德邦证券股份有限公司	2	346,709,449.55	82.52	322,892.56	82.52	-
太平洋证券股份有限公司	2	73,329,478.54	17.45	68,290.93	17.45	-
长江证券股份有限公司	2	92,933.76	0.02	86.54	0.02	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

公司						
申万宏源 证券有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

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

（3）本报告期内，本基金交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
德邦证券股份有限公司	11,188,121.00	100.00	-	-	-	-

太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方量化多策略混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 19 日
2	关于增加和合期货有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 10 日
3	关于增加平安银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
4	关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 2 日

5	关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 9 日
6	东方量化多策略混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 29 日
7	东方量化多策略混合型证券投资基金恢复 100 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	2023 年 4 月 1 日
8	东方量化多策略混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 22 日
9	关于增加华西证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
10	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
11	关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司行 E 通平台费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
12	关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 日

§ 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	20230210	24,732,16	-	-	24,732,161.50	13.64

		- 20230410	1.50				
产品	1	20230411	-	48,921,8	-	48,921,868.83	26.99
		- 20230630		68.83			
	2	20230101	37,203,71	-	37,203,71	-	-
		- 20230209	7.96		7.96		
	3	20230101	42,731,60	-	42,731,60	-	-
		- 20230213	9.54		9.54		
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、《东方量化多策略混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方量化多策略混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 31 日