

西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2026年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	73

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	76
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示.....	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§13 备查文件目录.....	81
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东财量化精选混合	
基金主代码	009840	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年07月29日	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	135,628,490.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财量化精选混合A	东财量化精选混合C
下属分级基金的交易代码	009840	009841
报告期末下属分级基金的份额总额	91,855,637.22份	43,772,853.36份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	在大类资产配置方面，本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的配置比例。在股票投资方面，本基金运用多因子选股策略、事件驱动策略、套利策略等多个量化策略进行选股。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	东财基金管理有限公司	广发证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	顾勇	罗琦
	联系电话	021-23526999	020-66338888
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	95575
传真		021-23526940	020-87553363-6847
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 国际总部城10栋楼2层01室	广东省广州市黄埔区中新广州 知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号 金座5楼	广州市天河区马场路26号广 发证券大厦34楼
邮政编码		200030	510627
法定代表人		戴彦	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金年度报告备置地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号21楼
注册登记机构	东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指	2025年	2024年	2023年
--------------	-------	-------	-------

标	东财量 化精选 混合A	东财量 化精选 混合C	东财量 化精选 混合A	东财量 化精选 混合C	东财量 化精选 混合A	东财量 化精选 混合C
本期已实现收益	18,834,8 19.21	8,096,73 4.81	-3,132,88 1.65	-1,711,1 10.52	-29,190,5 12.20	-13,323, 190.50
本期利润	7,658,29 4.88	3,307,44 2.17	9,119,81 2.29	3,561,07 2.57	-25,977,1 35.67	-10,877, 331.31
加权平均基金份额 本期利润	0.0696	0.0656	0.0680	0.0596	-0.1736	-0.1573
本期加权平均净值 利润率	8.78%	8.60%	9.57%	8.67%	-22.38%	-20.77%
本期基金份额净值 增长率	9.71%	8.85%	9.98%	9.08%	-19.75%	-20.37%
3.1.2 期末数据和指 标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	-14,205,7 85.05	-8,342,5 33.16	-29,486,8 73.98	-14,299, 289.48	-42,136,0 92.77	-20,162, 829.47
期末可供分配基金 份额利润	-0.1547	-0.1906	-0.2295	-0.2564	-0.2994	-0.3183
期末基金资产净值	77,649,8 52.17	35,430,3 20.20	98,973,6 21.89	41,478,4 48.44	98,621,2 04.01	43,180,0 32.51
期末基金份额净值	0.8453	0.8094	0.7705	0.7436	0.7006	0.6817
3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值 增长率	-15.47%	-19.06%	-22.95%	-25.64%	-29.94%	-31.83%

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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

东财量化精选混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	1.23%	0.17%	0.81%	0.80%	0.42%
过去六个月	9.91%	1.08%	15.61%	0.76%	-5.70%	0.32%
过去一年	9.71%	1.02%	16.81%	0.81%	-7.10%	0.21%
过去三年	-3.17%	1.08%	20.91%	0.89%	-24.08%	0.19%
过去五年	-19.60%	1.22%	1.43%	0.91%	-21.03%	0.31%
自基金合同生效起至今	-15.47%	1.21%	10.24%	0.91%	-25.71%	0.30%

东财量化精选混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.77%	1.23%	0.17%	0.81%	0.60%	0.42%
过去六个月	9.48%	1.08%	15.61%	0.76%	-6.13%	0.32%
过去一年	8.85%	1.02%	16.81%	0.81%	-7.96%	0.21%
过去三年	-5.45%	1.08%	20.91%	0.89%	-26.36%	0.19%
过去五年	-22.76%	1.22%	1.43%	0.91%	-24.19%	0.31%
自基金合同生效起至今	-19.06%	1.21%	10.24%	0.91%	-29.30%	0.30%

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

东财量化精选混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年07月29日-2025年12月31日)



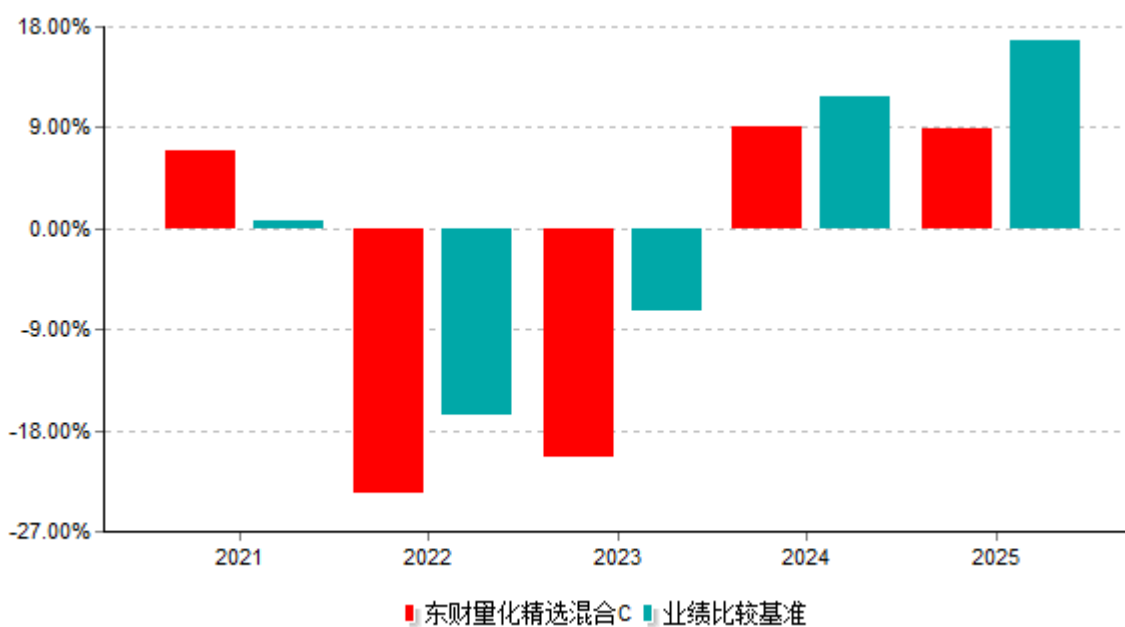
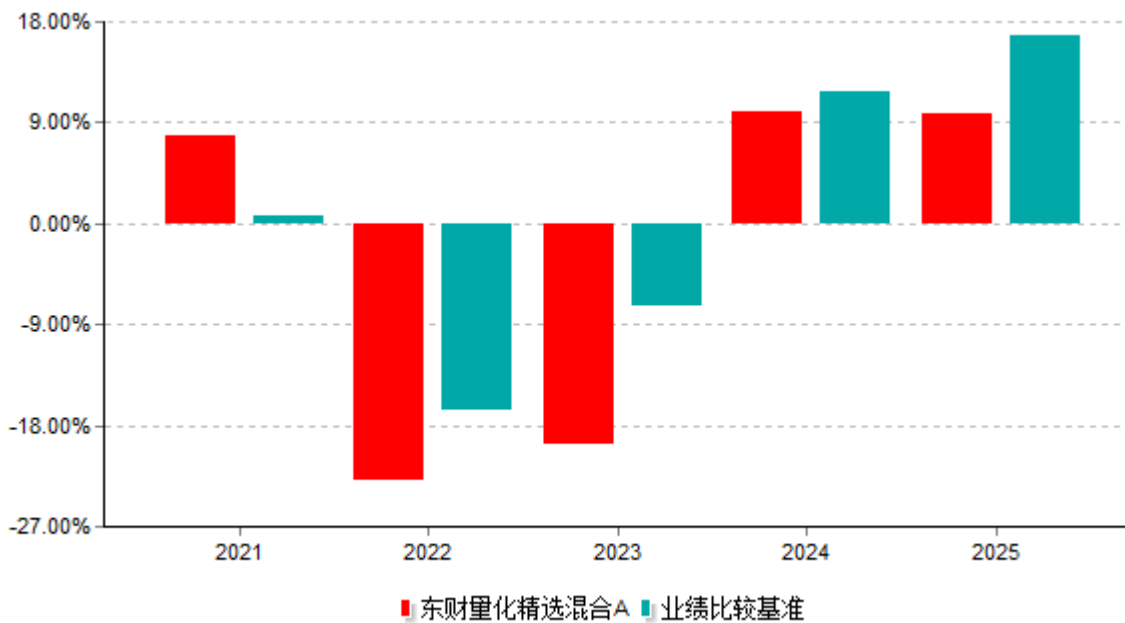
东财量化精选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年07月29日-2025年12月31日)



