

中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 29 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。

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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 基金管理人及基金托管人	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧金安量化混合型证券投资基金	
基金简称	中欧金安量化混合	
基金主代码	014135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 20 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国金证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	515,361,631.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
下属分级基金的交易代码	014135	014136
报告期末下属分级基金的份额总额	458,725,662.99 份	56,635,968.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金将参照以中证 500 指数为主要标准配置基金资产，对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+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。本基金如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		中欧基金管理有限公司	国金证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	陈俐洁
	联系电话	021-68609600	021-20527198-15217
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	chenlj@gjzq.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95310
传真		021-33830351	028-86690232

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	成都市青羊区东城根上街 95 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 13 楼资产托管部
邮政编码	200120	610015
法定代表人	窦玉明	冉云

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年 1 月 20 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
本期已实现收益	49,010,962.00	5,357,643.63	-36,126,584.03	-6,372,813.81	-69,748,288.88	-11,857,621.48
本期利润	45,041,986.34	5,266,401.26	-16,934,915.77	-2,726,037.92	-97,895,810.91	-16,517,931.94
加权平均基金份额本期利润	0.0844	0.0717	-0.0242	-0.0260	-0.1190	-0.1385
本期加权平均净值利润率	10.10%	8.77%	-2.68%	-2.91%	-12.61%	-14.73%
本期基金份额净值增长率	10.77%	9.89%	-4.01%	-4.77%	-11.51%	-12.18%
3.1.2 期末	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

数据和指标						
期末可供分配利润	-27,112,886.93	-4,589,809.17	-91,666,361.96	-13,823,901.41	-92,219,563.76	-14,940,916.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0591	-0.0810	-0.1506	-0.1637	-0.1151	-0.1218
期末基金资产净值	431,612,776.06	52,046,159.80	516,951,307.82	70,606,347.24	708,740,209.12	107,722,062.57
期末基金份额净值	0.9409	0.9190	0.8494	0.8363	0.8849	0.8782
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-5.91%	-8.10%	-15.06%	-16.37%	-11.51%	-12.18%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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

中欧金安量化混合 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	4.68%	1.82%	-0.23%	1.86%	4.91%	-0.04%
过去六个月	17.03%	1.79%	15.02%	1.85%	2.01%	-0.06%
过去一年	10.77%	1.61%	6.17%	1.68%	4.60%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-5.91%	1.25%	-17.60%	1.31%	11.69%	-0.06%

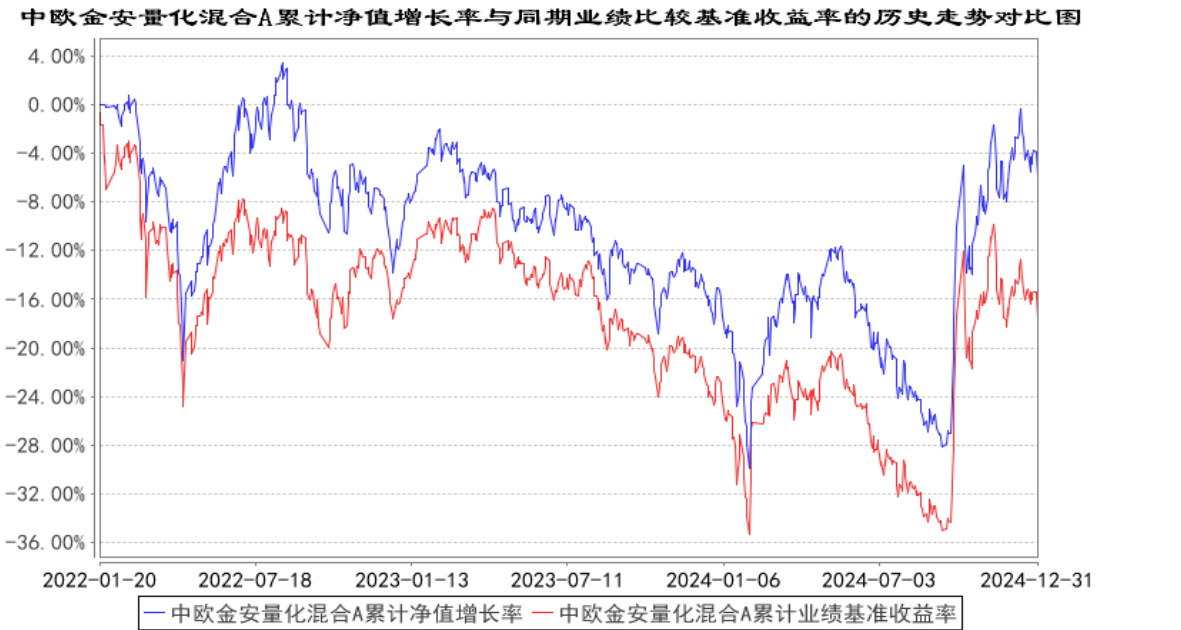
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧金安量化混合 C

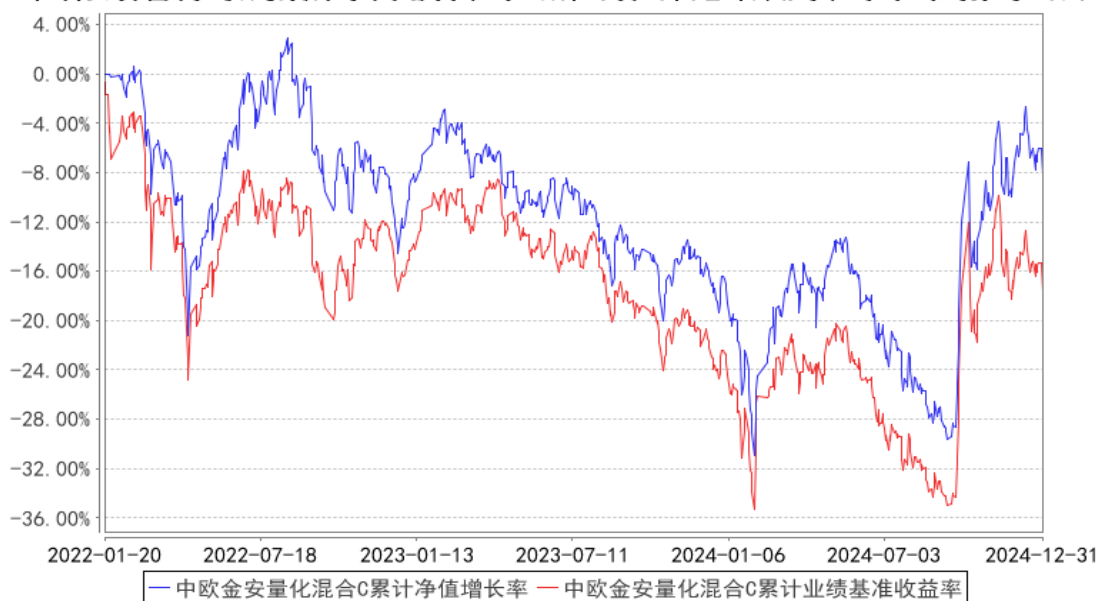
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.47%	1.82%	-0.23%	1.86%	4.70%	-0.04%
过去六个月	16.55%	1.79%	15.02%	1.85%	1.53%	-0.06%
过去一年	9.89%	1.61%	6.17%	1.68%	3.72%	-0.07%
自基金合同生效 起至今	-8.10%	1.25%	-17.60%	1.31%	9.50%	-0.06%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

