

中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧瑾源灵活配置混合	
基金主代码	001146	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 31 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	185,380,616.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧瑾源灵活配置混合 A	中欧瑾源灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001146	001147
报告期末下属分级基金的份额总额	977,073.55 份	184,403,543.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。
业绩比较基准	金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	方圆
	联系电话	021-68609600	95559
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95559
传真		021-50190017	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	窦玉明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	中欧瑾源灵活配置混合 A	中欧瑾源灵活配置混合 C
本期已实现收益	51,994.65	2,785,530.18
本期利润	129,108.87	5,668,503.88
加权平均基金份额 本期利润	0.0233	0.0263
本期加权平均净 值利润率	1.58%	1.89%
本期基金份额净 值增长率	1.40%	1.48%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	337,352.66	46,065,032.20
期末可供分配基 金份额利润	0.3453	0.2498
期末基金资产净 值	1,497,627.59	263,252,081.77

期末基金份额净值	1.5328	1.4276
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	53.28%	42.76%

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

中欧瑾源灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.20%	0.56%	0.23%	0.01%	2.97%	0.55%
过去三个月	2.25%	1.06%	0.69%	0.01%	1.56%	1.05%
过去六个月	1.40%	0.98%	1.36%	0.01%	0.04%	0.97%
过去一年	2.46%	0.73%	2.75%	0.01%	-0.29%	0.72%
过去三年	-6.03%	0.56%	8.25%	0.01%	-14.28%	0.55%
自基金合同生效起至今	53.28%	0.36%	28.53%	0.01%	24.75%	0.35%

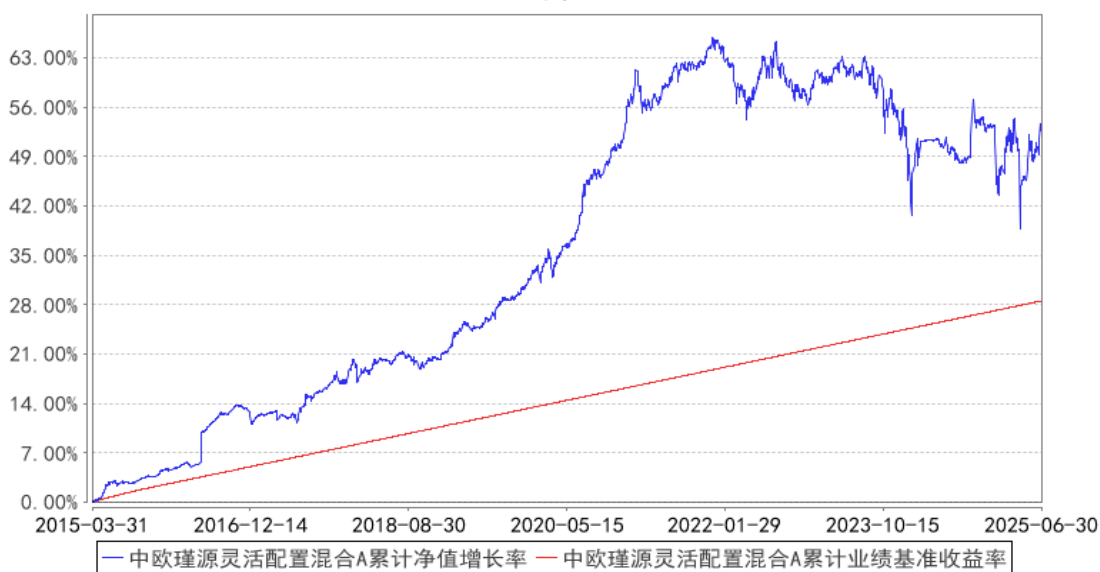
中欧瑾源灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.20%	0.55%	0.23%	0.01%	2.97%	0.54%
过去三个月	2.25%	1.06%	0.69%	0.01%	1.56%	1.05%
过去六个月	1.48%	0.98%	1.36%	0.01%	0.12%	0.97%

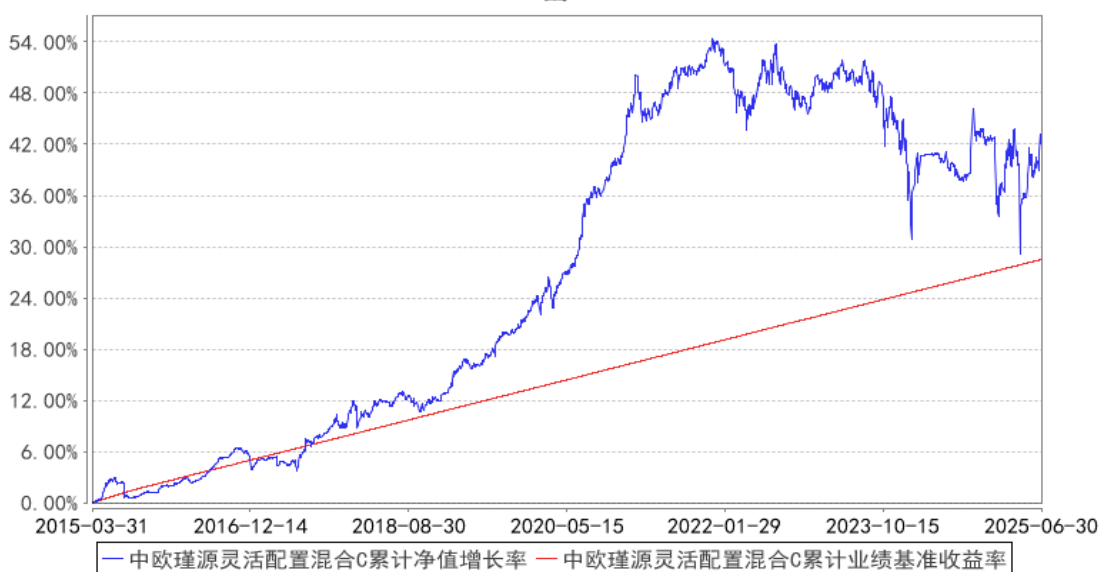
过去一年	2.54%	0.73%	2.75%	0.01%	-0.21%	0.72%
过去三年	-5.97%	0.56%	8.25%	0.01%	- 14.22%	0.55%
自基金合同生效 起至今	42.76%	0.35%	28.53%	0.01%	14.23%	0.34%