注：1、本基金基金合同于2020年7月29日生效。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2025年12月31日，公司旗下管理61只证券投资基金--西藏东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金、西藏东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财产业优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财时代优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财成长优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财价值启航混合型发起式证券投资基金、西藏东财产业智选混合型发起式证券投资基金、西藏东财远见成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财瑞利债券型证券投资基金、西藏东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、西藏东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证500交易型

开放式指数证券投资基金、西藏东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、西藏东财启和混合型证券投资基金。

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		
杨路炜	本基金基金经理	2025-07-28	-	9.5年	北京大学软件工程（金融工程方向）硕士。曾任兴业经济研究咨询股份有限公司分析师，现任东财基金管理有限公司基金经理。
吴逸	本基金基金经理	2020-07-29	2025-07-31	15.5年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。曾任天治基金管理有限公司产品创新及量化投资部总监助理、东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、东财基金管理有限公司研究部总监，现任东财基金管理有限公司总经理助理、量化投资部总监、指数投资部总监、基金经理。

姚楠燕	本基金基金经理助理	2020-11-04	-	8.5年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、东财基金管理有限公司筹备组成员，现任东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。
-----	-----------	------------	---	------	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司内部制度，制定了《公平交易管理制度》。

本基金基金管理人建立科学规范的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露确保公平交易过程和结果的监督。

在投资决策的内部控制方面，研究员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围等，建立不同投资组合的投资对象备选库，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。交易执行中，交易员执行投资交易系统内的公平交易程序，并严格按照价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则执行交易指令，确保交易执行的公平性。

行为监控方面，建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核；对交易价格的公允性进行审查，相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）对不同投资组合的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，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。

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

投资运作方面，本基金目前主要投资于A股小微市值上市公司。个股选择上，我们采取的主要是自下而上“捡烟蒂”的打法，通过量化模型挖掘有业绩修复潜力的小微盘股票并在左侧低位埋伏、右侧逢高获利了结。具体来说，我们重点关注市值较小、业绩处于阶段性低谷期的公司，并选择在股价处于相对低位、交投较为平淡、市场尚未意识到其未来业绩修复潜力的阶段介入。我们通过量化模型持有一篮子几百只具有这一类型特征的股票，并分散持仓。当某只持仓个股的市场关注度提高、情绪火热后，我们会相机在高位获利了结，不赚最后一分钱，放弃鱼尾行情。

我们的投资理念和价值投资类似，于无人问津时买入，在人声鼎沸时卖出。但在具体标的上更偏好沪深两市无人问津的小微市值公司进行操作，交易的周期也更短，换手率较传统价值投资更高。

展望未来，本基金将继续坚持股票基本面与交易面结合的投资策略，挖掘A股小微市值上市公司中高性价比个股的投资机会，力争为投资者获取良好的长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，东财量化精选混合A份额净值为0.8453元，报告期内基金份额净值增长率为9.71%，同期业绩比较基准收益率为16.81%；东财量化精选混合C份额净值为0.8094元，报告期内基金份额净值增长率为8.85%，同期业绩比较基准收益率为16.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年，中国经济顶压前行、向新向优，全年GDP突破140万亿，按不变价格计算增长5.0%。需求端，消费支撑作用凸显，最终消费支出贡献率达52%，拉动GDP增长2.6个百分点。投资结构持续优化，虽然全国固定资产投资（不含农户）同比下降3.8%，但设备工器具购置投资增长11.8%，高技术服务业投资增长3.5%，有效对冲了整体投资下行压力。净出口稳中提质，货物进出口总额同比增长3.8%，其中高技术产品出口增长13.2%。新质生产力发展方面，科技创新引领产业升级，规模以上高技术制造业增加值增长9.4%，高技术服务业企业营业收入增长7.9%，数字经济、高端装备制造等领域动能强劲。

市场方面，2025年A股呈现慢牛行情，全年成交额创历史新高，最终上证指数、深证成指、创业板指分别累计上涨18.41%、29.87%、49.57%，沪指收官点位创下2007年以来近18年新高。行业板块方面，2025年，申万一级31个行业呈现“涨多跌少”格局，分化特征显著，其中26个行业实现上涨，有色金属、通信、电子行业涨幅居前，分别累计上涨94.73%、84.75%、47.88%；食品饮料、煤炭行业跌幅居前，分别累计下跌9.69%、5.27%，成为全年唯二下跌的行业。

展望2026年，随着中国经济高质量发展持续推进，新质生产力加速壮大，A股盈利基本面将进一步夯实。投资者风险偏好有望延续提升，市场交易活跃度保持高位，行业结构性机会将向高端制造、数字经济、科技创新等核心领域集中。从流动性与估值视角看，2026年A股流动性有望保持合理充裕，内外增量资金持续进场，估值修复空间进一步打开。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金基金管理人坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；同时依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。本基金基金管理人根据法律法规、监管政策的变化和业务发展情况，从合规运作、维护基金份额持有人利益的角度出发，持续完善内部

控制制度和流程，加强内部风险的控制与防范，确保内控体系和各项制度措施的落实，有效保障了公司各项业务合法合规的有序开展。

报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：一是执行监察稽核信息动态通报与执行跟进机制，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是通过相关内部以及外部合规风控培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；三是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善各项管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行与风险事件；四是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；五是采取事前、事中和事后三阶段的防范控制工作，从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；六是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施；八是重视反洗钱各项工作，包括制度建设、系统功能优化、宣传培训、日常监测等方面，积极采取有效的防范措施控制洗钱的风险。

报告期内，本基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。本基金基金管理人将继续坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金资产净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布基金份额净值。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者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

本报告期内，本基金托管人在对西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在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

本报告期内，东财基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对东财基金管理有限公司编制和披露的西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2025年年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报（审）字（26）第P00826号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金 全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>东财基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在</p>

	<p>重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人的管理层计划清算西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪</p>