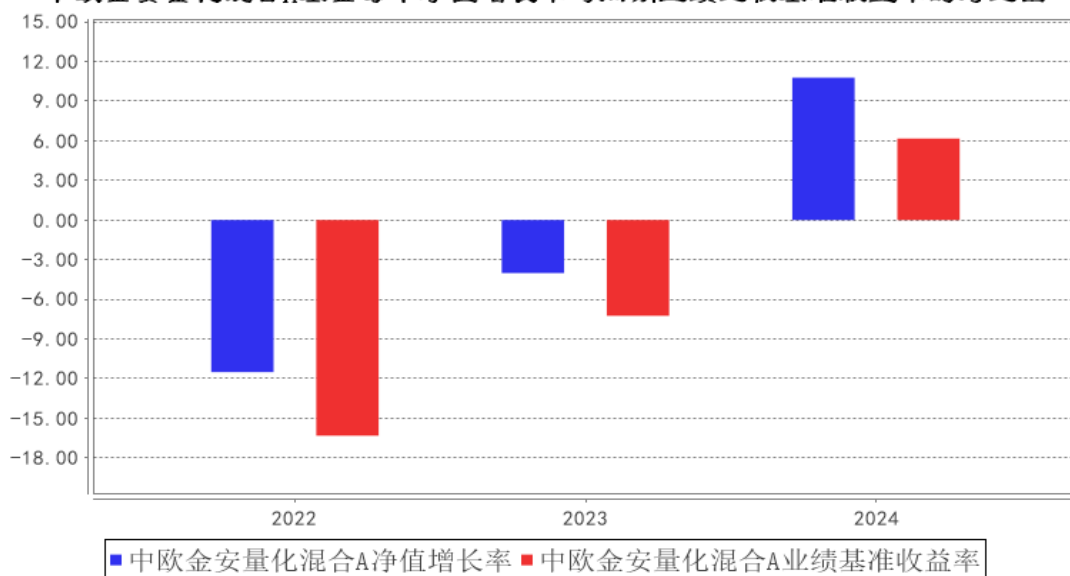


中欧金安量化混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

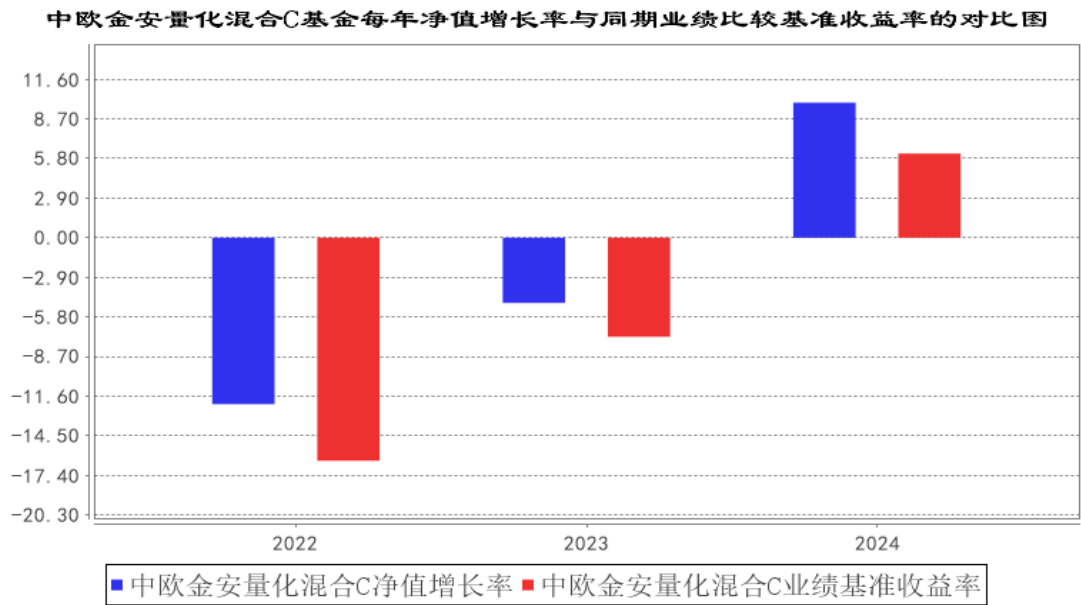


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧金安量化混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为2022年1月20日，2022年度数据为2022年1月20日至2022年12月31日数据。



注：本基金合同生效日为 2022 年 1 月 20 日，2022 年度数据为 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 194 只开放式基金。

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		
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	3 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

曲径	权益投决 会委员/ 权益专 户投决 会委员/ 量化 投资总 监/ 基金 经理/ 投资 经理	2022-01- 20	-	17 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。
----	--	----------------	---	------	---

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	2,528,820,550.43	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,762,360,765.87	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,291,181,316.30	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2024-05-31；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

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，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 31 次，其中 30 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，1 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2024 年市场走势呈现显著的“回升”特征。前三季度，由于宏观经济弱复苏、微观主体预期偏谨慎等多重因素影响，市场情绪持续承压。具体而言，社会消费品零售总额增速放缓，反映出消费端复苏动能不足；制造业 PMI 长期徘徊于荣枯线下方，企业资本开支意愿明显收缩。在此背景下，具备稳定现金流和较高股息率的红利资产备受资金青睐。9 月中旬成为市场的重要转折点，内外部因素共振驱动市场情绪迎来修复。外部因素方面，全球流动性拐点得以确认，美联储超预期降息 50 个基点，正式开启宽松周期。人民币汇率的贬值压力有效缓解，吸引部分结汇资金回流境内，市场流动性显著改善。汇率压力缓解为国内政策调控打开了空间，政策重心转向“加强逆周期调节”。9 月 24 日，国务院新闻办发布会上，央行宣布了一系列超预期的宽松政策组合拳，包括降低存款准备金率，以及下调存量房贷利率，统一房贷最低首付比例等措施，旨在降低实体经济融资成本，稳定房地产市场。此外，央行还创设了新的货币政策工具，以支持股票市场稳定发展。12 月召开的中央政治局会议为 2025 年经济工作定下了积极基调，强调“实施更加积极有为的宏观政策，加强超常规逆周期调节”，并明确提出实施“更加积极”的财政政策和“适度宽松”的货币政策。随后的中央经济工作会议进一步明确了“超常规逆周期调节”的思路，提出提高财政赤字率、适时降准降息等举措，这些政策信号为经济复苏注入强心剂。在报告期内，本基金以中证 500 指数的行业配置为锚定，保持了均衡的风格和行业配置，对于基准的跟踪误差控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。操作上，高配部分模型预测的景气行业，在行业内采用基本面因子结合量价因子的多维度综合打分，对个股进行配置，构成基金投资组合，力争获取超越基准的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 10.77%，同期业绩比较基准收益率为 6.17%；基金 C 类份额净值增长率为 9.89%，同期业绩比较基准收益率为 6.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我国经济运行主要受内生因素主导，需要重点跟踪宏观政策的传导效率及其对各行各业基本面的持续性改善程度。从政策组合来看，货币环境为估值扩张提供了良好基础，但市场

能否持续向好的关键在于财政政策的有效接力。只有财政端发力，才能更好地提振企业的盈利能力，夯实市场上行基础。12 月政治局会议和中央经济工作会议对明年政策定调积极，强调实施“更加积极”的财政政策和“适度宽松”的货币政策，有效提振了经济增长预期与市场风险偏好。从市场节奏研判，A 股能否开启持续性反弹行情，核心要素在于关注后续财政政策的落地节奏和实施力度。我们会持续跟踪市场风格因子特征，争取控制组合风险因子暴露，力争让量化组合的超额收益更为平稳。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2024 年，监管机构颁布了多部法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2024 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制定或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2024 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2024 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化洗钱风险和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、风险评估、培训宣传等层面，进一步提升和完善反洗钱管

理工作。公司在今年牵头各部门加强自身反洗钱工作履职能力，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，优化了反洗钱系统的各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 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，托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，托管人根据国家有关法律法规、基金合同的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本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

报告期内，由本基金管理人编制并经托管人复核的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

托管人提示投资者关注：因托管人获取信息有限，请投资者谨慎识别和判断风险，并及时向基金管理人获取本基金实际投资项目状况和风险状况等。

§ 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	安永华明（2025）审字第 70028871_B88 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	中欧金安量化混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧金安量化混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	中欧金安量化混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，

	在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估中欧金安量化混合型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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （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。 （3）评价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。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧金安量化混合型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中欧金安量化混合型证券投资基金不能持续经营。 （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。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现

	等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	33,539,107.49	50,808,752.85
结算备付金		1,290,653.59	3,489,990.13
存出保证金		-	1,039,603.20
交易性金融资产	7.4.7.2	450,552,209.90	532,757,281.96
其中：股票投资		442,935,290.04	532,757,281.96
基金投资		-	-
债券投资		7,616,919.86	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,215,617.94	521,498.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		486,597,588.92	588,617,126.37
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,252,366.05	236,369.85
应付管理人报酬		513,123.61	603,482.37
应付托管费		85,520.58	100,580.39
应付销售服务费		37,075.95	48,994.99
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	50,566.87	70,043.71
负债合计		2,938,653.06	1,059,471.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	515,361,631.96	693,047,918.43
未分配利润	7.4.7.8	-31,702,696.10	-105,490,263.37
净资产合计		483,658,935.86	587,557,655.06
负债和净资产总计		486,597,588.92	588,617,126.37

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 515,361,631.96 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9409 元，基金份额总额 458,725,662.99 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9190 元，基金份额总额 56,635,968.97 份。