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

中欧瑾源灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧瑾源灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 208 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		
胡闾洋	基金经理 / 基金经理助理	2022-08-16	—	9 年	历任中诚宝捷思货币经纪有限公司经纪人，上海光大证券资产管理有限公司交易员。2020-11-13 加入中欧基金管理有限公司。
李波	基金经理 / 基金经理助理	2023-11-10	—	7 年	历任海通证券股份有限公司研究所固定收益分析师。2020-04-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
袁田	基金经理助理	2024-06-18	—	7 年	历任上海光大证券资产管理有限公司信用研究员。2020-08-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理助理。

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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中胡闾洋担任本基金的基金经理；李波担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，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。

本报告期内，本基金管理人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 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 19 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，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

2025 年上半年，权益市场整体呈现震荡向上的局面，虽然中间有关税问题的扰动，一度也出现剧烈的波动，但市场很快修复并重新走强。今年大家纠结的地方在于基本面和市场的关系，在没有看到基本面大幅改善，同时关税不确定的背景下，市场却走出了新高，超出了很多人的预期。我们认为市场走强的原因确实与流动性和风险偏好相关度更大，一方面，市场有比较强的托底力量，在出现剧烈波动时，能够有效化解风险，这给了市场很强的信心。另一方面，过低的无风险利率也在潜移默化影响资金的行为，纯债的收益无法满足居民的需求，资金也在慢慢地流向权益。两个变量一个显性，一个隐性，但无疑都在提供增量资金，并提升风险偏好。

与此同时，今年市场的风格也有比较大的变化，突出的感受就是轮动很快，比如年初在交易科技，二季度切换到新消费、创新药，最近又开始交易周期，市场几个大的板块上半年几乎都被轮动过。此外，今年市场的交易范围偏窄，即使在板块内部也会很聚焦，例如新消费和老消费，国产算力和海外算力等，市场每个阶段只聚焦最细分的方向。这些交易现象也与我们前面说的因素有关，基本面没有明显向上，资金和风偏又比较活跃，自然会不断去找当期变化最大的方向，导致了快速的轮动和结构的分化。

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 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%；基金 C 类份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对权益还是保持相对乐观的观点，宏观背景没有发生太大变化，资金和风险偏好还是主导市场最主要的因素。因此权益可能会呈现震荡向上的局面，只是板块间轮动较快，操作上提高了一定的难度。而针对这一问题，我们认为均衡配置也是不错的应对思路，至少能够保证组合风险收益特征的稳定，获取市场向上的 beta 收益。

产品运作层面，我们今年大幅提升了股票仓位，上半年整体保持高权益仓位和低债券仓位的运作模式。下半年这一定位也不会有太大变化，权益仓位依然会保持较高水平。策略层面，我们继续保持分散化的配置思路，降低个股权重，同时持仓保持组合整体的稳定性。在获取市场 beta 收益的基础上，我们力争通过打新等方式提供一定的收益，保证组合的业绩。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，基金托管人在中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，中欧基金管理有限公司在中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,685,277.51	8,139,391.21
结算备付金		189,865.23	212,422.83
存出保证金		96,843.40	8,556.43
交易性金融资产	6.4.7.2	268,610,318.18	269,365,245.84
其中：股票投资		255,456,341.20	254,209,334.88
基金投资		—	—
债券投资		13,153,976.98	15,155,910.96
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		11,788,664.95	2,252,474.09
应收股利		-	-
应收申购款		580.00	1.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		282,371,549.27	279,978,091.40
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,500,000.00	-
应付清算款		-	35,189.13
应付赎回款		10,826,701.60	279.29
应付管理人报酬		148,819.98	41,929.65
应付托管费		37,204.98	10,482.39
应付销售服务费		2,468.29	429.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	1.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	106,644.85	188,679.23
负债合计		17,621,839.91	276,990.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	185,380,616.95	197,281,877.59
未分配利润	6.4.7.8	79,369,092.41	82,419,223.37
净资产合计		264,749,709.36	279,701,100.96
负债和净资产总计		282,371,549.27	279,978,091.40

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 185,380,616.95 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.5328 元，基金份额总额 977,073.55 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.4276 元，基金份额总额 184,403,543.40 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,086,199.53	-1,884,726.70
1. 利息收入		21,769.50	42,360.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,769.50	31,244.65
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		-	11,115.48
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		4,066,597.09	-1,711,160.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	368,964.27	45,553.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	122,638.33	-1,798,984.03
资产支持证券投 资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	3,574,994.49	42,269.50
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,960,087.92	-216,057.48
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	37,745.02	131.64
减：二、营业总支出		1,288,586.78	212,353.37
1. 管理人报酬		915,687.50	112,609.87
2. 托管费		228,921.82	28,152.48
3. 销售服务费		14,805.57	927.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		30,938.62	7,157.57

其中：卖出回购金融资产支出		30,938.62	7,157.57
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.11	102.17
8. 其他费用	6.4.7.18	98,233.16	63,403.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,797,612.75	-2,097,080.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,797,612.75	-2,097,080.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,797,612.75	-2,097,080.07