	<p>造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曾浩、胡本竞
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号21楼
审计报告日期	2026-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	16,516,171.78	10,596,204.28
结算备付金		23.07	22.89
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	97,482,349.07	130,321,586.62
其中：股票投资		97,482,349.07	130,321,586.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,598.49	29.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		114,003,142.41	140,917,843.77
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		458,491.36	86,390.32
应付管理人报酬		116,434.61	144,712.36
应付托管费		9,702.88	12,059.37
应付销售服务费		24,300.27	28,611.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	314,040.92	194,000.29
负债合计		922,970.04	465,773.44
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	135,628,490.58	184,238,233.79
未分配利润	7.4.7.8	-22,548,318.21	-43,786,163.46
净资产合计		113,080,172.37	140,452,070.33
负债和净资产总计		114,003,142.41	140,917,843.77

注：报告截止日2025年12月31日，东财量化精选混合A基金份额净值人民币0.8453元，基金份额总额91,855,637.22份；东财量化精选混合C基金份额净值人民币0.8094元，基金份额总额43,772,853.36份。基金份额总额合计为135,628,490.58份。

7.2 利润表

会计主体：西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
一、营业总收入		13,053,258.30	14,927,823.48
1.利息收入		72,003.66	312,395.15

其中：存款利息收入	7.4.7.9	72,003.66	312,395.15
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）		28,925,251.58	-2,915,546.66
其中：股票投资收益	7.4.7.10	26,880,097.23	-4,974,877.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,045,154.35	2,059,331.04
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-15,965,816.97	17,524,877.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	21,820.03	6,097.96
减：二、营业总支出		2,087,521.25	2,246,938.62
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,509,926.55	1,637,553.64
2.托管费	7.4.10.2.2	125,827.20	136,462.82
3.销售服务费	7.4.10.2.3	307,767.50	328,922.16
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	144,000.00	144,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,965,737.05	12,680,884.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,965,737.05	12,680,884.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,965,737.05	12,680,884.86

7.3 净资产变动表

会计主体：西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	184,238,233.79	-43,786,163.46	140,452,070.33
二、本期期初净资产	184,238,233.79	-43,786,163.46	140,452,070.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,609,743.21	21,237,845.25	-27,371,897.96
（一）、综合收益总额	-	10,965,737.05	10,965,737.05
（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）	-48,609,743.21	10,272,108.20	-38,337,635.01

其中：1.基金申购款	11,155,016.00	-2,332,190.36	8,822,825.64
2.基金赎回款	-59,764,759.21	12,604,298.56	-47,160,460.65
（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、本期期末净资产	135,628,490.58	-22,548,318.21	113,080,172.37
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	204,100,158.76	-62,298,922.24	141,801,236.52
二、本期期初净资产	204,100,158.76	-62,298,922.24	141,801,236.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,861,924.97	18,512,758.78	-1,349,166.19
（一）、综合收益总额	-	12,680,884.86	12,680,884.86
（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）	-19,861,924.97	5,831,873.92	-14,030,051.05
其中：1.基金申购款	8,174,226.34	-2,183,568.86	5,990,657.48
2.基金赎回款	-28,036,151.31	8,015,442.78	-20,020,708.53
（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、本期期末净资产	184,238,233.79	-43,786,163.46	140,452,070.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

顾勇

侯福岩

陆文澄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司(原西藏东财基金管理有限公司，已于2025年9月15日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1286号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为1,076,139,276.86份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（20）第00012号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2020年7月29日正式生效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、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、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在

一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

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

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

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

（2）金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

（2）投资收益

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

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，

逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

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

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

（3）公允价值变动收益

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

（4）信用减值损失

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

（5）其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值；

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用

指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值；

(3) 根据中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、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[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]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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发

生的资管产品运营业务，以基金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；

(2) 对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税；

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券（股票）交易印花税；

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	2,827,831.32	3,607,205.70
等于：本金	2,827,329.59	3,606,650.98
加：应计利息	501.73	554.72
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	13,688,340.46	6,988,998.58
等于：本金	13,687,106.09	6,987,774.89
加：应计利息	1,234.37	1,223.69
减：坏账准备	-	-
合计	16,516,171.78	10,596,204.28

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	101,672,334.37	-	97,482,349.07	-4,189,985.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	101,672,334.37	-	97,482,349.07	-4,189,985.30
项目	上年度末 2024年12月31日			

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	118,545,754.95	-	130,321,586.62	11,775,831.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	118,545,754.95	-	130,321,586.62	11,775,831.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	40.92	0.29
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	24,000.00	24,000.00
预提费用-信息披露费	290,000.00	170,000.00
合计	314,040.92	194,000.29

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东财量化精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (东财量化精选混合A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,460,495.87	128,460,495.87
本期申购	5,974,597.35	5,974,597.35
本期赎回（以“-”号填列）	-42,579,456.00	-42,579,456.00
本期末	91,855,637.22	91,855,637.22

7.4.7.7.2 东财量化精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (东财量化精选混合C)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,777,737.92	55,777,737.92
本期申购	5,180,418.65	5,180,418.65
本期赎回（以“-”号填列）	-17,185,303.21	-17,185,303.21
本期末	43,772,853.36	43,772,853.36

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东财量化精选混合A

单位：人民币元

项目 (东财量化精选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,080,254.13	-3,406,619.85	-29,486,873.98
本期期初	-26,080,254.13	-3,406,619.85	-29,486,873.98
本期利润	18,834,819.21	-11,176,524.33	7,658,294.88
本期基金份额交易产生的变动数	4,587,325.53	3,035,468.52	7,622,794.05
其中：基金申购款	-694,461.30	-487,527.38	-1,181,988.68
基金赎回款	5,281,786.83	3,522,995.90	8,804,782.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,658,109.39	-11,547,675.66	-14,205,785.05

7.4.7.8.2 东财量化精选混合C

单位：人民币元

项目 (东财量化精选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,715,666.85	-1,583,622.63	-14,299,289.48
本期期初	-12,715,666.85	-1,583,622.63	-14,299,289.48
本期利润	8,096,734.81	-4,789,292.64	3,307,442.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,696,014.23	953,299.92	2,649,314.15
其中：基金申购款	-667,462.78	-482,738.90	-1,150,201.68
基金赎回款	2,363,477.01	1,436,038.82	3,799,515.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,922,917.81	-5,419,615.35	-8,342,533.16

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	17,400.36	47,380.23

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	54,603.12	139,229.62
结算备付金利息收入	0.18	125,785.30
其他	-	-
合计	72,003.66	312,395.15

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	720,955,036.02	227,004,902.00
减：卖出股票成本总额	693,064,550.65	231,636,216.39
减：交易费用	1,010,388.14	343,563.31
买卖股票差价收入	26,880,097.23	-4,974,877.70

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,045,154.35	2,059,331.04
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	2,045,154.35	2,059,331.04

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	-15,965,816.97	17,524,877.03
——股票投资	-15,965,816.97	17,524,877.03
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-15,965,816.97	17,524,877.03

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日

基金赎回费收入	21,441.24	5,662.44
转换费收入	378.79	435.52
合计	21,820.03	6,097.96

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	24,000.00	24,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	144,000.00	144,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海天天基金销售有限公司（“天天”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基

基金”)	金销售机构
-------	-------

注：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,396,518,283.49	100.00%	481,600,450.73	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	553,286.53	100.00%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	199,181.89	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,509,926.55	1,637,553.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	721,250.39	754,603.87
应支付基金管理人的净管理费	788,676.16	882,949.77