7.2 利润表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		58,075,885.96	-7,258,849.05
1. 利息收入		149,984.36	645,266.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	149,984.36	199,307.21
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		-	445,959.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		61,662,089.43	-31,483,940.48

其中：股票投资收益	7.4.7.10	50,596,134.42	-34,251,809.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	42,110.27	486,630.73
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	393,202.72	-5,265,105.61
股利收益	7.4.7.14	10,630,642.02	7,546,344.30
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.15	-4,060,218.03	22,838,444.15
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.16	324,030.20	741,380.38
减：二、营业总支出		7,767,498.36	12,402,104.64
1. 管理人报酬		6,078,427.58	9,983,455.47
2. 托管费		1,013,071.21	1,455,691.25
3. 销售服务费		481,065.80	752,594.03
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,849.91	1,122.21
其中：卖出回购金融资产 支出		1,849.91	1,122.21
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,002.12	1,241.68
8. 其他费用	7.4.7.18	188,081.74	208,000.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		50,308,387.60	-19,660,953.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		50,308,387.60	-19,660,953.69
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		50,308,387.60	-19,660,953.69

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06
二、本期期初净资产	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,686,286.47	-	73,787,567.27	-103,898,719.20
(一)、综合收益总额	-	-	50,308,387.60	50,308,387.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-177,686,286.47	-	23,479,179.67	-154,207,106.80
其中：1. 基金申购款	106,899,104.35	-	-12,792,217.42	94,106,886.93
2. 基金赎回款	-284,585,390.82	-	36,271,397.09	-248,313,993.73
(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	515,361,631.96	-	-31,702,696.10	483,658,935.86
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	923,622,751.75	-	-107,160,480.06	816,462,271.69
二、本期期初净资产	923,622,751.75	-	-107,160,480.06	816,462,271.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-230,574,833.32	-	1,670,216.69	-228,904,616.63
(一)、综合收益	-	-	-19,660,953.69	-19,660,953.69

总额				
(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)	-230,574,833.32	-	21,331,170.38	-209,243,662.94
其中：1. 基金申购款	172,533,207.47	-	-12,398,759.90	160,134,447.57
2. 基金赎回款	-403,108,040.79	-	33,729,930.28	-369,378,110.51
(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	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

基金管理人负责人

王音然

主管会计工作负责人

李宝林

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧金安量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]3328 号文《关于准予中欧金安量化混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,032,691,612.76 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,032,840,253.50 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 148,640.74 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 893,269,013.78 份，包含认购利息折

合 133,841.80 份；C 类基金的基金份额总额为 139,571,239.72 份，包含认购利息折合 14,798.94 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为国金证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化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（包括创业板股票、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品（不含合约类信用衍生品）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）。本基金可以参与融资业务。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《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内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财

务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评

估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可

靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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，具体收益分配安排详见基金管理人届时公告；

(2) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 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；

(4) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经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酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要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

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,403,908.70	260,935.82
等于：本金	1,403,364.96	260,525.49
加：应计利息	543.74	410.33
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	32,135,198.79	50,547,817.03
等于：本金	32,134,126.52	50,545,015.04
加：应计利息	1,072.27	2,801.99
减：坏账准备	-	-
合计	33,539,107.49	50,808,752.85

注：本基金持有的其他存款均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 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		456,966,996.41	-	442,935,290.04	-14,031,706.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,513,150.00	101,669.86	7,616,919.86	2,100.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,513,150.00	101,669.86	7,616,919.86	2,100.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		464,480,146.41	101,669.86	450,552,209.90	-14,029,606.37
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		542,727,670.30	-	532,757,281.96	-9,970,388.34
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		542,727,670.30	-	532,757,281.96	-9,970,388.34

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,662,360.00	-	-	-
其中：股指期货投资	8,662,360.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	8,662,360.00	-	-	-

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	566.87	43.71
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	50,000.00	70,000.00
合计	50,566.87	70,043.71

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	608,617,669.78	608,617,669.78
本期申购	90,974,868.35	90,974,868.35
本期赎回（以“-”号填列）	-240,866,875.14	-240,866,875.14
本期末	458,725,662.99	458,725,662.99

中欧金安量化混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,430,248.65	84,430,248.65
本期申购	15,924,236.00	15,924,236.00
本期赎回（以“-”号填列）	-43,718,515.68	-43,718,515.68

本期末	56,635,968.97	56,635,968.97
-----	---------------	---------------

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

单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-80,095,178.79	-11,571,183.17	-91,666,361.96
本期期初	-80,095,178.79	-11,571,183.17	-91,666,361.96
本期利润	49,010,962.00	-3,968,975.66	45,041,986.34
本期基金份额交易产生的变动数	22,559,671.07	-3,048,182.38	19,511,488.69
其中：基金申购款	-11,671,038.67	1,388,919.94	-10,282,118.73
基金赎回款	34,230,709.74	-4,437,102.32	29,793,607.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,524,545.72	-18,588,341.21	-27,112,886.93

中欧金安量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,231,372.14	-1,592,529.27	-13,823,901.41
本期期初	-12,231,372.14	-1,592,529.27	-13,823,901.41
本期利润	5,357,643.63	-91,242.37	5,266,401.26
本期基金份额交易产生的变动数	4,535,448.80	-567,757.82	3,967,690.98
其中：基金申购款	-2,483,365.61	-26,733.08	-2,510,098.69
基金赎回款	7,018,814.41	-541,024.74	6,477,789.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,338,279.71	-2,251,529.46	-4,589,809.17

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	25,338.87	64,848.28
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	63,372.22	81,928.85
结算备付金利息收入	61,273.27	52,530.08
其他	-	-
合计	149,984.36	199,307.21

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,417,606,267.93	4,977,467,627.10
减：卖出股票成本总额	6,358,412,790.62	5,001,022,115.63
减：交易费用	8,597,342.89	10,697,321.37
买卖股票差价收入	50,596,134.42	-34,251,809.90

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	42,110.27	407,779.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	78,851.00
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	42,110.27	486,630.73

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	41,363,280.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	40,521,149.00
减：应计利息总额	-	763,280.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	78,851.00

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	393,202.72	-5,265,105.61

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,630,642.02	7,546,344.30
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	10,630,642.02	7,546,344.30

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-4,059,218.03	22,837,444.15
股票投资	-4,061,318.03	22,839,155.15
债券投资	2,100.00	-1,711.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-1,000.00	1,000.00
权证投资	-	-
期货投资	-1,000.00	1,000.00
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	-4,060,218.03	22,838,444.15

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	323,432.99	740,968.44
基金转换费收入	597.21	411.94
合计	324,030.20	741,380.38

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
存托服务费	81.74	-
合计	188,081.74	208,000.00

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
国金证券股份有限公司（“国金证券”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东

上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙) (“上海穆延合伙”)	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司 (“中欧财富”)	基金管理人的控股子公司、基金销售机构
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 (“中欧盛世资管”)	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司 (“中欧基金国际”)	基金管理人的全资子公司
中欧私募基金管理(上海)有限公司 (“中欧私募”)	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2024 年 4 月 9 日起，我司正式受让中欧私募基金管理(上海)有限公司全部股权，新增关联方为中欧私募基金管理(上海)有限公司。

2、以下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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国金证券	211,363,983.58	1.67	1,432,459,973.29	14.72

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
国金证券	-	-	823,398,000.00	16.75

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国金证券	402,189.88	8.79	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国金证券	1,366,924.15	23.66	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,078,427.58	9,983,455.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,357,932.32	3,836,762.06
应支付基金管理人的净管理费	3,720,495.26	6,146,693.41

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。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

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费率由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,013,071.21	1,455,691.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
	0.00	43,731.66	43,731.66
中欧财富	0.00	3,578.65	3,578.65
合计	0.00	47,310.31	47,310.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
	0.00	99,849.71	99,849.71
中欧财富	0.00	5,634.42	5,634.42
合计	0.00	105,484.13	105,484.13

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。

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

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

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

份额单位：份

中欧金安量化混合 A

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	438, 079. 85	0. 10%	438, 079. 85	0. 07%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度可比期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国金证券股份有 限公司	1, 560, 133. 70	32, 631. 05	3, 000, 325. 27	84, 204. 41

注：本基金的银行存款由基金托管人国金证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	6 个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	3,891	8,949.30	26,458.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-

	成									
301585	蓝 宇 股 份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳 力 奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔 锋 智 能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿 联 科 技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富 特 科 技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博 实 结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂 玛 科 技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股 流通 受限	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新 铝 时 代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博 苑 股 份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英 思 特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股 流通 受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏 州 天 脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹	2024	6 个月	新股	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-