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	197,281,877.59	-	82,419,223.37	279,701,100.96
二、本期期初净资产	197,281,877.59	-	82,419,223.37	279,701,100.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,901,260.64	-	-3,050,130.96	-14,951,391.60
（一）、综合收益总额	-	-	5,797,612.75	5,797,612.75
（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）	-11,901,260.64	-	-8,847,743.71	-20,749,004.35
其中：1. 基金申购款	57,888,069.49	-	22,224,908.30	80,112,977.79
2. 基金赎回款	-69,789,330.13	-	-31,072,652.01	-100,861,982.14
（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	185,380,616.95	-	79,369,092.41	264,749,709.36
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,510,726.96	-	12,878,821.17	41,389,548.13
二、本期期初净资产	28,510,726.96	-	12,878,821.17	41,389,548.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,280,079.68	-	2,949,659.88	9,229,739.56
（一）、综合收益总额	-	-	-2,097,080.07	-2,097,080.07
（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）	6,280,079.68	-	5,046,739.95	11,326,819.63
其中：1. 基金申购款	25,973,142.75	-	12,600,668.85	38,573,811.60
2. 基金赎回款	-19,693,063.07	-	-7,553,928.90	-27,246,991.97
（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	34,790,806.64	-	15,828,481.05	50,619,287.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧瑾源灵活配置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[2015]第 380 号《关于准予中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《中欧瑾源灵活配置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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,750,827,553.90 元。经向中国证监会备案，《中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,751,023,306.96 份基金份额，其中认购资金利息折合 195,753.06 份基金份额，其中瑾源 A 的基金份额总额为 1,621,903,815.13 份，包含认购资金利息折合 90,754.93 份，瑾源 C 的基金份额总额为 3,129,119,491.83 份，包含认购资金利息折合 104,998.13 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,685,277.51
等于：本金	1,684,306.88
加：应计利息	970.63
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,685,277.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		256,065,087.94	—	255,456,341.20	-608,746.74
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	13,001,130.00	154,276.98	13,153,976.98	-1,430.00
	银行间市场	—	—	—	—

	合计	13,001,130.00	154,276.98	13,153,976.98	-1,430.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		269,066,217.94	154,276.98	268,610,318.18	-610,176.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,301.69
其中：交易所市场	27,301.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	106,644.85

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧瑾源灵活配置混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,718,068.46	20,718,068.46
本期申购	140,776.56	140,776.56
本期赎回（以“-”号填列）	-19,881,771.47	-19,881,771.47

本期末	977,073.55	977,073.55
-----	------------	------------

中欧瑾源灵活配置混合 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,563,809.13	176,563,809.13
本期申购	57,747,292.93	57,747,292.93
本期赎回（以“-”号填列）	-49,907,558.66	-49,907,558.66
本期末	184,403,543.40	184,403,543.40

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧瑾源灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,879,077.36	3,722,736.68	10,601,814.04
本期期初	6,879,077.36	3,722,736.68	10,601,814.04
本期利润	51,994.65	77,114.22	129,108.87
本期基金份额交易产生的变动数	-6,593,719.35	-3,616,649.52	-10,210,368.87
其中：基金申购款	47,075.97	21,001.18	68,077.15
基金赎回款	-6,640,795.32	-3,637,650.70	-10,278,446.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	337,352.66	183,201.38	520,554.04

中欧瑾源灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,715,410.82	30,101,998.51	71,817,409.33
本期期初	41,715,410.82	30,101,998.51	71,817,409.33
本期利润	2,785,530.18	2,882,973.70	5,668,503.88
本期基金份额交易产生的变动数	1,564,091.20	-201,466.04	1,362,625.16
其中：基金申购款	13,733,131.85	8,423,699.30	22,156,831.15
基金赎回款	-12,169,040.65	-8,625,165.34	-20,794,205.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,065,032.20	32,783,506.17	78,848,538.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,922.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,621.36

其他	11,225.24
合计	21,769.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	86,406,600.31
减：卖出股票成本总额	85,911,893.33
减：交易费用	125,742.71
买卖股票差价收入	368,964.27

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	129,826.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,187.87
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	122,638.33

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,156,132.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,063,300.00
减：应计利息总额	100,018.05
减：交易费用	2.34
买卖债券差价收入	-7,187.87

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,574,994.49
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	3,574,994.49

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,960,087.92
股票投资	2,987,877.92
债券投资	-27,790.00
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	2,960,087.92

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	37,744.45
基金转换费收入	0.57
合计	37,745.02

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	290.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	98,233.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
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
自然人股东	基金管理人股东
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）

国都证券	6,589,732.66	3.96	11,485,533.80	94.74
------	--------------	------	---------------	-------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
国都证券	-	-	61,558,062.85	31.90

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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（%）
国都证券	48,000,000.00	23.18	65,460,000.00	68.68

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国都证券	2,872.76	3.96	196.51	0.72
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国都证券	8,134.22	94.48	8,134.22	94.48

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）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	915,687.50	112,609.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,424.00	10,693.99
应支付基金管理人的净管理费	895,263.50	101,915.88

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	228,921.82	28,152.48

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中欧瑾源灵活配置混 合 A	中欧瑾源灵活配置混 合 C	合计
中欧财富	0.00	11.53	11.53
中欧基金	0.00	13,241.12	13,241.12
合计	0.00	13,252.65	13,252.65
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧瑾源灵活配置混 合 A	中欧瑾源灵活配置混 合 C	合计
中欧财富	0.00	92.50	92.50
中欧基金	0.00	492.05	492.05
合计	0.00	584.55	584.55

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.50%。

计算方法如下

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、根据基金管理人中欧基金管理有限公司 2017 年 11 月 3 日《中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金实施销售服务费率优惠的公告》的规定，自 2017 年 11 月 6 日起，基金销售服务费率由 0.50%/年调整为 0.01%/年。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧瑾源灵活配置混合 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
报告期初持有的 基金份额	19,858,343.15	0.00
报告期间申购/买 入总份额	0.00	19,858,343.15
报告期间因拆分 变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回 /卖出总份额	19,858,343.15	0.00
报告期末持有的 基金份额	0.00	19,858,343.15
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	0.00	94.40%

