

# 中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
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
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
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	54

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 .....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	100
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 .....	101
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 .....	101
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 .....	101
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 .....	101
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	101
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	101
8.12 投资组合报告附注 .....	101
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>102</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	102
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 .....	103
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 .....	103
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>103</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>104</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	104
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 .....	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	104
11.4 基金投资策略的改变 .....	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	104
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	105
11.8 其他重大事件 .....	109
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>110</b>
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 .....	110
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	111
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>111</b>
13.1 备查文件目录 .....	111
13.2 存放地点 .....	111
13.3 查阅方式 .....	111

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化驱动混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化驱动混合	
基金主代码	001980	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 16 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	339,108,860.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	001980	020875
报告期末下属分级基金的份额总额	307,279,866.87 份	31,828,993.44 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格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	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并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。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+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）*15%
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。本基金还可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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	北京市西城区复兴门内大街 55

	家嘴环路 479 号 8 层	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	竇玉明	廖林

## 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	2025 年		2024 年	2024 年 4 月 1 日-2024 年 12 月 31 日	2023 年	
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
本期已实现收益	119,437,853.69	7,478,470.42	-88,149,805.02	548,848.87	-413,043,649.18	-
本期利润	114,798,197.13	6,592,519.83	-15,701,739.27	457,463.21	-356,033,670.21	-
加权平均基金份额本期利润	0.3063	0.2536	-0.0177	0.2097	-0.1209	-
本期加权平均净值利润率	23.60%	19.28%	-1.77%	18.25%	-10.29%	-
本期基金份额净值增长率	26.25%	25.20%	8.68%	14.65%	-10.76%	-
3.1.2 期末	2025 年末		2024 年末		2023 年末	

数据和指标						
期末可供分配利润	141,315,633.23	14,041,526.00	48,476,888.47	2,236,748.48	117,258,900.06	-
期末可供分配基金份额利润	0.4599	0.4412	0.1564	0.1511	0.0640	-
期末基金资产净值	448,595,500.10	45,870,519.44	358,426,760.65	17,036,002.46	1,950,757,103.84	-
期末基金份额净值	1.4599	1.4412	1.1564	1.1511	1.0640	-
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	81.87%	43.55%	44.06%	14.65%	32.55%	-

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。

4、本基金自 2024 年 4 月 1 日起增加 C 类份额，增加份额当期的财务数据相关数据指标按实际存续期计算，下同。

### 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

中欧量化驱动混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.36%	1.06%	0.28%	0.85%	0.08%	0.21%
过去六个月	17.91%	0.96%	15.87%	0.80%	2.04%	0.16%
过去一年	26.25%	1.09%	21.02%	0.96%	5.23%	0.13%
过去三年	22.44%	1.13%	22.00%	1.03%	0.44%	0.10%
过去五年	27.68%	1.18%	3.92%	1.29%	23.76%	-0.11%
自基金合同生效	81.87%	1.22%	82.40%	1.38%	-0.53%	-0.16%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*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。

中欧量化驱动混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	1.06%	0.28%	0.85%	-0.08%	0.21%
过去六个月	17.55%	0.96%	15.87%	0.80%	1.68%	0.16%
过去一年	25.20%	1.09%	21.02%	0.96%	4.18%	0.13%
自基金份额起始运作日至今	43.55%	1.25%	34.08%	1.15%	9.47%	0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*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

中欧量化驱动混合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



注：2019年4月26日，组合业绩比较基准变更为创业板指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。2022年8月11日，业绩比较基准变更为中证全指指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*15%+