	连科技	年 11 月 12 日		流通受限						
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024 年 9 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先	2024	6 个月	新股	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-

	锋精科	年 12 月 4 日		流通受限						
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股流通受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	24,900	870,499.00	876,480.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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融出证券。

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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。本基金在交易所进行的交易均以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，违约风险可能性很小；在银行间同

业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来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。

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设计了巨额赎回条款，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 7.4.12 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，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 7.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	33,539,107.49	-	-	-	33,539,107.49
结算备付金	1,290,653.59	-	-	-	1,290,653.59
交易性金融资产	7,616,919.86	-	-	-442,935,290.04	450,552,209.90
应收申购款	-	-	-	1,215,617.94	1,215,617.94
资产总计	42,446,680.94	-	-	-444,150,907.98	486,597,588.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,252,366.05	2,252,366.05
应付管理人报酬	-	-	-	513,123.61	513,123.61
应付托管费	-	-	-	85,520.58	85,520.58
应付销售服务费	-	-	-	37,075.95	37,075.95
其他负债	-	-	-	50,566.87	50,566.87
负债总计	-	-	-	2,938,653.06	2,938,653.06
利率敏感度缺口	42,446,680.94	-	-	-441,212,254.92	483,658,935.86
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	50,808,752.85	-	-	-	50,808,752.85
结算备付金	3,489,990.13	-	-	-	3,489,990.13
存出保证金	-	-	-	1,039,603.20	1,039,603.20
交易性金融资产	-	-	-	-532,757,281.96	532,757,281.96
应收申购款	-	-	-	521,498.23	521,498.23
资产总计	54,298,742.98	-	-	-534,318,383.39	588,617,126.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	236,369.85	236,369.85

应付管理人报酬	-	-	-	603,482.37	603,482.37
应付托管费	-	-	-	100,580.39	100,580.39
应付销售服务费	-	-	-	48,994.99	48,994.99
其他负债	-	-	-	70,043.71	70,043.71
负债总计	-	-	-	1,059,471.31	1,059,471.31
利率敏感度缺口	54,298,742.98	-	-	-533,258,912.08	587,557,655.06

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 1.57%（2023 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	442,935,290.04	91.58	532,757,281.96	90.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	442,935,290.04	91.58	532,757,281.96	90.67

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	22,985,789.55	27,677,292.49
	业绩比较基准下降 5%	-22,985,789.55	-27,677,292.49

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	441,399,848.50	531,247,017.74
第二层次	8,521,136.36	426,713.60
第三层次	631,225.04	1,083,550.62
合计	450,552,209.90	532,757,281.96

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场

交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	1,083,550.62	1,083,550.62
当期购买	0.00	254,838.03	254,838.03
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	1,083,550.62	1,083,550.62
当期利得或损失总额	0.00	376,387.01	376,387.01
其中：计入损益的利得或损失	0.00	376,387.01	376,387.01
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	631,225.04	631,225.04
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	0.00	376,387.01	376,387.01
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	3,890,332.44	3,890,332.44
当期购买	0.00	913,974.93	913,974.93
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	3,890,332.44	3,890,332.44
当期利得或损失总额	0.00	169,575.69	169,575.69
其中：计入损益的利得或损	0.00	169,575.69	169,575.69

失			
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	1,083,550.62	1,083,550.62
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	0.00	169,575.69	169,575.69

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	631,225.04	平均价格 亚式期权模型	波动率	0.2665-5.7444	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	1,083,550.62	平均价格 亚式期权模型	波动率	0.1855-2.1988	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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	442,935,290.04	91.03
	其中：股票	442,935,290.04	91.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,616,919.86	1.57
	其中：债券	7,616,919.86	1.57
	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	34,829,761.08	7.16
8	其他各项资产	1,215,617.94	0.25
9	合计	486,597,588.92	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,312,028.00	0.89
B	采矿业	17,739,226.00	3.67
C	制造业	278,223,465.21	57.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,390,023.00	4.84
E	建筑业	12,738,417.60	2.63
F	批发和零售业	12,008,960.22	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	13,427,430.80	2.78
H	住宿和餐饮业	1,888,725.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,493,180.25	5.68
J	金融业	33,035,148.40	6.83
K	房地产业	5,930,181.00	1.23
L	租赁和商务服务业	3,477,361.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	3,759,041.56	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	4,018,947.00	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,572.00	0.00

Q	卫生和社会工作	716,185.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	766,398.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	442,935,290.04	91.58

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	000157	中联重科	377,800	2,731,494.00	0.56
2	688208	道通科技	67,300	2,635,468.00	0.54
3	688150	莱特光电	86,861	1,956,109.72	0.40
4	000915	华特达因	68,700	1,935,966.00	0.40
5	600153	建发股份	179,800	1,891,496.00	0.39
6	000988	华工科技	43,500	1,883,550.00	0.39
7	001965	招商公路	134,300	1,873,485.00	0.39
8	603529	爱玛科技	45,500	1,866,410.00	0.39
9	601872	招商轮船	288,800	1,851,208.00	0.38
10	688615	合合信息	9,189	1,849,626.42	0.38
11	601121	宝地矿业	263,500	1,844,500.00	0.38
12	002938	鹏鼎控股	50,400	1,838,592.00	0.38
13	603296	华勤技术	25,600	1,816,320.00	0.38
14	002624	完美世界	175,800	1,816,014.00	0.38
15	000977	浪潮信息	35,000	1,815,800.00	0.38
16	300087	荃银高科	151,300	1,785,340.00	0.37
17	688631	莱斯信息	20,400	1,776,636.00	0.37
18	603379	三美股份	46,000	1,765,480.00	0.37
19	301165	锐捷网络	24,400	1,761,680.00	0.36
20	002371	北方华创	4,500	1,759,500.00	0.36
21	000600	建投能源	304,800	1,725,168.00	0.36
22	300681	英搏尔	69,100	1,718,517.00	0.36
23	000893	亚钾国际	84,200	1,697,472.00	0.35
24	002927	泰永长征	113,800	1,683,102.00	0.35
25	000528	柳 工	138,100	1,665,486.00	0.34
26	600602	云赛智联	103,700	1,640,534.00	0.34
27	600449	宁夏建材	109,100	1,638,682.00	0.34
28	605117	德业股份	19,200	1,628,160.00	0.34
29	603214	爱婴室	70,700	1,594,992.00	0.33
30	000661	长春高新	16,000	1,591,040.00	0.33
31	002497	雅化集团	135,800	1,588,860.00	0.33
32	600694	大商股份	60,030	1,582,991.10	0.33

33	002335	科华数据	54,500	1,576,140.00	0.33
34	300699	光威复材	45,400	1,573,110.00	0.33
35	002245	蔚蓝锂芯	146,600	1,567,154.00	0.32
36	600378	昊华科技	54,200	1,566,922.00	0.32
37	000561	烽火电子	176,900	1,563,796.00	0.32
38	002851	麦格米特	25,400	1,561,084.00	0.32
39	300693	盛弘股份	57,500	1,550,200.00	0.32
40	689009	九号公司	32,405	1,539,237.50	0.32
41	300792	壹网壹创	64,100	1,538,400.00	0.32
42	002706	良信股份	199,400	1,531,392.00	0.32
43	301110	青木科技	24,700	1,520,038.00	0.31
44	688426	康为世纪	47,800	1,367,558.00	0.28
45	605108	同庆楼	44,200	1,083,342.00	0.22
46	603558	健盛集团	97,500	1,049,100.00	0.22
47	688558	国盛智科	48,655	1,038,784.25	0.21
48	000933	神火股份	60,900	1,029,210.00	0.21
49	605166	聚合顺	81,900	980,343.00	0.20
50	600938	中国海油	32,100	947,271.00	0.20
51	000039	中集集团	121,300	942,501.00	0.19
52	002867	周大生	64,700	940,091.00	0.19
53	600582	天地科技	151,400	935,652.00	0.19
54	600848	上海临港	92,600	935,260.00	0.19
55	603733	仙鹤股份	45,200	932,476.00	0.19
56	000739	普洛药业	57,100	928,446.00	0.19
57	002831	裕同科技	34,144	925,302.40	0.19
58	600000	浦发银行	89,900	925,071.00	0.19
59	601886	江河集团	171,000	923,400.00	0.19
60	000030	富奥股份	179,700	921,861.00	0.19
61	600362	江西铜业	44,600	920,544.00	0.19
62	600995	南网储能	90,900	919,908.00	0.19
63	603013	亚普股份	61,400	919,772.00	0.19
64	600496	精工钢构	304,000	918,080.00	0.19
65	603568	伟明环保	42,400	917,112.00	0.19
66	601318	中国平安	17,400	916,110.00	0.19
67	603301	振德医疗	41,623	915,289.77	0.19
68	002978	安宁股份	32,200	915,124.00	0.19
69	601988	中国银行	165,700	913,007.00	0.19
70	688663	新风光	42,000	911,820.00	0.19
71	600901	江苏金租	174,320	909,950.40	0.19
72	601231	环旭电子	55,100	909,150.00	0.19
73	601298	青岛港	99,600	907,356.00	0.19
74	600585	海螺水泥	38,100	906,018.00	0.19
75	000166	申万宏源	169,000	904,150.00	0.19