- 注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
- 2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 3、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 C 类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧瑾源灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	45.58	0.00%	54.49	0.00%

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,685,277.51	8,922.90	1,445,185.75	29,140.51

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	C 信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	C 信	2025 年 6	6 个月	新股流通	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

	通电子	月 24 日		受限						
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	318	8,745.00	17,868.42	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.49	45.22	305	8,383.20	13,792.10	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	71	6,361.60	9,903.08	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏	2025	6 个月	新股	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-

	工科技	年 4 月 10 日		流通受限						
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	161	4,266.50	5,261.48	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	143	6,649.50	6,127.55	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	49	4,581.50	4,442.34	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海	2025	6 个月	新股	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	阳科技	年 6 月 5 日		流通受限						
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	XD 汇通控	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	542	10,503.96	45,251.58	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	XD 胜科纳	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	260	12,290.20	32,281.60	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 6,500,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规

定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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发行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 6.4.12 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 2025 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,685,277.51	-	-	-	1,685,277.51
结算备付金	189,865.23	-	-	-	189,865.23
存出保证金	96,843.40	-	-	-	96,843.40
交易性金融资产	13,153,976.98	-	-	-255,456,341.20	268,610,318.18
应收申购款	-	-	-	580.00	580.00
应收清算款	-	-	-	11,788,664.95	11,788,664.95
资产总计	15,125,963.12	-	-	-267,245,586.15	282,371,549.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,826,701.60	10,826,701.60
应付管理人报酬	-	-	-	148,819.98	148,819.98
应付托管费	-	-	-	37,204.98	37,204.98
卖出回购金融资产款	6,500,000.00	-	-	-	6,500,000.00
应付销售服务费	-	-	-	2,468.29	2,468.29
应交税费	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	106,644.85	106,644.85
负债总计	6,500,000.00	-	-	11,121,839.91	17,621,839.91
利率敏感度缺口	8,625,963.12	-	-	-256,123,746.24	264,749,709.36
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	8,139,391.21	-	-	-	8,139,391.21
结算备付金	212,422.83	-	-	-	212,422.83
存出保证金	8,556.43	-	-	-	8,556.43
交易性金融资产	15,155,910.96	-	-	-254,209,334.88	269,365,245.84
应收申购款	-	-	-	1.00	1.00
应收清算款	-	-	-	2,252,474.09	2,252,474.09
资产总计	23,516,281.43	-	-	-256,461,809.97	279,978,091.40
负债					

应付赎回款	-	-	-	279.29	279.29
应付管理人报酬	-	-	-	41,929.65	41,929.65
应付托管费	-	-	-	10,482.39	10,482.39
应付清算款	-	-	-	35,189.13	35,189.13
应付销售服务费	-	-	-	429.30	429.30
应交税费	-	-	-	1.45	1.45
其他负债	-	-	-	188,679.23	188,679.23
负债总计	-	-	-	276,990.44	276,990.44
利率敏感度缺口	23,516,281.43	-	-	-256,184,819.53	279,701,100.96

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 4.97%（2024 年 12 月 31 日：5.42%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	255,456,341.20	96.49	254,209,334.88	90.89

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	255,456,341.20	96.49	254,209,334.88	90.89

6.4.13.4.3.2 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6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	-244,276,099.09	214,526,066.03
	业绩比较基准下降5%	244,276,099.09	-214,526,066.03

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	255,158,436.74	254,209,334.88
第二层次	13,169,362.52	15,155,910.96
第三层次	282,518.92	-

合计	268,610,318.18	269,365,245.84
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	255,456,341.20	90.47
	其中：股票	255,456,341.20	90.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,153,976.98	4.66
	其中：债券	13,153,976.98	4.66
	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	1,875,142.74	0.66
8	其他各项资产	11,886,088.35	4.21
9	合计	282,371,549.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,770,604.00	1.05
B	采矿业	13,956,131.00	5.27
C	制造业	132,341,722.02	49.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,405,486.00	3.55
E	建筑业	4,844,307.00	1.83
F	批发和零售业	753,896.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	9,234,461.00	3.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,475,399.80	4.33
J	金融业	62,699,388.88	23.68
K	房地产业	1,974,183.00	0.75
L	租赁和商务服务业	2,333,685.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	2,944,485.50	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	722,592.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	255,456,341.20	96.49