中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%。

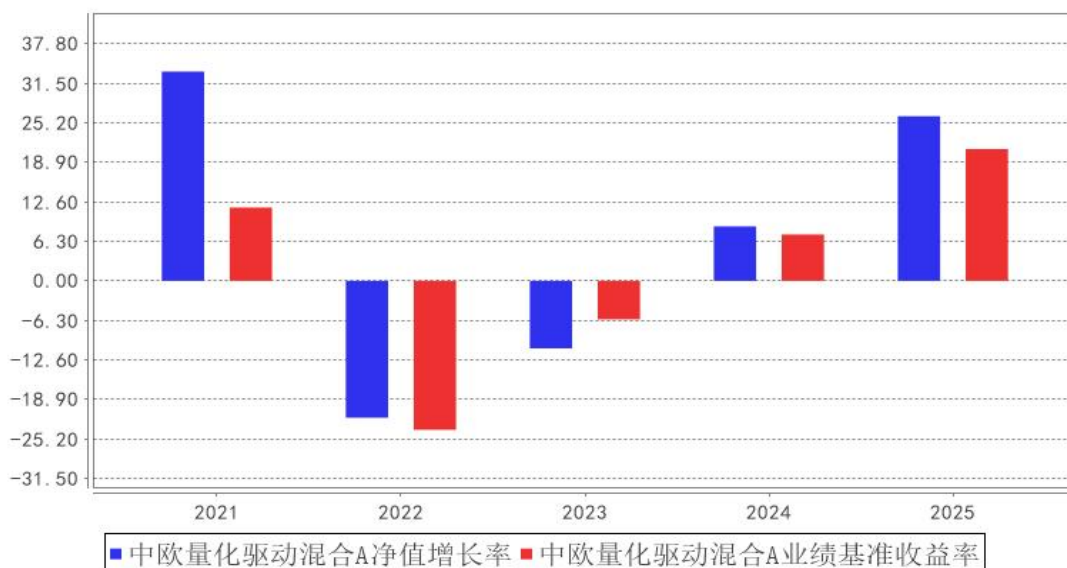
中欧量化驱动混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



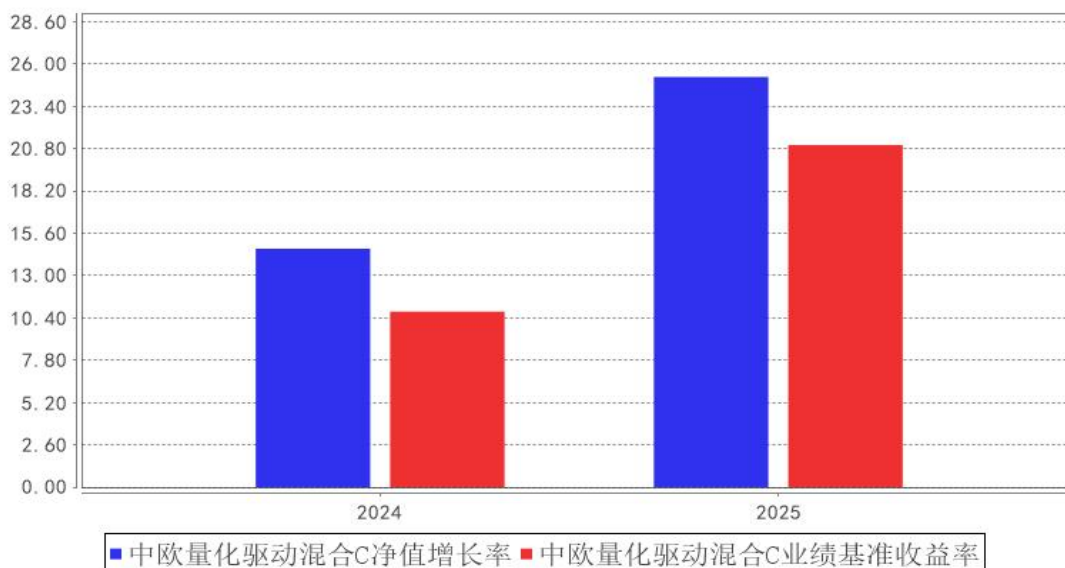
注：本基金于 2024 年 4 月 1 日新增 C 类份额，图示日期为 2024 年 4 月 16 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧量化驱动混合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



中欧量化驱动混合C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：2024 年 4 月 1 日本基金新增 C 份额，2024 年度数据为 2024 年 4 月 16 日至 2024 年 12 月 31 日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 227 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 / 基金经	2024-04-23	-	4 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。