76	600295	鄂尔多斯	92,600	903,776.00	0.19
77	601665	齐鲁银行	161,500	902,785.00	0.19
78	688697	纽威数控	54,200	901,888.00	0.19
79	688526	科前生物	63,000	900,270.00	0.19
80	600663	陆家嘴	91,200	897,408.00	0.19
81	600894	广日股份	61,300	894,980.00	0.19
82	600583	海油工程	162,800	890,516.00	0.18
83	601319	中国人保	116,800	890,016.00	0.18
84	601225	陕西煤业	38,200	888,532.00	0.18
85	600019	宝钢股份	126,800	887,600.00	0.18
86	601598	中国外运	165,900	887,565.00	0.18
87	301379	天山电子	43,920	887,184.00	0.18
88	600458	时代新材	69,100	885,171.00	0.18
89	600968	海油发展	207,200	884,744.00	0.18
90	000050	深天马 A	97,800	883,134.00	0.18
91	601001	晋控煤业	64,500	881,715.00	0.18
92	688127	蓝特光学	32,526	881,454.60	0.18
93	600261	阳光照明	269,300	880,611.00	0.18
94	002372	伟星新材	69,700	880,311.00	0.18
95	688112	鼎阳科技	31,400	880,142.00	0.18
96	300761	立华股份	45,200	879,592.00	0.18
97	603115	海星股份	68,100	879,171.00	0.18
98	688139	海尔生物	24,900	876,480.00	0.18
99	600546	山煤国际	74,000	875,420.00	0.18
100	600820	隧道股份	121,400	872,866.00	0.18
101	688508	芯朋微	20,300	872,291.00	0.18
102	601369	陕鼓动力	100,100	870,870.00	0.18
103	688349	三一重能	28,200	870,816.00	0.18
104	000672	上峰水泥	113,600	869,040.00	0.18
105	603939	益丰药房	36,000	868,680.00	0.18
106	600284	浦东建设	138,480	868,269.60	0.18
107	600648	外高桥	72,800	867,048.00	0.18
108	603727	博迈科	75,500	866,740.00	0.18
109	605507	国邦医药	41,600	866,528.00	0.18
110	002595	豪迈科技	17,200	863,268.00	0.18
111	002202	金风科技	83,500	862,555.00	0.18
112	000708	中信特钢	75,500	861,455.00	0.18
113	688176	亚虹医药	126,772	860,781.88	0.18
114	600517	国网英大	156,000	859,560.00	0.18
115	000537	中绿电	94,200	859,104.00	0.18
116	002601	龙佰集团	48,600	858,762.00	0.18
117	000728	国元证券	102,700	858,572.00	0.18
118	603995	甬金股份	46,900	857,801.00	0.18

119	688689	银河微电	40,413	856,351.47	0.18
120	002532	天山铝业	108,700	855,469.00	0.18
121	603833	欧派家居	12,400	854,856.00	0.18
122	000498	山东路桥	143,600	854,420.00	0.18
123	601619	嘉泽新能	257,200	853,904.00	0.18
124	688553	汇宇制药	56,100	852,720.00	0.18
125	601169	北京银行	138,300	850,545.00	0.18
126	601916	浙商银行	292,200	850,302.00	0.18
127	600008	首创环保	259,000	849,520.00	0.18
128	002393	力生制药	48,100	848,484.00	0.18
129	000048	京基智农	47,100	847,800.00	0.18
130	000776	广发证券	52,300	847,783.00	0.18
131	601766	中国中车	101,100	847,218.00	0.18
132	688410	山外山	75,711	844,934.76	0.17
133	603337	杰克股份	27,700	843,742.00	0.17
134	300737	科顺股份	166,400	843,648.00	0.17
135	300360	炬华科技	50,300	843,531.00	0.17
136	301087	可孚医疗	23,820	842,275.20	0.17
137	002367	康力电梯	122,300	840,201.00	0.17
138	688389	普门科技	56,400	839,796.00	0.17
139	688135	利扬芯片	41,800	838,926.00	0.17
140	600875	东方电气	52,600	835,814.00	0.17
141	600269	赣粤高速	148,700	834,207.00	0.17
142	600909	华安证券	137,600	833,856.00	0.17
143	002106	莱宝高科	76,400	833,524.00	0.17
144	601398	工商银行	120,200	831,784.00	0.17
145	301039	中集车辆	91,800	830,790.00	0.17
146	300514	友讯达	57,500	830,300.00	0.17
147	601958	金钼股份	82,500	829,950.00	0.17
148	300119	瑞普生物	45,100	828,487.00	0.17
149	601288	农业银行	154,800	826,632.00	0.17
150	600664	哈药股份	200,100	826,413.00	0.17
151	000729	燕京啤酒	68,600	825,944.00	0.17
152	002236	大华股份	51,600	825,600.00	0.17
153	002478	常宝股份	156,000	825,240.00	0.17
154	603515	欧普照明	50,101	824,161.45	0.17
155	002430	杭氧股份	37,800	824,040.00	0.17
156	603113	金能科技	146,300	823,669.00	0.17
157	688063	派能科技	20,559	823,387.95	0.17
158	002818	富森美	55,100	823,194.00	0.17
159	688699	明微电子	22,900	823,026.00	0.17
160	002233	塔牌集团	107,300	822,991.00	0.17
161	002142	宁波银行	33,800	821,678.00	0.17

162	688371	菲沃泰	52,900	821,008.00	0.17
163	688588	凌志软件	59,477	820,782.60	0.17
164	600502	安徽建工	171,700	820,726.00	0.17
165	002061	浙江交科	200,900	819,672.00	0.17
166	002926	华西证券	98,500	818,535.00	0.17
167	688330	宏力达	31,100	816,064.00	0.17
168	688533	上声电子	23,411	815,171.02	0.17
169	002483	润邦股份	156,400	814,844.00	0.17
170	300643	万通智控	67,900	812,084.00	0.17
171	603132	金徽股份	72,300	811,929.00	0.17
172	000725	京东方 A	184,900	811,711.00	0.17
173	601818	光大银行	209,700	811,539.00	0.17
174	002563	森马服饰	115,600	811,512.00	0.17
175	688509	正元地信	204,200	810,674.00	0.17
176	002203	海亮股份	75,400	810,550.00	0.17
177	002773	康弘药业	41,300	809,480.00	0.17
178	601882	海天精工	36,900	809,217.00	0.17
179	600380	健康元	71,700	808,059.00	0.17
180	002683	广东宏大	30,500	807,640.00	0.17
181	601998	中信银行	115,700	807,586.00	0.17
182	600028	中国石化	120,800	806,944.00	0.17
183	600258	首旅酒店	54,900	805,383.00	0.17
184	002267	陕天然气	95,300	805,285.00	0.17
185	000700	模塑科技	114,700	805,194.00	0.17
186	601577	长沙银行	90,500	804,545.00	0.17
187	001914	招商积余	76,100	804,377.00	0.17
188	601601	中国太保	23,600	804,288.00	0.17
189	300259	新天科技	229,700	803,950.00	0.17
190	600098	广州发展	125,200	803,784.00	0.17
191	600750	江中药业	35,400	803,580.00	0.17
192	002056	横店东磁	61,900	802,224.00	0.17
193	603100	川仪股份	37,200	801,660.00	0.17
194	002226	江南化工	147,900	801,618.00	0.17
195	300433	蓝思科技	36,600	801,540.00	0.17
196	600869	远东股份	168,700	801,325.00	0.17
196	603599	广信股份	66,500	801,325.00	0.17
197	600900	长江电力	27,100	800,805.00	0.17
198	600956	新天绿能	106,100	799,994.00	0.17
199	300471	厚普股份	84,500	799,370.00	0.17
200	002299	圣农发展	55,200	799,296.00	0.17
201	002206	海利得	186,200	798,798.00	0.17
202	002479	富春环保	168,300	797,742.00	0.16
203	603158	腾龙股份	98,700	797,496.00	0.16