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	125,827.20	136,462.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财量化精选混合A	东财量化精选混合C	合计
天天基金	0.00	262,268.51	262,268.51
广发证券	0.00	11,617.28	11,617.28
东财证券	0.00	29,982.74	29,982.74
合计	0.00	303,868.53	303,868.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财量化精选混合A	东财量化精选混合C	合计
天天基金	0.00	271,695.22	271,695.22
广发证券	0.00	16,872.29	16,872.29
东财证券	0.00	36,220.42	36,220.42
合计	0.00	324,787.93	324,787.93

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

东财量化精选混合A

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,951,014.83	10,951,014.83
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,951,014.83	-
报告期末持有的基金份额	0.00	10,951,014.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	8.52%

东财量化精选混合C

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至	上年度可比期间 2024年01月01日至
----	--------------------	-------------------------

	2025年12月31日	2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券-托管户	2,827,831.32	17,400.36	3,607,205.70	47,380.23
广发证券-证券资金户	13,688,340.46	54,603.12	6,988,998.58	139,229.62

注：1、本基金的银行存款存放在托管人广发证券在交通银行股份有限公司开立的托管账户中，本基金本报告期内无源自本基金托管人广发证券的银行存款及利息收入。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于广发证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	新股限售	12.48	25.46	768	9,584.64	19,553.28	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	新股限售	22.63	57.07	95	2,149.85	5,421.65	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股限售	21.93	54.39	94	2,061.42	5,112.66	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	新股限售	21.00	44.80	109	2,289.00	4,883.20	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	新股限售	36.80	65.23	70	2,576.00	4,566.10	-
603262	技源集团	2025-07-16	6个月	新股限售	10.88	28.10	115	1,251.20	3,231.50	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6个月	新股限售	6.85	12.89	190	1,301.50	2,449.10	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	新股限售	23.60	40.16	56	1,321.60	2,248.96	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	新股限售	22.29	35.39	54	1,203.66	1,911.06	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	新股限售	42.28	56.08	31	1,310.68	1,738.48	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、合规审计部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了投资银行存款白名单，通过对存款银行的信用评估来控制银行存款信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指开放式基金未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因投资品种交易不活跃而出现的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现投资。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,516,171.78	-	-	-	16,516,171.78
结算备付金	23.07	-	-	-	23.07
交易性金融资产	-	-	-	97,482,349.07	97,482,349.07

应收申购款	-	-	-	4,598.49	4,598.49
资产总计	16,516,194.85	-	-	97,486,947.56	114,003,142.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	458,491.36	458,491.36
应付管理人报酬	-	-	-	116,434.61	116,434.61
应付托管费	-	-	-	9,702.88	9,702.88
应付销售服务费	-	-	-	24,300.27	24,300.27
其他负债	-	-	-	314,040.92	314,040.92
负债总计	-	-	-	922,970.04	922,970.04
利率敏感度缺口	16,516,194.85	-	-	96,563,977.52	113,080,172.37
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,596,204.28	-	-	-	10,596,204.28
结算备付金	22.89	-	-	-	22.89
交易性金融资产	-	-	-	130,321,586.62	130,321,586.62
应收申购款	-	-	-	29.98	29.98

资产总计	10,596,227.17	-	-	130,321,616.60	140,917,843.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	86,390.32	86,390.32
应付管理人报酬	-	-	-	144,712.36	144,712.36
应付托管费	-	-	-	12,059.37	12,059.37
应付销售服务费	-	-	-	28,611.10	28,611.10
其他负债	-	-	-	194,000.29	194,000.29
负债总计	-	-	-	465,773.44	465,773.44
利率敏感度缺口	10,596,227.17	-	-	129,855,843.16	140,452,070.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策进行分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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	97,482,349.07	86.21	130,321,586.62	92.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	97,482,349.07	86.21	130,321,586.62	92.79

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	5,629,499.63	7,414,762.18
业绩比较基准下降5%	-5,629,499.63	-7,414,762.18	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	97,431,233.08	129,704,730.00
第二层次	-	548,391.80
第三层次	51,115.99	68,464.82
合计	97,482,349.07	130,321,586.62

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和债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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	68,464.82	68,464.82
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	70,702.23	70,702.23
转出第三层次	-	239,937.09	239,937.09
当期利得或损失总额	-	151,886.03	151,886.03
其中：计入损益的利得或损失	-	151,886.03	151,886.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	51,115.99	51,115.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	26,066.44	26,066.44
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	359,583.27	359,583.27
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	21,090.98	21,090.98
转出第三层次	-	300,747.74	300,747.74

当期利得或损失总额	-	-11,461.69	-11,461.69
其中：计入损益的利得或损失	-	-11,461.69	-11,461.69
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	68,464.82	68,464.82
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	47,373.84	47,373.84

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	51,115.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1800-2.4267	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	68,464.82	平均价格亚式期权模型	预期波动率	2.3834-4.9648	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2024年12月31日：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	97,482,349.07	85.51
	其中：股票	97,482,349.07	85.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	16,516,194.85	14.49
8	其他各项资产	4,598.49	0.00
9	合计	114,003,142.41	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,258,109.00	1.11
B	采矿业	277,160.00	0.25
C	制造业	68,652,345.89	60.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,061,182.00	1.82
E	建筑业	1,545,065.00	1.37

F	批发和零售业	4,324,349.00	3.82
G	交通运输、仓储和邮政业	766,450.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,402,672.58	5.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,086,948.00	0.96
L	租赁和商务服务业	1,183,880.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	5,433,224.16	4.80
N	水利、环境和公共设施管理业	3,005,731.44	2.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	303,849.00	0.27
Q	卫生和社会工作	389,625.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	791,758.00	0.70
S	综合	-	-
	合计	97,482,349.07	86.21

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603700	宁水集团	36,300	493,317.00	0.44
2	002968	新大正	39,400	479,104.00	0.42
3	300743	天地数码	21,300	475,416.00	0.42
4	002576	通达动力	27,200	473,280.00	0.42
5	603331	百达精工	32,800	467,400.00	0.41
6	603637	镇海股份	42,800	465,236.00	0.41
7	000419	通程控股	72,700	464,553.00	0.41
8	300851	交大思诺	17,300	463,467.00	0.41

9	301203	国泰环保	14,196	463,357.44	0.41
10	001219	青岛食品	32,500	463,125.00	0.41
11	600128	苏豪弘业	42,100	462,679.00	0.41
12	003017	大洋生物	15,400	459,844.00	0.41
13	002687	乔治白	95,100	458,382.00	0.41
14	002479	富春环保	93,000	455,700.00	0.40
15	301135	瑞德智能	16,200	455,220.00	0.40
16	603307	扬州金泉	11,500	452,065.00	0.40
17	603161	科华控股	32,900	451,717.00	0.40
18	688113	联测科技	11,400	450,642.00	0.40
19	301156	美农生物	25,700	450,007.00	0.40
20	300826	测绘股份	26,300	449,730.00	0.40
21	300845	捷安高科	39,800	448,546.00	0.40
22	300828	锐新科技	26,600	447,678.00	0.40
23	301107	瑜欣电子	15,800	446,192.00	0.39
24	002863	今飞凯达	75,900	445,533.00	0.39
25	301106	骏成科技	14,900	443,573.00	0.39
26	605033	美邦股份	22,000	441,760.00	0.39
27	300519	新光药业	29,500	439,550.00	0.39
28	300823	建科智能	28,140	439,546.80	0.39
29	600356	恒丰纸业	50,000	439,000.00	0.39
30	301006	迈拓股份	26,600	438,634.00	0.39
31	600082	海泰发展	108,000	438,480.00	0.39
32	301170	锡南科技	15,600	436,020.00	0.39
33	605258	协和电子	13,900	434,653.00	0.38
34	603282	亚光股份	21,900	434,496.00	0.38
35	300800	力合科技	37,300	433,799.00	0.38
36	688092	爱科科技	17,200	432,408.00	0.38
37	605151	西上海	22,800	430,692.00	0.38
38	300645	正元智慧	22,900	428,917.00	0.38
39	688468	科美诊断	58,300	427,922.00	0.38