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	8,200	11,558,064.00	4.37
2	300750	宁德时代	32,800	8,272,816.00	3.12
3	601318	XD 中国平	132,700	7,362,196.00	2.78
4	600036	招商银行	150,800	6,929,260.00	2.62
5	601899	紫金矿业	242,000	4,719,000.00	1.78
6	600900	长江电力	152,200	4,587,308.00	1.73
7	000333	美的集团	60,800	4,389,760.00	1.66
8	601166	兴业银行	186,500	4,352,910.00	1.64
9	002594	比亚迪	11,700	3,883,347.00	1.47
10	300059	东方财富	145,400	3,363,102.00	1.27
11	600030	中信证券	117,500	3,245,350.00	1.23
12	600276	恒瑞医药	62,200	3,228,180.00	1.22
13	601398	工商银行	413,600	3,139,224.00	1.19
14	000858	五 粮 液	24,900	2,960,610.00	1.12
15	000651	格力电器	55,400	2,488,568.00	0.94
16	601211	国泰海通	125,168	2,398,218.88	0.91
17	601288	农业银行	380,500	2,237,340.00	0.85
18	600887	伊利股份	80,100	2,233,188.00	0.84
19	603259	药明康德	31,900	2,218,645.00	0.84
20	600919	江苏银行	178,100	2,126,514.00	0.80
21	601816	京沪高铁	363,000	2,087,250.00	0.79
22	688981	中芯国际	23,607	2,081,429.19	0.79
23	002475	立讯精密	59,200	2,053,648.00	0.78
24	300308	中际旭创	12,900	1,881,594.00	0.71
25	000725	京东方 A	467,800	1,866,522.00	0.71
26	600000	浦发银行	134,400	1,865,472.00	0.70
27	688041	海光信息	13,188	1,863,332.52	0.70
28	300760	迈瑞医疗	7,900	1,775,525.00	0.67
29	300124	汇川技术	26,800	1,730,476.00	0.65
30	002371	北方华创	3,900	1,724,619.00	0.65
31	002352	顺丰控股	34,500	1,682,220.00	0.64
32	601088	中国神华	40,200	1,629,708.00	0.62
33	601601	中国太保	42,700	1,601,677.00	0.60
34	688256	寒武纪	2,635	1,584,952.50	0.60
35	002714	牧原股份	36,800	1,545,968.00	0.58
36	601668	中国建筑	255,900	1,476,543.00	0.56
37	600016	民生银行	310,300	1,473,925.00	0.56
38	601728	中国电信	190,100	1,473,275.00	0.56
39	300502	新易盛	11,580	1,470,891.60	0.56
40	601988	中国银行	253,100	1,422,422.00	0.54
41	601127	赛力斯	10,400	1,396,928.00	0.53
42	000001	平安银行	115,700	1,396,499.00	0.53
43	600031	三一重工	74,800	1,342,660.00	0.51

44	603501	豪威集团	10,500	1,340,325.00	0.51
45	601229	上海银行	123,300	1,308,213.00	0.49
46	600309	万华化学	24,000	1,302,240.00	0.49
47	002415	海康威视	46,600	1,292,218.00	0.49
48	000063	中兴通讯	39,600	1,286,604.00	0.49
49	603019	中科曙光	18,100	1,274,240.00	0.48
50	601919	中远海控	84,100	1,264,864.00	0.48
51	600941	中国移动	11,200	1,260,560.00	0.48
52	601857	中国石油	145,400	1,243,170.00	0.47
53	300498	温氏股份	71,700	1,224,636.00	0.46
54	603986	兆易创新	9,600	1,214,688.00	0.46
55	688008	澜起科技	14,664	1,202,448.00	0.45
56	601169	北京银行	173,900	1,187,737.00	0.45
57	300274	阳光电源	17,500	1,185,975.00	0.45
58	600690	海尔智家	47,000	1,164,660.00	0.44
59	600660	福耀玻璃	20,200	1,151,602.00	0.43
60	601012	隆基绿能	76,400	1,147,528.00	0.43
61	601688	华泰证券	63,700	1,134,497.00	0.43
62	600406	国电南瑞	50,300	1,127,223.00	0.43
63	002230	科大讯飞	23,400	1,120,392.00	0.42
64	002142	宁波银行	40,600	1,110,816.00	0.42
65	601766	中国中车	153,400	1,079,936.00	0.41
66	000100	TCL 科技	248,600	1,076,438.00	0.41
67	600028	中国石化	189,000	1,065,960.00	0.40
68	600809	山西汾酒	6,000	1,058,340.00	0.40
69	600050	中国联通	196,500	1,049,310.00	0.40
70	000338	潍柴动力	68,200	1,048,916.00	0.40
71	000568	泸州老窖	9,200	1,043,280.00	0.39
72	601138	工业富联	47,900	1,024,102.00	0.39
73	600104	上汽集团	60,600	972,630.00	0.37
74	601225	陕西煤业	49,400	950,456.00	0.36
75	601985	中国核电	101,900	949,708.00	0.36
76	002027	分众传媒	129,700	946,810.00	0.36
77	601818	光大银行	227,800	945,370.00	0.36
78	688012	中微公司	5,101	929,912.30	0.35
79	605499	东鹏饮料	2,800	879,340.00	0.33
80	600150	中国船舶	26,700	868,818.00	0.33
81	603288	海天味业	22,200	863,802.00	0.33
82	603993	洛阳钼业	102,200	860,524.00	0.33
83	601628	中国人寿	20,600	848,514.00	0.32
84	601006	大秦铁路	126,000	831,600.00	0.31
85	002463	沪电股份	19,300	821,794.00	0.31
86	600111	北方稀土	32,800	816,720.00	0.31