204	601168	西部矿业	49,600	797,072.00	0.16
205	601018	宁波港	206,700	795,795.00	0.16
206	000683	远兴能源	142,300	795,457.00	0.16
207	603600	永艺股份	66,900	795,441.00	0.16
208	600320	振华重工	202,700	794,584.00	0.16
209	000987	越秀资本	113,100	793,962.00	0.16
210	603565	中谷物流	81,000	793,800.00	0.16
211	601877	正泰电器	33,900	793,599.00	0.16
212	603053	成都燃气	79,100	793,373.00	0.16
213	601857	中国石油	88,700	792,978.00	0.16
214	603387	基蛋生物	96,100	792,825.00	0.16
215	600372	中航机载	64,300	792,819.00	0.16
216	000968	蓝焰控股	119,200	792,680.00	0.16
217	000419	通程控股	138,700	791,977.00	0.16
218	002546	新联电子	182,900	791,957.00	0.16
219	688093	世华科技	39,200	791,448.00	0.16
220	000783	长江证券	116,000	791,120.00	0.16
221	600035	楚天高速	171,900	790,740.00	0.16
222	301370	国科恒泰	73,200	790,560.00	0.16
223	002705	新宝股份	52,700	790,500.00	0.16
224	601333	广深铁路	230,400	790,272.00	0.16
225	000529	广弘控股	133,900	790,010.00	0.16
226	688331	荣昌生物	26,218	789,423.98	0.16
227	000967	盈峰环境	158,800	789,236.00	0.16
228	603676	卫信康	79,300	789,035.00	0.16
229	601618	中国中冶	239,100	789,030.00	0.16
230	600219	南山铝业	201,500	787,865.00	0.16
231	601633	长城汽车	29,900	787,267.00	0.16
232	000582	北部湾港	99,900	787,212.00	0.16
233	601898	中煤能源	64,600	786,828.00	0.16
234	688548	广钢气体	78,100	786,467.00	0.16
235	600989	宝丰能源	46,700	786,428.00	0.16
236	600064	南京高科	101,200	786,324.00	0.16
237	600015	华夏银行	98,100	785,781.00	0.16
238	003020	立方制药	43,500	784,740.00	0.16
239	688628	优利德	21,300	784,692.00	0.16
240	600713	南京医药	158,200	784,672.00	0.16
241	600389	江山股份	54,300	784,635.00	0.16
242	002508	老板电器	36,600	784,338.00	0.16
243	002060	广东建工	214,200	783,972.00	0.16
244	601126	四方股份	46,200	783,552.00	0.16
245	000544	中原环保	89,700	783,081.00	0.16
246	000591	太阳能	164,500	783,020.00	0.16

247	301559	中集环科	51,000	782,850.00	0.16
248	603010	万盛股份	76,200	782,574.00	0.16
249	601179	中国西电	103,100	782,529.00	0.16
250	603170	宝立食品	51,400	782,308.00	0.16
251	600036	招商银行	19,900	782,070.00	0.16
252	002004	华邦健康	173,000	781,960.00	0.16
253	603043	广州酒家	47,000	781,610.00	0.16
254	002440	闰土股份	116,400	781,044.00	0.16
254	600033	福建高速	201,300	781,044.00	0.16
255	002228	合兴包装	260,200	780,600.00	0.16
256	600162	香江控股	406,400	780,288.00	0.16
257	601600	中国铝业	106,100	779,835.00	0.16
258	688182	灿勤科技	43,600	779,568.00	0.16
259	002020	京新药业	60,900	779,520.00	0.16
260	300999	金龙鱼	23,900	779,379.00	0.16
261	688122	西部超导	18,200	779,324.00	0.16
262	603355	莱克电气	34,400	779,160.00	0.16
263	000685	中山公用	84,400	779,012.00	0.16
264	603156	养元饮品	34,100	778,844.00	0.16
265	300174	元力股份	52,900	778,688.00	0.16
266	600459	贵研铂业	56,700	778,491.00	0.16
267	600821	金开新能	144,000	777,600.00	0.16
268	688002	睿创微纳	16,529	777,028.29	0.16
269	688269	凯立新材	31,100	776,878.00	0.16
270	600282	南钢股份	165,600	776,664.00	0.16
271	002034	旺能环境	50,100	776,550.00	0.16
272	603317	天味食品	58,200	776,388.00	0.16
273	002088	鲁阳节能	60,700	776,353.00	0.16
274	688352	颀中科技	64,000	776,320.00	0.16
275	000589	贵州轮胎	154,300	776,129.00	0.16
276	600874	创业环保	130,000	776,100.00	0.16
277	603551	奥普科技	72,600	775,368.00	0.16
278	600508	上海能源	58,600	775,278.00	0.16
279	600132	重庆啤酒	12,300	775,146.00	0.16
280	688088	虹软科技	20,100	775,056.00	0.16
281	002688	金河生物	173,300	774,651.00	0.16
282	600039	四川路桥	106,300	773,864.00	0.16
283	300434	金石亚药	93,800	773,850.00	0.16
284	001311	多利科技	30,000	773,700.00	0.16
285	002100	天康生物	118,100	773,555.00	0.16
286	688401	路维光电	29,300	773,227.00	0.16
287	600572	康恩贝	165,900	773,094.00	0.16
288	002303	美盈森	215,900	772,922.00	0.16

289	002540	亚太科技	125,400	772,464.00	0.16
290	600426	华鲁恒升	35,737	772,276.57	0.16
291	600188	兖矿能源	54,500	772,265.00	0.16
292	600020	中原高速	183,000	772,260.00	0.16
293	300745	欣锐科技	48,500	772,120.00	0.16
294	688612	威迈斯	32,800	772,112.00	0.16
295	001286	陕西能源	83,200	772,096.00	0.16
296	000156	华数传媒	107,200	771,840.00	0.16
297	601117	中国化学	93,100	771,799.00	0.16
298	600352	浙江龙盛	75,000	771,750.00	0.16
299	603659	璞泰来	48,500	771,635.00	0.16
300	000552	甘肃能化	280,400	771,100.00	0.16
301	688100	威胜信息	21,300	771,060.00	0.16
302	688381	帝奥微	39,950	770,236.00	0.16
303	600727	鲁北化工	103,900	769,899.00	0.16
304	301136	招标股份	65,000	769,600.00	0.16
305	601311	骆驼股份	92,800	769,312.00	0.16
306	600717	天津港	157,800	768,486.00	0.16
307	688148	芳源股份	155,100	767,745.00	0.16
308	002690	美亚光电	51,800	767,676.00	0.16
309	300951	博硕科技	25,700	767,659.00	0.16
310	688336	三生国健	35,833	767,542.86	0.16
311	000828	东莞控股	71,800	767,542.00	0.16
312	002415	海康威视	25,000	767,500.00	0.16
313	002500	山西证券	122,200	767,416.00	0.16
314	601628	中国人寿	18,300	767,136.00	0.16
315	601002	晋亿实业	176,300	766,905.00	0.16
316	601377	兴业证券	122,500	766,850.00	0.16
317	688475	萤石网络	25,400	766,826.00	0.16
318	002534	西子洁能	69,000	766,590.00	0.16
319	002385	大北农	176,800	765,544.00	0.16
320	688621	阳光诺和	20,300	765,310.00	0.16
321	600032	浙江新能	103,400	765,160.00	0.16
322	000686	东北证券	96,300	764,622.00	0.16
323	603693	江苏新能	77,600	764,360.00	0.16
324	603408	建霖家居	61,000	764,330.00	0.16
325	002833	弘亚数控	45,400	764,082.00	0.16
326	688571	杭华股份	113,872	764,081.12	0.16
327	600475	华光环能	84,800	764,048.00	0.16
328	301029	怡合达	30,900	763,848.00	0.16
329	688566	吉贝尔	34,100	763,840.00	0.16
330	600863	内蒙华电	176,400	763,812.00	0.16
331	600061	国投资本	101,500	763,280.00	0.16