40	603096	新经典	24,500	426,790.00	0.38
41	603102	百合股份	9,900	425,403.00	0.38
42	301233	盛帮股份	8,000	423,360.00	0.37
43	600051	宁波联合	56,100	422,994.00	0.37
44	002381	双箭股份	63,800	420,442.00	0.37
45	688056	莱伯泰科	12,500	420,125.00	0.37
46	002817	黄山胶囊	55,100	418,760.00	0.37
47	002802	洪汇新材	33,600	417,984.00	0.37
48	603182	嘉华股份	26,400	417,648.00	0.37
49	301065	本立科技	19,500	416,325.00	0.37
50	003008	开普检测	19,300	415,915.00	0.37
51	603682	锦和商管	62,900	414,511.00	0.37
52	003011	海象新材	18,800	414,352.00	0.37
53	603029	天鹅股份	22,600	412,224.00	0.36
54	300694	蠡湖股份	34,100	411,928.00	0.36
55	603073	彩蝶实业	21,900	411,501.00	0.36
56	002566	益盛药业	53,800	410,494.00	0.36
57	301163	宏德股份	15,200	407,208.00	0.36
58	300371	汇中股份	32,200	404,754.00	0.36
59	301287	康力源	9,700	404,684.00	0.36
60	300717	华信新材	21,200	403,648.00	0.36
61	301063	海锅股份	16,500	402,765.00	0.36
62	300387	富邦科技	47,300	402,523.00	0.36
63	301131	聚赛龙	8,300	400,641.00	0.35
64	600854	春兰股份	80,100	399,699.00	0.35
65	688395	正弦电气	16,400	398,848.00	0.35
66	001228	永泰运	15,100	396,224.00	0.35
67	603797	联泰环保	84,500	394,615.00	0.35
68	001210	金房能源	23,000	393,990.00	0.35
69	000605	渤海股份	58,200	390,522.00	0.35
70	002873	新天药业	39,300	389,856.00	0.34

71	603022	新通联	37,800	388,206.00	0.34
72	603041	美思德	32,100	386,805.00	0.34
73	300549	优德精密	20,500	386,630.00	0.34
74	300992	泰福泵业	14,300	386,100.00	0.34
75	688314	康拓医疗	11,582	382,900.92	0.34
76	300923	研奥股份	14,800	377,844.00	0.33
77	002144	宏达高科	29,700	376,893.00	0.33
78	301298	东利机械	23,800	376,516.00	0.33
79	002486	嘉麟杰	120,700	375,377.00	0.33
80	600099	林海股份	35,600	372,020.00	0.33
81	300254	仟源医药	36,600	370,392.00	0.33
82	605567	春雪食品	33,600	369,600.00	0.33
83	301359	东南电子	19,300	369,016.00	0.33
84	301081	严牌股份	36,300	367,719.00	0.33
85	300804	广康生化	10,500	367,500.00	0.32
86	301115	联检科技	23,200	366,792.00	0.32
87	001260	坤泰股份	18,200	366,184.00	0.32
88	002247	聚力文化	130,000	365,300.00	0.32
89	300514	友讯达	27,600	364,596.00	0.32
90	688067	爱威科技	14,800	363,488.00	0.32
91	300610	晨化股份	31,200	362,232.00	0.32
92	688309	恒誉环保	15,000	361,950.00	0.32
93	301502	华阳智能	8,100	361,908.00	0.32
94	301272	英华特	8,800	361,240.00	0.32
95	688355	明志科技	19,900	354,220.00	0.31
96	300243	瑞丰高材	33,900	353,577.00	0.31
97	603183	建研院	82,000	353,420.00	0.31
98	300936	中英科技	9,000	351,000.00	0.31
99	001202	炬申股份	22,100	350,506.00	0.31
100	301577	美信科技	6,200	350,052.00	0.31
101	300412	迦南科技	65,200	348,820.00	0.31

102	603201	常润股份	20,600	347,728.00	0.31
103	002743	富煌钢构	63,800	347,072.00	0.31
104	600137	浪莎股份	18,000	346,140.00	0.31
105	301167	建研设计	21,300	346,125.00	0.31
106	603860	中公高科	11,300	340,921.00	0.30
107	301429	森泰股份	17,900	340,100.00	0.30
108	688479	友车科技	18,000	338,940.00	0.30
109	001231	农心科技	13,500	336,690.00	0.30
110	688310	迈得医疗	21,700	332,661.00	0.29
111	300626	华瑞股份	20,900	332,519.00	0.29
112	688391	钜泉科技	11,700	331,461.00	0.29
113	603318	水发燃气	49,400	330,980.00	0.29
114	301125	腾亚精工	18,000	330,840.00	0.29
115	605186	健麾信息	16,800	330,120.00	0.29
116	301503	智迪科技	9,100	328,146.00	0.29
117	001209	洪兴股份	15,700	327,502.00	0.29
118	603320	迪贝电气	17,082	325,582.92	0.29
119	301130	西点药业	11,400	325,356.00	0.29
120	600235	民丰特纸	47,800	325,040.00	0.29
121	688026	洁特生物	20,100	323,811.00	0.29
122	688589	力合微	14,200	323,050.00	0.29
123	301331	恩威医药	12,200	322,568.00	0.29
124	000548	湖南投资	58,800	319,872.00	0.28
125	688420	美腾科技	13,400	319,858.00	0.28
126	002172	澳洋健康	80,500	319,585.00	0.28
127	603725	天安新材	34,500	319,125.00	0.28
128	000159	国际实业	55,000	317,900.00	0.28
129	002105	信隆健康	43,400	317,688.00	0.28
130	600148	长春一东	16,200	317,034.00	0.28
131	300176	鸿特科技	47,500	316,825.00	0.28
132	301353	普莱得	11,900	316,540.00	0.28