87	688111	金山办公	2,906	813,825.30	0.31
88	000425	徐工机械	104,500	811,965.00	0.31
89	000625	长安汽车	62,900	802,604.00	0.30
90	000792	盐湖股份	46,300	790,804.00	0.30
91	600926	杭州银行	46,400	780,448.00	0.29
92	600760	中航沈飞	13,300	779,646.00	0.29
93	601009	南京银行	66,900	777,378.00	0.29
94	600999	招商证券	43,700	768,683.00	0.29
95	600436	片仔癀	3,800	760,038.00	0.29
96	600905	三峡能源	177,300	755,298.00	0.29
97	601888	中国中免	12,300	749,931.00	0.28
98	601939	建设银行	79,400	749,536.00	0.28
99	601658	邮储银行	135,400	740,638.00	0.28
100	600019	宝钢股份	112,300	740,057.00	0.28
101	600089	特变电工	62,000	739,660.00	0.28
102	002050	三花智控	27,800	733,364.00	0.28
103	600048	保利发展	90,400	732,240.00	0.28
104	600938	中国海油	27,700	723,247.00	0.27
105	300015	爱尔眼科	57,900	722,592.00	0.27
106	601825	沪农商行	73,400	711,980.00	0.27
107	601390	中国中铁	126,500	709,665.00	0.27
108	600547	山东黄金	22,100	705,653.00	0.27
109	000938	紫光股份	28,800	690,912.00	0.26
110	688271	联影医疗	5,388	688,263.12	0.26
111	300033	同花顺	2,500	682,525.00	0.26
112	002241	歌尔股份	29,100	678,612.00	0.26
113	300014	亿纬锂能	14,800	677,988.00	0.26
114	601600	中国铝业	96,000	675,840.00	0.26
115	600585	海螺水泥	31,300	672,011.00	0.25
116	600893	航发动力	17,300	666,742.00	0.25
117	000977	浪潮信息	13,000	661,440.00	0.25
118	002179	中航光电	16,300	657,868.00	0.25
119	002422	科伦药业	18,200	653,744.00	0.25
120	601989	中国重工	139,500	647,280.00	0.24
121	600415	小商品城	30,800	636,944.00	0.24
122	000538	云南白药	11,400	636,006.00	0.24
123	002311	海大集团	10,800	632,772.00	0.24
124	600958	东方证券	64,100	620,488.00	0.23
125	600015	华夏银行	78,400	620,144.00	0.23
126	601838	成都银行	30,800	619,080.00	0.23
127	000776	广发证券	36,800	618,608.00	0.23
128	601077	渝农商行	86,400	616,896.00	0.23
129	601916	浙商银行	181,300	614,607.00	0.23

130	600489	中金黄金	41,600	608,608.00	0.23
131	603799	华友钴业	16,200	599,724.00	0.23
132	600438	通威股份	35,200	589,600.00	0.22
133	600584	长电科技	17,100	576,099.00	0.22
134	601336	新华保险	9,800	573,300.00	0.22
135	002028	思源电气	7,800	568,698.00	0.21
136	300408	三环集团	16,900	564,460.00	0.21
137	002460	赣锋锂业	16,600	560,582.00	0.21
138	300433	蓝思科技	24,900	555,270.00	0.21
139	000002	万 科 A	86,400	554,688.00	0.21
140	002049	紫光国微	8,400	553,224.00	0.21
141	600795	国电电力	109,300	529,012.00	0.20
142	601377	兴业证券	85,200	527,388.00	0.20
143	600010	宝钢股份	293,800	525,902.00	0.20
144	601669	中国电建	106,800	520,116.00	0.20
145	600009	上海机场	15,900	505,143.00	0.19
146	600570	恒生电子	15,000	503,100.00	0.19
147	601995	中金公司	14,100	498,576.00	0.19
148	002304	洋河股份	7,700	497,035.00	0.19
149	000963	华东医药	12,200	492,392.00	0.19
150	601901	方正证券	60,500	478,555.00	0.18
151	600160	巨化股份	16,600	476,088.00	0.18
152	601100	恒立液压	6,600	475,200.00	0.18
153	000768	中航西飞	17,200	470,248.00	0.18
154	300394	天孚通信	5,800	463,072.00	0.17
155	688036	传音控股	5,786	461,144.20	0.17
156	601186	中国铁建	57,100	457,371.00	0.17
157	000661	长春高新	4,600	456,228.00	0.17
158	601881	中国银河	26,600	456,190.00	0.17
159	600183	生益科技	15,100	455,265.00	0.17
160	600886	国投电力	30,600	451,044.00	0.17
161	301236	软通动力	8,200	448,048.00	0.17
162	000157	中联重科	61,300	443,199.00	0.17
163	600989	宝丰能源	27,100	437,394.00	0.17
164	000975	山金国际	22,800	431,832.00	0.16
165	601788	光大证券	24,000	431,520.00	0.16
166	600115	中国东航	105,000	423,150.00	0.16
167	002001	新 和 成	19,800	421,146.00	0.16
168	600426	XD 华鲁恒	19,300	418,231.00	0.16
169	600196	复星医药	16,600	416,494.00	0.16
170	601058	赛轮轮胎	31,600	414,592.00	0.16
171	688169	石头科技	2,619	410,004.45	0.15
172	601998	中信银行	48,100	408,850.00	0.15

173	002736	国信证券	35,300	406,656.00	0.15
174	601689	拓普集团	8,600	406,350.00	0.15
175	600066	宇通客车	16,200	402,732.00	0.15
176	600011	华能国际	56,200	401,268.00	0.15
177	002252	上海莱士	58,400	401,208.00	0.15
178	600029	南方航空	67,800	400,020.00	0.15
179	000807	云铝股份	25,000	399,500.00	0.15
180	300442	润泽科技	8,000	396,240.00	0.15
181	600674	川投能源	24,700	396,188.00	0.15
182	002466	天齐锂业	12,300	394,092.00	0.15
183	600346	恒力石化	27,600	393,576.00	0.15
184	000408	藏格矿业	9,200	392,564.00	0.15
185	001979	招商蛇口	44,700	392,019.00	0.15
186	601800	中国交建	44,000	391,160.00	0.15
187	603369	今世缘	10,000	389,300.00	0.15
188	300661	圣邦股份	5,300	385,681.00	0.15
189	600219	南山铝业	100,200	383,766.00	0.14
190	002648	卫星化学	22,000	381,260.00	0.14
191	688126	沪硅产业	20,361	381,157.92	0.14
192	002236	大华股份	24,000	381,120.00	0.14
193	300418	昆仑万维	11,100	373,293.00	0.14
194	688506	百利天恒	1,259	372,815.08	0.14
195	300347	泰格医药	6,900	367,908.00	0.14
196	601111	中国国航	46,600	367,674.00	0.14
197	601868	中国能建	162,200	361,706.00	0.14
198	601117	中国化学	47,000	360,490.00	0.14
199	002920	德赛西威	3,500	357,455.00	0.14
200	003816	中国广核	96,900	352,716.00	0.13
201	600741	华域汽车	19,900	351,235.00	0.13
202	600372	中航机载	29,100	350,946.00	0.13
203	601021	春秋航空	6,300	350,595.00	0.13
204	300896	爱美客	2,000	349,620.00	0.13
205	000786	北新建材	13,200	349,536.00	0.13
206	600588	用友网络	26,000	347,620.00	0.13
207	600460	XD 士兰微	14,000	347,480.00	0.13
208	600176	中国巨石	30,400	346,560.00	0.13
209	601633	长城汽车	16,100	345,828.00	0.13
210	002601	龙佰集团	21,300	345,273.00	0.13
211	002916	深南电路	3,200	344,992.00	0.13
212	300759	康龙化成	13,900	341,106.00	0.13
213	002074	国轩高科	10,500	340,830.00	0.13
214	300782	卓胜微	4,700	335,439.00	0.13
215	301269	华大九天	2,700	334,476.00	0.13