332	300203	聚光科技	50,100	763,023.00	0.16
333	688388	嘉元科技	51,800	763,014.00	0.16
334	000415	渤海租赁	202,300	762,671.00	0.16
335	000153	丰原药业	124,400	762,572.00	0.16
336	300357	我武生物	37,500	762,000.00	0.16
336	600519	贵州茅台	500	762,000.00	0.16
337	000928	中钢国际	119,600	761,852.00	0.16
338	688055	龙腾光电	184,300	761,159.00	0.16
339	688030	山石网科	49,100	761,050.00	0.16
340	688006	杭可科技	42,600	760,836.00	0.16
341	688561	奇安信	28,330	760,093.90	0.16
342	300618	寒锐钴业	22,500	759,825.00	0.16
343	000550	江铃汽车	32,400	759,780.00	0.16
344	688138	清溢光电	33,169	759,570.10	0.16
345	600742	一汽富维	85,800	759,330.00	0.16
346	002939	长城证券	92,600	759,320.00	0.16
347	002293	罗莱生活	97,300	758,940.00	0.16
348	002250	联化科技	137,700	758,727.00	0.16
349	601868	中国能建	331,300	758,677.00	0.16
350	601229	上海银行	82,900	758,535.00	0.16
351	688516	奥特维	17,500	757,925.00	0.16
352	300331	苏大维格	35,000	757,050.00	0.16
353	601089	福元医药	47,300	756,800.00	0.16
354	603966	法兰泰克	98,000	756,560.00	0.16
355	601198	东兴证券	68,700	756,387.00	0.16
356	600236	桂冠电力	111,200	756,160.00	0.16
357	688512	慧智微	76,242	755,558.22	0.16
358	300279	和晶科技	124,600	755,076.00	0.16
359	600328	中盐化工	95,900	754,733.00	0.16
360	601901	方正证券	90,600	754,698.00	0.16
361	601688	华泰证券	42,900	754,611.00	0.16
362	300150	世纪瑞尔	172,200	754,236.00	0.16
363	601108	财通证券	92,100	752,457.00	0.16
364	600420	国药现代	63,000	752,220.00	0.16
365	000598	兴蓉环境	99,100	752,169.00	0.16
366	002736	国信证券	67,100	751,520.00	0.16
367	688375	国博电子	15,200	750,272.00	0.16
368	688232	新点软件	25,862	749,739.38	0.16
369	688102	斯瑞新材	85,000	749,700.00	0.16
370	603987	康德莱	104,400	749,592.00	0.15
371	002498	汉缆股份	221,000	749,190.00	0.15
372	000065	北方国际	76,600	749,148.00	0.15
373	600731	湖南海利	131,400	748,980.00	0.15

374	688326	经纬恒润	8,900	748,490.00	0.15
375	002043	兔宝宝	63,000	748,440.00	0.15
376	300529	健帆生物	25,500	748,170.00	0.15
376	603288	海天味业	16,300	748,170.00	0.15
377	301307	美利信	36,800	748,144.00	0.15
378	688259	创耀科技	21,300	747,843.00	0.15
379	002533	金杯电工	76,000	747,840.00	0.15
380	688522	纳睿雷达	13,266	747,406.44	0.15
381	000401	冀东水泥	142,900	747,367.00	0.15
382	688556	高测股份	66,800	746,824.00	0.15
383	688428	诺诚健华	60,800	746,624.00	0.15
384	600195	中牧股份	111,200	746,152.00	0.15
385	300233	金城医药	62,100	745,200.00	0.15
386	600642	申能股份	78,500	744,965.00	0.15
387	002788	鹭燕医药	90,700	744,647.00	0.15
388	002434	万里扬	120,100	744,620.00	0.15
389	688579	山大地纬	81,000	744,390.00	0.15
390	300919	中伟股份	20,600	744,072.00	0.15
391	600780	通宝能源	132,100	743,723.00	0.15
392	600096	云天化	33,300	742,590.00	0.15
393	600310	广西能源	162,800	742,368.00	0.15
394	000090	天健集团	180,600	742,266.00	0.15
395	000990	诚志股份	95,700	741,675.00	0.15
396	300327	中颖电子	30,300	741,441.00	0.15
397	002382	蓝帆医疗	144,500	741,285.00	0.15
398	600023	浙能电力	130,900	740,894.00	0.15
399	300207	欣旺达	33,200	740,692.00	0.15
400	603588	高能环境	141,300	740,412.00	0.15
401	300726	宏达电子	23,800	740,180.00	0.15
402	000850	华茂股份	179,200	740,096.00	0.15
402	600248	陕建股份	165,200	740,096.00	0.15
403	688373	盟科药业	149,800	740,012.00	0.15
404	600998	九州通	144,500	739,840.00	0.15
405	002923	润都股份	77,500	739,350.00	0.15
406	600461	洪城环境	74,200	738,290.00	0.15
407	002166	莱茵生物	98,800	738,036.00	0.15
408	600866	星湖科技	114,000	737,580.00	0.15
409	000807	云铝股份	54,500	737,385.00	0.15
410	688585	上纬新材	110,700	737,262.00	0.15
411	688106	金宏气体	43,300	736,533.00	0.15
412	300772	运达股份	55,600	736,144.00	0.15
413	300003	乐普医疗	64,900	735,966.00	0.15
414	601827	三峰环境	85,700	735,306.00	0.15

415	688586	江航装备	76,600	733,062.00	0.15
416	600739	辽宁成大	70,800	732,780.00	0.15
417	688005	容百科技	23,200	731,960.00	0.15
418	000718	苏宁环球	309,900	731,364.00	0.15
419	600970	中材国际	77,100	730,908.00	0.15
420	688598	金博股份	34,700	730,782.00	0.15
421	002159	三特索道	46,800	730,548.00	0.15
422	301238	瑞泰新材	46,600	729,756.00	0.15
423	603367	辰欣药业	53,100	729,594.00	0.15
424	603799	华友钴业	24,900	728,574.00	0.15
425	301219	腾远钴业	16,100	727,881.00	0.15
426	000726	鲁泰 A	111,600	727,632.00	0.15
427	300142	沃森生物	60,200	727,216.00	0.15
428	603093	南华期货	61,100	727,090.00	0.15
429	600037	歌华有线	97,400	726,604.00	0.15
430	601668	中国建筑	121,100	726,600.00	0.15
431	688728	格科微	54,000	725,760.00	0.15
432	600528	中铁工业	90,000	725,400.00	0.15
433	002191	劲嘉股份	172,600	724,920.00	0.15
434	688061	灿瑞科技	25,100	724,888.00	0.15
435	300682	朗新集团	59,300	723,460.00	0.15
436	300057	万顺新材	149,900	722,518.00	0.15
437	000932	华菱钢铁	172,720	721,969.60	0.15
438	603111	康尼机电	119,700	721,791.00	0.15
439	688778	厦钨新能	15,800	721,112.00	0.15
440	301322	绿通科技	32,800	720,944.00	0.15
441	300316	晶盛机电	22,600	720,940.00	0.15
442	688580	伟思医疗	25,800	720,078.00	0.15
443	601992	金隅集团	404,200	719,476.00	0.15
444	688658	悦康药业	49,800	717,618.00	0.15
445	600643	爱建集团	138,800	717,596.00	0.15
446	603008	喜临门	42,800	717,328.00	0.15
447	300400	劲拓股份	44,200	716,924.00	0.15
448	688206	概伦电子	37,900	716,689.00	0.15
449	688687	凯因科技	33,200	716,456.00	0.15
450	300244	迪安诊断	63,100	716,185.00	0.15
451	002791	坚朗五金	31,400	714,036.00	0.15
452	601066	中信建投	27,700	713,275.00	0.15
453	300257	开山股份	78,200	713,184.00	0.15
454	688007	光峰科技	48,200	712,878.00	0.15
455	688079	美迪凯	82,300	712,718.00	0.15
456	600478	科力远	172,400	712,012.00	0.15
457	000965	天保基建	237,200	711,600.00	0.15