133	301378	通达海	11,100	315,240.00	0.28
134	300187	永清环保	64,400	313,628.00	0.28
135	300335	迪森股份	54,400	313,344.00	0.28
136	600689	上海三毛	23,300	313,152.00	0.28
137	603810	丰山集团	19,600	313,012.00	0.28
138	688329	艾隆科技	14,700	312,963.00	0.28
139	688565	力源科技	27,800	311,082.00	0.28
140	301295	美硕科技	10,400	309,920.00	0.27
141	300977	深圳瑞捷	18,000	309,420.00	0.27
142	002732	燕塘乳业	18,100	308,062.00	0.27
143	600444	国机通用	16,800	307,944.00	0.27
144	300667	必创科技	17,400	307,632.00	0.27
145	603321	梅轮电梯	38,200	307,128.00	0.27
146	002069	獐子岛	82,100	306,233.00	0.27
147	003023	彩虹集团	13,500	305,910.00	0.27
148	688426	康为世纪	12,800	305,024.00	0.27
149	600774	汉商集团	33,300	304,362.00	0.27
150	600455	博通股份	11,700	303,849.00	0.27
151	002820	桂发祥	25,200	303,660.00	0.27
152	300564	筑博设计	19,100	300,825.00	0.27
153	301505	苏州规划	13,500	300,645.00	0.27
154	688338	赛科希德	11,500	297,620.00	0.26
155	301113	雅艺科技	12,400	296,608.00	0.26
156	002999	天禾股份	43,400	296,422.00	0.26
157	603172	万丰股份	16,600	295,480.00	0.26
158	301198	喜悦智行	23,400	293,904.00	0.26
159	300112	万讯自控	34,100	293,601.00	0.26
160	000985	大庆华科	15,300	292,383.00	0.26
161	002495	佳隆股份	109,900	292,334.00	0.26
162	300838	浙江力诺	19,100	291,275.00	0.26
163	300615	欣天科技	21,900	290,832.00	0.26

164	603045	福达合金	14,800	290,820.00	0.26
165	605001	威奥股份	38,100	290,703.00	0.26
166	603968	醋化股份	26,000	290,420.00	0.26
167	301520	万邦医药	7,300	290,029.00	0.26
168	002696	百洋股份	40,900	289,163.00	0.26
169	301118	恒光股份	11,600	287,216.00	0.25
170	688638	誉辰智能	7,900	287,007.00	0.25
171	000856	冀东装备	27,800	285,228.00	0.25
172	301166	优宁维	9,600	284,928.00	0.25
173	603908	牧高笛	12,200	284,870.00	0.25
174	300030	阳普医疗	38,700	284,832.00	0.25
175	002998	优彩资源	37,400	282,370.00	0.25
176	301336	趣睡科技	5,400	278,910.00	0.25
177	000757	浩物股份	57,200	278,564.00	0.25
178	688517	金冠电气	17,835	278,047.65	0.25
179	301027	华蓝集团	15,100	277,991.00	0.25
180	002828	贝肯能源	26,000	277,160.00	0.25
181	300605	恒锋信息	17,500	273,875.00	0.24
182	300649	杭州园林	18,900	271,404.00	0.24
183	603214	爱婴室	15,800	271,128.00	0.24
184	301045	天禄科技	10,100	267,953.00	0.24
185	002494	华斯股份	49,000	264,110.00	0.23
186	603385	惠达卫浴	38,300	261,972.00	0.23
187	688203	海正生材	20,400	260,712.00	0.23
188	002890	弘宇股份	17,700	258,420.00	0.23
189	000586	汇源通信	18,600	251,658.00	0.22
190	600665	天地源	76,600	251,248.00	0.22
191	600080	金花股份	33,200	250,328.00	0.22
192	688078	龙软科技	9,100	250,250.00	0.22
193	300050	世纪鼎利	44,400	245,532.00	0.22
194	300500	启迪设计	17,700	245,145.00	0.22

195	300865	大宏立	9,000	245,070.00	0.22
196	300970	华绿生物	11,900	244,069.00	0.22
197	300621	维业股份	29,000	243,890.00	0.22
198	301314	科瑞思	5,800	243,716.00	0.22
199	601996	丰林集团	107,800	242,550.00	0.21
200	688328	深科达	8,300	242,194.00	0.21
201	600423	柳化股份	64,800	241,056.00	0.21
202	002397	梦洁股份	59,700	240,591.00	0.21
203	300599	雄塑科技	29,500	240,425.00	0.21
204	301578	辰奕智能	7,100	239,838.00	0.21
205	300778	新城市	17,200	238,736.00	0.21
206	000573	粤宏远 A	57,800	238,714.00	0.21
207	688485	九州一轨	13,300	237,272.00	0.21
208	002921	联诚精密	13,500	229,770.00	0.20
209	688659	元琛科技	24,100	227,745.00	0.20
210	600359	新农开发	31,800	227,370.00	0.20
211	002159	三特索道	14,800	226,884.00	0.20
212	300234	开尔新材	41,200	226,600.00	0.20
213	688218	江苏北人	9,900	225,918.00	0.20
214	688045	必易微	5,800	224,402.00	0.20
215	002857	三晖电气	10,800	223,992.00	0.20
216	301197	工大科雅	10,700	222,988.00	0.20
217	301418	协昌科技	6,100	222,650.00	0.20
218	002858	力盛体育	14,800	222,000.00	0.20
219	688669	聚石化学	9,500	220,780.00	0.20
220	001278	一彬科技	11,400	220,476.00	0.19
221	688022	瀚川智能	14,400	220,320.00	0.19
222	301126	达嘉维康	17,900	219,991.00	0.19
223	688069	德林海	9,800	219,814.00	0.19
224	603176	汇通集团	41,700	219,342.00	0.19
225	603208	江山欧派	15,000	218,250.00	0.19

226	002319	乐通股份	18,000	216,720.00	0.19
227	300635	中达安	13,500	216,405.00	0.19
228	003030	祖名股份	10,700	216,033.00	0.19
229	600371	万向德农	24,700	215,384.00	0.19
230	600476	湘邮科技	13,400	214,534.00	0.19
231	603137	恒尚节能	15,600	214,344.00	0.19
232	001324	长青科技	11,800	212,872.00	0.19
233	688058	宝兰德	7,808	212,611.84	0.19
234	301290	东星医疗	8,400	212,268.00	0.19
235	605180	华生科技	14,500	210,975.00	0.19
236	002760	凤形股份	9,700	210,587.00	0.19
237	688129	东来技术	10,400	210,392.00	0.19
238	001259	利仁科技	7,000	210,070.00	0.19
239	301512	智信精密	4,800	209,952.00	0.19
240	301072	中捷精工	9,300	209,436.00	0.19
241	603488	展鹏科技	26,400	205,920.00	0.18
242	605177	东亚药业	11,500	204,700.00	0.18
243	688163	赛伦生物	9,400	204,638.00	0.18
244	300556	丝路视觉	10,700	203,193.00	0.18
245	002809	红墙股份	19,000	203,110.00	0.18
246	688616	西力科技	16,600	203,018.00	0.18
247	688693	镨威特	5,400	202,176.00	0.18
248	688737	中自科技	9,000	201,960.00	0.18
249	001366	播恩集团	15,100	201,887.00	0.18
250	603536	惠发食品	18,100	201,272.00	0.18
251	688655	迅捷兴	11,700	200,421.00	0.18
252	300517	海波重科	18,100	200,186.00	0.18
253	600778	友好集团	30,000	200,100.00	0.18
254	301519	舜禹股份	14,900	199,958.00	0.18
255	300886	华业香料	7,700	199,507.00	0.18
256	603272	联翔股份	9,900	199,089.00	0.18