216	601319	中国人保	37,900	330,109.00	0.12
217	300832	新产业	5,800	328,976.00	0.12
218	000895	双汇发展	13,200	322,212.00	0.12
219	600085	XD 同仁堂	8,900	320,934.00	0.12
220	002493	荣盛石化	38,600	319,608.00	0.12
221	600600	青岛啤酒	4,600	319,516.00	0.12
222	000630	铜陵有色	95,000	317,300.00	0.12
223	603392	万泰生物	5,200	317,200.00	0.12
224	001965	招商公路	26,300	315,600.00	0.12
225	002129	TCL 中环	40,700	312,576.00	0.12
226	688396	华润微	6,585	310,548.60	0.12
227	600482	中国动力	13,300	306,831.00	0.12
228	600039	四川路桥	30,900	305,910.00	0.12
229	300122	智飞生物	15,200	297,768.00	0.11
230	002600	领益智造	34,400	295,496.00	0.11
231	600515	海南机场	83,400	295,236.00	0.11
232	601877	正泰电器	13,000	294,710.00	0.11
233	600161	天坛生物	15,300	293,607.00	0.11
234	002709	天赐材料	16,200	293,544.00	0.11
235	000596	古井贡酒	2,200	292,930.00	0.11
236	600362	江西铜业	12,400	290,532.00	0.11
237	603296	华勤技术	3,600	290,448.00	0.11
238	600188	兖矿能源	23,600	287,212.00	0.11
239	600233	圆通速递	21,800	281,002.00	0.11
240	002180	纳思达	12,000	275,280.00	0.10
241	000301	东方盛虹	32,900	274,057.00	0.10
242	000876	新 希 望	29,100	272,958.00	0.10
243	600845	宝信软件	11,500	271,630.00	0.10
244	605117	德业股份	5,100	268,566.00	0.10
245	600023	浙能电力	50,600	268,180.00	0.10
246	000999	华润三九	8,500	265,880.00	0.10
247	688223	晶科能源	50,701	263,138.19	0.10
248	002938	鹏鼎控股	8,200	262,646.00	0.10
249	601618	中国中冶	87,700	261,346.00	0.10
250	601607	上海医药	14,500	259,260.00	0.10
251	002459	晶澳科技	25,900	258,482.00	0.10
252	601872	招商轮船	40,300	252,278.00	0.10
253	600875	东方电气	15,000	251,100.00	0.09
254	601799	星宇股份	2,000	250,000.00	0.09
255	600027	华电国际	44,700	244,509.00	0.09
256	601898	中煤能源	21,900	239,586.00	0.09
257	600332	白云山	9,000	237,240.00	0.09
258	688047	龙芯中科	1,752	233,699.28	0.09

259	300999	金龙鱼	7,700	227,381.00	0.09
260	000983	山西焦煤	35,400	226,560.00	0.09
261	600803	新奥股份	11,800	223,020.00	0.08
262	300316	晶盛机电	8,200	222,630.00	0.08
263	300628	亿联网络	6,400	222,464.00	0.08
264	601238	广汽集团	29,700	222,453.00	0.08
265	600918	中泰证券	33,900	217,977.00	0.08
266	600025	华能水电	22,500	214,875.00	0.08
267	300413	芒果超媒	9,800	213,836.00	0.08
268	603260	合盛硅业	4,500	213,300.00	0.08
269	688599	天合光能	13,743	199,685.79	0.08
270	600018	上港集团	34,900	199,279.00	0.08
271	600026	中远海能	17,000	175,610.00	0.07
272	603195	公牛集团	3,620	174,665.00	0.07
273	603806	福斯特	13,100	169,776.00	0.06
274	688472	阿特斯	18,030	164,974.50	0.06
275	688009	中国通号	32,067	164,824.38	0.06
276	688303	大全能源	7,608	162,202.56	0.06
277	601699	潞安环能	15,300	161,415.00	0.06
278	601698	中国卫通	7,700	157,619.00	0.06
279	601865	福莱特	9,600	146,016.00	0.06
280	000708	中信特钢	12,400	145,824.00	0.06
281	688187	时代电气	3,350	142,877.50	0.05
282	603833	欧派家居	2,400	135,480.00	0.05
283	688082	盛美上海	1,052	119,864.88	0.05
284	300979	华利集团	2,000	105,140.00	0.04
285	601808	中海油服	7,500	103,200.00	0.04
286	600377	宁沪高速	6,400	98,176.00	0.04
287	688411	海博思创	542	45,251.58	0.02
288	001289	龙源电力	2,000	32,360.00	0.01
289	688775	影石创新	260	32,281.60	0.01
290	301275	汉朔科技	318	17,868.42	0.01
291	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
292	001388	C 信通电子	937	15,385.54	0.01
293	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.01
294	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.01
295	301501	恒鑫生活	305	13,792.10	0.01
296	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
297	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
298	301590	优优绿能	71	9,903.08	0.00
299	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
300	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
301	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00