458	688651	盛邦安全	20,100	710,937.00	0.15
459	301282	金禄电子	33,900	710,205.00	0.15
460	688248	南网科技	22,100	709,189.00	0.15
461	688496	清越科技	82,700	708,739.00	0.15
462	300055	万邦达	147,900	708,441.00	0.15
463	688201	信安世纪	80,200	708,166.00	0.15
464	688261	东微半导	16,800	705,432.00	0.15
465	300390	天华新能	30,600	705,330.00	0.15
466	688711	宏微科技	40,791	704,868.48	0.15
467	688661	和林微纳	21,300	703,113.00	0.15
468	688001	华兴源创	25,800	699,180.00	0.14
469	688391	钜泉科技	22,900	695,015.00	0.14
470	688133	泰坦科技	38,000	693,120.00	0.14
471	688478	晶升股份	23,700	668,577.00	0.14
472	301276	嘉曼服饰	30,800	626,780.00	0.13
473	600997	开滦股份	89,800	607,048.00	0.13
474	688244	永信至诚	23,600	604,160.00	0.12
475	603277	银都股份	25,200	583,884.00	0.12
476	688531	日联科技	12,200	581,086.00	0.12
477	002812	恩捷股份	17,600	563,024.00	0.12
478	001328	登康口腔	17,400	552,624.00	0.11
479	688559	海目星	16,000	550,400.00	0.11
480	688722	同益中	42,500	541,875.00	0.11
481	002825	纳尔股份	66,400	519,248.00	0.11
482	600143	金发科技	57,400	495,936.00	0.10
483	688157	松井股份	11,200	440,272.00	0.09
484	002780	三夫户外	33,900	428,835.00	0.09
485	601728	中国电信	59,300	428,146.00	0.09
486	300741	华宝股份	24,500	426,055.00	0.09
487	300110	华仁药业	119,800	421,696.00	0.09
488	600505	西昌电力	34,800	421,080.00	0.09
489	002891	中宠股份	11,700	417,690.00	0.09
490	600104	上汽集团	20,100	417,276.00	0.09
491	000938	紫光股份	14,900	414,667.00	0.09
492	002847	盐津铺子	6,600	413,160.00	0.09
493	600405	动力源	72,700	411,482.00	0.09
494	600919	江苏银行	41,000	402,620.00	0.08
495	301498	乖宝宠物	5,100	399,432.00	0.08
496	603918	金桥信息	31,400	399,408.00	0.08
497	002179	中航光电	10,000	393,000.00	0.08
498	301015	百洋医药	16,200	392,202.00	0.08
499	002605	姚记科技	14,600	389,236.00	0.08
500	603721	中广天择	14,900	388,443.00	0.08

501	000917	电广传媒	54,000	381,780.00	0.08
502	300634	彩讯股份	17,500	381,500.00	0.08
503	688356	键凯科技	6,700	381,498.00	0.08
504	601019	山东出版	33,300	377,955.00	0.08
505	688676	金盘科技	9,100	376,922.00	0.08
506	301269	华大九天	3,100	375,410.00	0.08
507	605196	华通线缆	31,900	372,592.00	0.08
508	603039	泛微网络	7,600	372,400.00	0.08
509	603868	飞科电器	8,900	369,528.00	0.08
510	688793	倍轻松	12,400	369,520.00	0.08
511	301070	开勒股份	6,600	366,432.00	0.08
512	600577	精达股份	49,600	361,584.00	0.07
513	000880	潍柴重机	20,800	359,840.00	0.07
514	300170	汉得信息	28,100	348,440.00	0.07
515	002075	沙钢股份	55,600	348,056.00	0.07
516	002130	沃尔核材	13,700	345,925.00	0.07
517	002391	长青股份	64,800	324,648.00	0.07
518	300587	天铁科技	71,800	315,202.00	0.07
519	600268	国电南自	44,400	298,368.00	0.06
520	605369	拱东医疗	10,500	294,840.00	0.06
521	000876	新希望	32,600	292,748.00	0.06
522	600266	城建发展	55,600	283,560.00	0.06
523	600999	招商证券	8,000	153,280.00	0.03
524	688370	丛麟科技	6,700	131,521.00	0.03
525	002412	汉森制药	20,900	125,609.00	0.03
526	688472	阿特斯	8,402	105,529.12	0.02
527	000055	方大集团	23,200	91,408.00	0.02
528	601166	兴业银行	3,300	63,228.00	0.01
529	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
530	600521	华海药业	3,200	57,184.00	0.01
531	688429	时创能源	3,198	54,525.90	0.01
532	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
533	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.01
534	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
535	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
536	605286	同力日升	1,200	36,192.00	0.01
537	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.01
538	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
539	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
540	001391	国货航	3,891	26,458.80	0.01
541	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.01
542	688408	中信博	298	21,456.00	0.00
543	600566	济川药业	700	20,356.00	0.00

544	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
545	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
546	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
547	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
548	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
549	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
550	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
551	301277	新天地	921	12,737.43	0.00
552	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
553	601636	旗滨集团	2,100	11,781.00	0.00
554	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
555	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
556	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
557	601966	玲珑轮胎	600	10,824.00	0.00
558	605098	行动教育	300	10,572.00	0.00
559	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
560	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
561	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
562	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
563	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
564	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
565	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
566	301550	斯菱股份	100	7,279.00	0.00
567	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
568	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
569	001359	平安电工	184	4,767.44	0.00
570	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
571	301373	凌玮科技	176	4,466.88	0.00
572	002273	水晶光电	200	4,444.00	0.00
573	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
574	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
575	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
576	000883	湖北能源	200	996.00	0.00
577	301376	致欧科技	26	497.12	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	002605	姚记科技	14,734,049.00	2.51
2	603379	三美股份	14,551,597.00	2.48
3	688601	力芯微	14,443,105.63	2.46
4	600438	通威股份	13,989,200.00	2.38

5	002371	北方华创	13,851,656.21	2.36
6	600642	申能股份	13,802,581.60	2.35
7	600566	济川药业	13,331,998.00	2.27
8	000915	华特达因	13,247,768.00	2.25
9	002138	顺络电子	12,950,179.00	2.20
10	300413	芒果超媒	12,847,429.00	2.19
11	600866	星湖科技	12,706,527.00	2.16
12	600529	山东药玻	12,362,633.00	2.10
13	002422	科伦药业	12,359,369.00	2.10
14	688516	奥特维	12,151,846.17	2.07
15	600176	中国巨石	12,086,844.00	2.06
16	301236	软通动力	11,825,915.00	2.01
17	600153	建发股份	11,696,437.00	1.99
18	002043	兔宝宝	11,320,638.00	1.93
19	600285	羚锐制药	11,286,932.00	1.92
20	600577	精达股份	11,111,433.57	1.89

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

8.4.2 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	600566	济川药业	15,712,888.00	2.67
2	300418	昆仑万维	14,833,907.00	2.52
3	600642	申能股份	14,811,084.50	2.52
4	600438	通威股份	14,584,620.00	2.48
5	688601	力芯微	14,542,044.70	2.47
6	002605	姚记科技	14,143,172.00	2.41
7	600529	山东药玻	14,032,981.00	2.39
8	301236	软通动力	13,997,790.00	2.38
9	603379	三美股份	13,940,609.74	2.37
10	002138	顺络电子	13,378,576.00	2.28
11	002422	科伦药业	13,228,227.00	2.25
12	600176	中国巨石	12,995,561.86	2.21
13	002371	北方华创	12,542,686.00	2.13
14	600373	中文传媒	11,912,390.00	2.03
15	300413	芒果超媒	11,772,041.92	2.00
16	600866	星湖科技	11,768,313.00	2.00
17	601728	中国电信	11,710,810.00	1.99
18	600285	羚锐制药	11,614,908.00	1.98
19	000915	华特达因	11,186,275.00	1.90
20	603993	洛阳钼业	11,062,257.31	1.88

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,272,652,116.73
卖出股票收入（成交）总额	6,417,606,267.93

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,616,919.86	1.57
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	7,616,919.86	1.57

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	50,000	5,063,169.86	1.05
2	019698	23 国债 05	25,000	2,553,750.00	0.53

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,215,617.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,215,617.94

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688615	合合信息	47,910.42	0.01	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
中欧金安 量化混合 A	4,228	108,497.08	6,304,480.09	1.37%	452,421,182.90	98.63%
中欧金安 量化混合 C	626	90,472.79	50,689.90	0.09%	56,585,279.07	99.91%
合计	4,854	106,172.57	6,355,169.99	1.23%	509,006,461.97	98.77%

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	中欧金安量化混合 A	438,089.85	0.10%
	中欧金安量化混合 C	0.00	0.00%
	合计	438,089.85	0.09%

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	中欧金安量化混合 A	10~50
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧金安量化混合 A	10~50
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	10~50

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
曲径	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
基金合同生效日 （2022 年 1 月 20 日） 基金份额总额	893,269,013.78	139,571,239.72
本报告期期初基金份额总额	608,617,669.78	84,430,248.65
本报告期基金总申购份额	90,974,868.35	15,924,236.00
减：本报告期基金总赎回份额	240,866,875.14	43,718,515.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	458,725,662.99	56,635,968.97

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动
本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 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

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事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 50,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
中国中金财富证券	3	12,474,709,123.63	98.33	4,172,646.29	91.21	-
国金证券	3	211,363,983.58	1.67	402,189.88	8.79	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

中国中金财富证券	7,572,709.59	100.00	17,000,000.00	100.00	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

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	中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
8	中欧金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-25
9	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
11	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
13	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
14	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-10-25

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日