257	603937	丽岛新材	16,600	199,034.00	0.18
258	300675	建科院	12,700	198,374.00	0.18
259	603578	三星新材	16,400	198,112.00	0.18
260	600768	宁波富邦	14,100	197,400.00	0.17
261	000663	永安林业	26,700	197,046.00	0.17
262	688681	科汇股份	11,200	196,896.00	0.17
263	688718	唯赛勃	15,000	196,200.00	0.17
264	300931	通用电梯	17,600	194,832.00	0.17
265	301390	经纬股份	5,800	193,430.00	0.17
266	603779	威龙股份	30,000	193,200.00	0.17
267	600241	时代万恒	23,000	192,050.00	0.17
268	300246	宝莱特	23,700	191,970.00	0.17
269	688193	仁度生物	3,963	191,690.31	0.17
270	300966	共同药业	9,700	190,993.00	0.17
271	002780	三夫户外	13,300	190,988.00	0.17
272	300721	怡达股份	15,000	190,950.00	0.17
273	301273	瑞晨环保	7,200	190,728.00	0.17
274	000790	华神科技	49,200	190,404.00	0.17
275	688393	安必平	8,000	189,520.00	0.17
276	688367	工大高科	6,108	189,103.68	0.17
277	600883	博闻科技	23,400	188,604.00	0.17
278	301515	港通医疗	9,400	188,564.00	0.17
279	300958	建工修复	15,000	186,150.00	0.16
280	301588	美新科技	10,200	185,334.00	0.16
281	002883	中设股份	16,500	180,510.00	0.16
282	301372	科净源	7,000	177,520.00	0.16
283	688466	金科环境	10,900	177,343.00	0.16
284	600149	廊坊发展	35,400	176,646.00	0.16
285	688030	山石网科	9,622	174,831.74	0.15
286	688118	普元信息	6,800	173,536.00	0.15
287	300535	达威股份	9,700	173,242.00	0.15

288	300597	吉大通信	18,700	172,788.00	0.15
289	300854	中兰环保	9,900	166,716.00	0.15
290	688004	博汇科技	7,200	166,536.00	0.15
291	688369	致远互联	6,500	165,295.00	0.15
292	001373	翔腾新材	5,100	164,628.00	0.15
293	600533	栖霞建设	63,900	163,584.00	0.14
294	688217	睿昂基因	6,200	163,370.00	0.14
295	301001	凯淳股份	5,500	162,470.00	0.14
296	603818	曲美家居	45,000	162,450.00	0.14
297	300640	德艺文创	20,600	159,444.00	0.14
298	688607	康众医疗	3,500	149,800.00	0.13
299	002712	思美传媒	26,400	146,784.00	0.13
300	603679	华体科技	8,900	143,824.00	0.13
301	301231	荣信文化	4,600	142,968.00	0.13
302	300162	雷曼光电	17,000	138,210.00	0.12
303	002778	中晟高科	6,400	135,296.00	0.12
304	301313	凡拓数创	5,100	135,201.00	0.12
305	603819	神力股份	10,800	131,112.00	0.12
306	600692	亚通股份	18,600	130,386.00	0.12
307	688132	邦彦技术	6,976	128,497.92	0.11
308	300069	金利华电	7,200	124,200.00	0.11
309	301105	鸿铭股份	2,600	123,942.00	0.11
310	003027	同兴科技	5,500	122,650.00	0.11
311	300583	赛托生物	8,900	121,841.00	0.11
312	300935	盈建科	4,000	121,360.00	0.11
313	300417	南华仪器	8,500	118,915.00	0.11
314	688038	中科通达	6,600	116,622.00	0.10
315	000619	海螺新材	17,900	111,159.00	0.10
316	688060	云涌科技	2,500	105,825.00	0.09
317	300883	龙利得	15,300	103,275.00	0.09
318	002799	环球印务	11,900	101,507.00	0.09

319	301169	零点有数	2,000	100,200.00	0.09
320	688096	京源环保	12,500	98,750.00	0.09
321	688021	奥福科技	5,300	97,255.00	0.09
322	300126	锐奇股份	11,200	95,872.00	0.08
323	001336	楚环科技	3,900	95,394.00	0.08
324	688496	清越科技	15,994	95,004.36	0.08
325	300780	德恩精工	4,900	94,472.00	0.08
326	300074	华平股份	20,300	93,583.00	0.08
327	002910	庄园牧场	8,400	93,324.00	0.08
328	300554	三超新材	4,000	92,760.00	0.08
329	002806	华锋股份	7,300	90,958.00	0.08
330	688246	嘉和美康	3,900	90,675.00	0.08
331	300849	锦盛新材	5,700	89,091.00	0.08
332	300025	华星创业	15,300	88,128.00	0.08
333	600159	大龙地产	31,100	86,147.00	0.08
334	688216	气派科技	3,800	84,664.00	0.07
335	300928	华安鑫创	2,500	77,875.00	0.07
336	688528	秦川物联	7,200	77,544.00	0.07
337	688450	光格科技	2,775	76,534.50	0.07
338	600202	哈空调	12,900	75,723.00	0.07
339	000590	古汉医药	6,400	71,744.00	0.06
340	300334	津膜科技	10,300	71,688.00	0.06
341	301139	元道通信	3,900	71,604.00	0.06
342	002524	光正眼科	17,000	70,040.00	0.06
343	002715	登云股份	4,000	69,440.00	0.06
344	688178	万德斯	2,700	64,881.00	0.06
345	603717	天域生物	7,800	61,152.00	0.05
346	002963	豪尔赛	4,100	61,008.00	0.05
347	002513	蓝丰生化	9,000	60,480.00	0.05
348	600448	华纺股份	19,100	60,165.00	0.05
349	301010	晶雪节能	2,600	57,590.00	0.05

350	300405	科隆股份	9,000	57,420.00	0.05
351	688229	博睿数据	900	56,412.00	0.05
352	301037	保立佳	3,900	56,160.00	0.05
353	300242	佳云科技	11,200	56,000.00	0.05
354	603616	韩建河山	10,600	55,014.00	0.05
355	301098	金埔园林	6,400	54,912.00	0.05
356	688130	晶华微	2,600	54,444.00	0.05
357	301024	霍普股份	1,500	53,055.00	0.05
358	002800	天顺股份	3,300	52,008.00	0.05
359	603356	华菱精工	3,600	51,084.00	0.05
360	000056	皇庭国际	25,300	50,853.00	0.04
361	688189	南新制药	6,200	49,414.00	0.04
362	300594	朗进科技	2,500	49,025.00	0.04
363	688296	和达科技	3,400	45,050.00	0.04
364	300713	英可瑞	2,600	44,980.00	0.04
365	600561	江西长运	6,800	44,064.00	0.04
366	300295	三六五网	3,500	43,855.00	0.04
367	002377	国创高新	15,000	42,900.00	0.04
368	600791	京能置业	9,100	42,588.00	0.04
369	000702	正虹科技	5,800	38,744.00	0.03
370	003042	中农联合	2,300	36,938.00	0.03
371	603880	南卫股份	5,600	34,888.00	0.03
372	000637	茂化实华	8,000	34,400.00	0.03
373	300665	飞鹿股份	3,400	33,184.00	0.03
374	688619	罗普特	2,200	29,920.00	0.03
375	300103	达刚控股	3,300	26,499.00	0.02
376	603335	迪生力	4,700	26,461.00	0.02
377	300305	裕兴股份	4,100	24,395.00	0.02
378	300422	博世科	4,900	22,491.00	0.02
379	600322	津投城开	8,600	20,038.00	0.02
380	600847	万里股份	1,700	19,754.00	0.02