	理助理				
曲径	量化投决会主席 / 权益专户投决会委员 / 量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2018-05-16	-	18 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，历任权益投决会委员。

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，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

#### 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	3,658,259,096.31	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,897,837,115.02	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	5,556,096,211.33	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 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 79 次，其中 77 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，2 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

2025 年对于 A 股市场而言，是挑战与机遇并存的一年。在全球经济复苏和国内政策调整的双重影响下，A 股市场经历波动但整体呈现稳健增长的态势。年初，受到全球疫情反复和地缘政治紧张的影响，市场情绪一度低迷，但随着国内经济逐步恢复，以及政策面的积极调整，市场逐渐回暖。特别是在科技创新、新能源、消费升级等领域，表现尤为突出。从因子表现来看，上半年，受全球降息预期反复与国内产业政策落地的双重影响，成长风格中的动量因子一度占据主导，人工智能应用端等新兴产业带动了小盘成长股的阶段性估值修复。然而三季度以来，顺周期复苏的预期逐步抬升，大类风格波动剧烈，在 10 月和 12 月初分别有两次极致的风格轮动，整体来看，盈利、波动率、流动性回撤较大。10 月初，市场风格切换到小市值低波为主的分散化行情，主要因子超额迎来了一轮反弹，而 12 月初以来，市场又延续了 7-9 月的集中行情，风险偏好波动剧烈。

在报告期内，我们保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中大盘成长风格。基金采用多维数据进行建模，包括基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成投资组合，以追求达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对业绩比较基准指数的超额收益。

### 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 26.25%，同期业绩比较基准收益率为 21.02%；基金 C 类份额净值增长率为 25.20%，同期业绩比较基准收益率为 21.02%。

## 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 2026 年，作为“十五五”开局之年，A 股市场有望从估值扩张转向盈利修复驱动。全 A 非金融盈利增速回升，科技 AI 主线深化，但风格趋于均衡，成长与价值并重，结构性机会增多。我们预计市场高弹性和结构化并存，盈利改善、资本市场改革红利及全球资金配置再平衡支撑上涨，增量资金来自险资、公募、ETF 及外资回流。宏观政策积极有为，货币适度宽松、财政倾斜民生消费，助力增长动能增强，PPI 回暖、“反内卷”政策推进供需格局改善，下半年或成关键窗口，若 AI 爆款应用未现、美元走强，成长风格或调整，价值与周期接力。2026 年 A 股市场将面临诸多机遇与挑战，我们将密切关注宏观经济走势、政策导向以及行业发展趋势，力争把握结构性投资机会的同时，也控制好组合的风险暴露，防范市场波动带来的风险。

展望 2026 年，在经济温和复苏与政策托底并存的背景下，市场机会与风险并存，风格轮动可能加快。我们借助基本面因子和量价因子的负相关性，持续挖掘数据特征规律，争取平衡高波动环境下的风险，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

2025 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

2025 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

2025 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

2025 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

2025 年，公司紧密对标新版《反洗钱法》及配套的《金融机构客户尽职调查管理办法》《受益所有人识别管理办法》等监管新规要求，紧跟“基于风险”的监管导向，全面升级反洗钱管理体系。

公司进一步优化洗钱、恐怖融资和扩散融资风险管控治理架构，从制度流程修订、风险评估深化、培训宣传强化等多维度补短板、提质效，牵头各业务部门压实反洗钱履职责任，提升全员合规履职能力。紧扣监管对系统智能化、数据精准化的要求，公司结合业务发展实际优化核心功能模块，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，满足监管新规落地与风险防控需求。

#### 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验。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

本报告期内，本基金托管人在对中欧量化驱动混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧量化驱动混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化驱动混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年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、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70028871_B33 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	中欧量化驱动混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧量化驱动混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中欧量化驱动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，公允反映了中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧量化驱动混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	中欧量化驱动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。