302	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
303	603049	中策橡胶	143	6,127.55	0.00
304	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
305	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
306	603014	威高血净	161	5,261.48	0.00
307	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
308	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
309	603202	天有为	49	4,442.34	0.00
310	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
311	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
312	603409	XD 汇通控	100	3,332.00	0.00
313	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
314	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
315	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
316	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
317	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
318	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	XD 中国平	4,217,787.00	1.51
2	600919	江苏银行	2,582,702.80	0.92
3	600309	万华化学	2,131,594.00	0.76
4	600900	长江电力	2,046,566.00	0.73
5	000333	美的集团	1,824,808.00	0.65
6	601211	国泰海通	1,784,767.84	0.64
7	300750	宁德时代	1,708,883.00	0.61
8	002594	比亚迪	1,452,657.00	0.52
9	600519	贵州茅台	1,432,536.00	0.51
10	601288	农业银行	1,403,315.00	0.50
11	000651	格力电器	1,185,938.00	0.42
12	300059	东方财富	1,140,312.00	0.41
13	600000	浦发银行	1,103,299.00	0.39
14	600036	招商银行	1,052,930.00	0.38
15	600926	杭州银行	1,026,038.00	0.37
16	601658	邮储银行	1,024,147.00	0.37
17	601668	中国建筑	963,300.20	0.34
18	601825	沪农商行	855,909.00	0.31
19	601398	工商银行	778,532.00	0.28
20	002252	上海莱士	758,116.00	0.27

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,350,976.00	1.20
2	300750	宁德时代	2,694,836.00	0.96
3	600519	贵州茅台	2,512,589.00	0.90
4	601318	XD 中国平	2,411,739.00	0.86
5	300059	东方财富	1,587,928.00	0.57
6	600900	长江电力	1,473,358.00	0.53
7	600837	海通证券	1,401,219.84	0.50
8	000333	美的集团	1,341,403.00	0.48
9	601398	工商银行	1,169,708.00	0.42
10	600030	中信证券	1,167,658.00	0.42
11	002594	比亚迪	1,156,630.00	0.41
12	601166	兴业银行	1,156,238.00	0.41
13	002475	立讯精密	1,025,515.00	0.37
14	688981	中芯国际	904,290.82	0.32
15	600919	江苏银行	901,300.00	0.32
16	000651	格力电器	820,879.00	0.29
17	601288	农业银行	804,233.00	0.29
18	000858	五粮液	780,192.00	0.28
19	600887	伊利股份	730,305.00	0.26
20	300502	新易盛	723,247.60	0.26

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	84,171,021.73
卖出股票收入（成交）总额	86,406,600.31

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	13,153,976.98	4.97
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	13,153,976.98	4.97

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019749	24 国债 15	100,000	10,127,057.53	3.83
2	019758	24 国债 21	30,000	3,026,919.45	1.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,843.40
2	应收清算款	11,788,664.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	580.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,886,088.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧瑾源灵活配置混合 A	205	4,766.21	0.00	0.00%	977,073.55	100.00%
中欧瑾源灵活配置混合 C	208	886,555.50	182,808,776.87	99.14%	1,594,766.53	0.86%

合计	413	448,863.48	182,808,776.87	98.61%	2,571,840.08	1.39%
----	-----	------------	----------------	--------	--------------	-------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧瑾源灵活配置混合 A	613.93	0.06%
	中欧瑾源灵活配置混合 C	3,237.09	0.00%
	合计	3,851.02	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧瑾源灵活配置混合 A	中欧瑾源灵活配置混合 C
基金合同生效日 （2015 年 3 月 31 日）基金份额总额	1,621,903,815.13	3,129,119,491.83
本报告期期初基金份额总额	20,718,068.46	176,563,809.13
本报告期基金总申购份额	140,776.56	57,747,292.93
减：本报告期基金总赎回份额	19,881,771.47	49,907,558.66
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	977,073.55	184,403,543.40

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 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。

10.2.2 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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-06-10
采取稽查或处罚等措施的机构	上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管局现场检查结束后，公司即成立整改小组，制定整改措施包括制度修订、人员培训宣导和强化内部检查等。针对涉及的问题，公司已按要求及时完成整改，并将整改报告报至上海监管局。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	1	52,329,346.72	31.43	22,809.87	31.43	—
华泰证券	1	42,056,952.31	25.26	18,334.96	25.27	—
申万宏源证券	1	38,419,427.84	23.08	16,746.51	23.08	—
招商证券	1	22,907,272.52	13.76	9,985.25	13.76	—
国都证券	2	6,589,732.66	3.96	2,872.76	3.96	—
华西证券	1	4,166,082.18	2.50	1,816.02	2.50	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
国泰海通	1	—	—	—	—	—

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。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	56,132.52	1.83	—	—	—	—
华泰证券	3,012,546.99	98.17	22,800,000.00	11.01	—	—
申万宏源证券	—	—	36,500,000.00	17.62	—	—
招商证	—	—	99,800,000.00	48.19	—	—

券			0			
国都证 券	-	-	48,000,000.0 0	23.18	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-

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。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-17
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-17
3	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18
4	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-19
5	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
7	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
8	中欧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 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基	中国证监会指定媒介	2025-04-22

	金 2025 年第一季度报告的提示性公告		
10	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
11	中欧瑾源灵活配置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	2025-06-03
12	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-03
13	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“海光信息”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-06
14	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 27 日至 2025 年 06 月 26 日	19,822,787.59	29,099,374.37	33,345,820.87	15,576,341.09	8.40%
	2	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	84,112,155.39	0.00	0.00	84,112,155.39	45.37%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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 8 月 30 日