381	301656	联合动力	768	19,553.28	0.02
382	603729	龙韵股份	1,200	19,308.00	0.02
383	300385	雪浪环境	3,000	18,660.00	0.02
384	002360	同德化工	3,800	18,392.00	0.02
385	603188	亚邦股份	4,000	18,360.00	0.02
386	300614	百川畅银	1,400	17,752.00	0.02
387	300220	金运激光	1,100	15,785.00	0.01
388	300912	凯龙高科	500	8,250.00	0.01
389	600540	新赛股份	1,500	6,855.00	0.01
390	300929	华骐环保	600	6,450.00	0.01
391	301667	纳百川	95	5,421.65	0.00
392	301687	新广益	94	5,112.66	0.00
393	301668	昊创瑞通	109	4,883.20	0.00
394	301030	仕净科技	400	4,732.00	0.00
395	301449	天溯计量	70	4,566.10	0.00
396	688573	信宇人	200	4,558.00	0.00
397	603262	技源集团	115	3,231.50	0.00
398	001369	双欣环保	190	2,449.10	0.00
399	603406	天富龙	56	2,248.96	0.00
400	001396	誉帆科技	54	1,911.06	0.00
401	001285	瑞立科密	31	1,738.48	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	5,826,281.00	4.15
2	600036	招商银行	4,348,335.00	3.10
3	600519	贵州茅台	4,038,473.00	2.88

4	601318	中国平安	4,003,729.00	2.85
5	600030	中信证券	3,658,259.00	2.60
6	601166	兴业银行	2,535,281.00	1.81
7	688981	中芯国际	2,327,588.18	1.66
8	688041	海光信息	2,212,281.71	1.58
9	002594	比亚迪	2,164,905.00	1.54
10	603444	吉比特	2,133,956.00	1.52
11	300308	中际旭创	2,129,830.00	1.52
12	300502	新易盛	2,003,153.00	1.43
13	600900	长江电力	1,825,503.00	1.30
14	002763	汇洁股份	1,689,251.00	1.20
15	000333	美的集团	1,656,605.00	1.18
16	300803	指南针	1,642,042.00	1.17
17	601899	紫金矿业	1,623,675.00	1.16
18	601138	工业富联	1,616,040.00	1.15
19	601398	工商银行	1,596,383.00	1.14
20	688256	寒武纪	1,515,298.00	1.08

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	8,662,860.00	6.17
2	600519	贵州茅台	8,250,087.00	5.87
3	300308	中际旭创	5,284,571.00	3.76
4	600036	招商银行	4,870,903.00	3.47
5	601318	中国平安	4,760,165.00	3.39
6	688256	寒武纪	4,213,842.83	3.00
7	600030	中信证券	4,019,561.00	2.86

8	600276	恒瑞医药	3,598,066.00	2.56
9	300502	新易盛	3,549,195.60	2.53
10	601138	工业富联	3,438,679.00	2.45
11	688041	海光信息	3,365,456.51	2.40
12	688981	中芯国际	3,355,062.78	2.39
13	601398	工商银行	3,347,114.00	2.38
14	002475	立讯精密	3,315,950.00	2.36
15	601899	紫金矿业	3,250,014.00	2.31
16	603259	药明康德	3,149,253.00	2.24
17	000333	美的集团	3,007,762.00	2.14
18	601288	农业银行	2,873,181.00	2.05
19	300394	天孚通信	2,808,586.12	2.00
20	600900	长江电力	2,767,489.00	1.97

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	676,191,130.07
卖出股票收入（成交）总额	720,955,036.02

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本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本期没有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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,598.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,598.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 量化 精选 混合A	4,4 56	20,613.92	0.00	0.00%	91,855,637.22	100.00%
东财 量化 精选 混合C	2,8 98	15,104.50	0.00	0.00%	43,772,853.36	100.00%
合计	6,9 08	19,633.54	0.00	0.00%	135,628,490.58	100.00%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例

基金管理人所有从业人员持有本基金	东财量化精选混合A	806,296.98	0.88%
	东财量化精选混合C	674.33	0.00%
	合计	806,971.31	0.59%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金基金合同生效届满三年，发起份额已全部赎回。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	东财量化精选混合A	东财量化精选混合C
基金合同生效日(2020年07月29日)基金份额总额	685,551,731.49	390,587,545.37
本报告期期初基金份额总额	128,460,495.87	55,777,737.92
本报告期基金总申购份额	5,974,597.35	5,180,418.65
减：本报告期基金总赎回份额	42,579,456.00	17,185,303.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	91,855,637.22	43,772,853.36

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：自2025年3月26日起，顾勇先生担任东财基金管理有限公司副总经理职务；2025年9月5日，郜杰先生因个人原因离任东财基金管理有限公司督察长职务，同日，由总经理沙福贵代任督察长职务。

基金托管人：本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金合同生效日起至本报告期末，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。本报告期内应支付审计费24,000.00元，该事务所已向本基金提供了6年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	4	1,396,518,283.49	100.00%	553,286.53	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
 - (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
 - (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。
- 4、本部分的数据统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《西藏东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）》统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2024年第4季度报告	证监会规定网站	2025-01-22
2	西藏东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2025-01-25
3	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证监会规定网站及报刊	2025-03-26
4	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2024年年度报告	证监会规定网站	2025-03-28
5	西藏东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	证监会规定网站及报刊	2025-03-28
6	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2025年第1季度报告	证监会规定网站	2025-04-22
7	西藏东财基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2025-06-06
8	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-06-28
9	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-06-28
10	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2025年第2季度报告	证监会规定网站	2025-07-19
11	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金经理	证监会规定网站及报刊	2025-07-29

	变更公告		
12	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-07-30
13	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-07-30
14	西藏东财基金管理有限公司关于西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金招募说明书更新及基金产品资料概要更新提示性公告	证监会规定报刊	2025-07-30
15	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定网站及报刊	2025-08-01
16	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-08-02
17	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-08-02
18	西藏东财基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示性公告	证监会规定网站及报刊	2025-08-20
19	西藏东财基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-04
20	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-06
21	关于公司法定名称变更的公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-16
22	西藏东财量化精选混合型发	证监会规定网站	2025-09-18

	起式证券投资基金更新招募说明书		
23	东财基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示性公告	证监会规定网站及报刊	2025-10-16
24	西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金2025年第3季度报告	证监会规定网站	2025-10-28
25	关于东财基金管理有限公司上海分公司法定名称变更的公告	证监会规定网站及报刊	2025-11-22
26	东财基金管理有限公司关于旗下部分基金2026年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证监会规定网站及报刊	2025-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人发生如下高级管理人员变动：2026年2月13日，倪永彪先生担任东财基金管理有限公司督察长职务，同日离任总经理助理职务；沙福贵先生结束代任督察长职务。2026年2月27日，顾勇先生担任东财基金管理有限公司总经理、财务负责人职务，同日离任副总经理职务；沙福贵先生离任总经理、财务负责人职务。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

一、中国证监会准予西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

- 二、《西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日