审计报告日期	2026 年 03 月 27 日
--------	------------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	24,155,778.59	46,725,237.24
结算备付金		10,629,520.54	7,364,046.62
存出保证金		183,784.39	339,661.23
交易性金融资产	7.4.7.2	464,878,789.24	328,052,694.72
其中：股票投资		456,830,548.14	328,052,694.72
基金投资		-	-
债券投资		8,048,241.10	-
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		4,000,503.69	-
应收股利		-	-
应收申购款		103,448.45	32,092.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		503,951,824.90	382,513,732.49
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		6,641,093.65	-
应付清算款		25,234.94	2,516,001.71

应付赎回款		359,506.70	2,340,560.98
应付管理人报酬		587,252.10	435,237.97
应付托管费		97,875.37	72,539.66
应付销售服务费		24,841.85	9,585.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	756.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,750,000.75	1,676,286.96
负债合计		9,485,805.36	7,050,969.38
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	339,108,860.31	324,749,126.16
未分配利润	7.4.7.8	155,357,159.23	50,713,636.95
净资产合计		494,466,019.54	375,462,763.11
负债和净资产总计		503,951,824.90	382,513,732.49

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 339,108,860.31 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.4599 元，基金份额总额 307,279,866.87 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.4412 元，基金份额总额 31,828,993.44 份。本基金自 2024 年 4 月 1 日起增加 C 类份额，增加份额当期的财务数据相关数据指标按实际存续期计算，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		129,084,492.16	-2,392,783.25
1. 利息收入		337,045.32	657,308.81
其中：存款利息收入	7.4.7.9	293,668.99	547,454.21
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		43,376.33	109,854.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		134,048,183.52	-76,371,107.69
其中：股票投资收益	7.4.7.10	122,974,028.37	-99,629,480.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	26,818.63	572,514.00

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	3,227,234.92	6,700,695.43
股利收益	7.4.7.14	7,820,101.60	15,985,163.51
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	-5,525,607.15	72,356,680.09
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	224,870.47	964,335.54
<b>减：二、营业总支出</b>		7,693,775.20	12,851,492.81
1. 管理人报酬		6,229,058.91	10,813,012.17
2. 托管费		1,038,176.50	1,802,168.62
3. 销售服务费		201,965.80	10,392.61
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		17,035.47	4,431.88
其中：卖出回购金融资产支出		17,035.47	4,431.88
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		12,194.43	24,241.04
8. 其他费用	7.4.7.18	195,344.09	197,246.49
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		121,390,716.96	-15,244,276.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		121,390,716.96	-15,244,276.06
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		121,390,716.96	-15,244,276.06

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	324,749,126.16	-	50,713,636.95	375,462,763.11

资产				
二、本期期初净资产	324,749,126.16	-	50,713,636.95	375,462,763.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	14,359,734.15	-	104,643,522.28	119,003,256.43
(一)、综合收益总额	-	-	121,390,716.96	121,390,716.96
(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)	14,359,734.15	-	-16,747,194.68	-2,387,460.53
其中：1. 基金申购款	302,951,228.79	-	75,142,724.82	378,093,953.61
2. 基金赎回款	-288,591,494.64	-	-91,889,919.50	-380,481,414.14
(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	339,108,860.31	-	155,357,159.23	494,466,019.54
项目	上年度可比期间			
	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	1,833,498,203.78	-	117,258,900.06	1,950,757,103.84
二、本期期初净资产	1,833,498,203.78	-	117,258,900.06	1,950,757,103.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,508,749,077.62	-	-66,545,263.11	-1,575,294,340.73
(一)、综合收益总额	-	-	-15,244,276.06	-15,244,276.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以	-1,508,749,077.62	-	-51,300,987.05	-1,560,050,064.67

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	114,799,744.77	-	-579,970.05	114,219,774.72
2. 基金赎回款	-1,623,548,822.39	-	-50,721,017.00	-1,674,269,839.39
(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	324,749,126.16	-	50,713,636.95	375,462,763.11

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：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中欧量化驱动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]2366 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金注册的批复》及[2017]1519 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册的批复》（准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册为中欧量化驱动混合型证券投资基金）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《中欧量化驱动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 244,603,768.62 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第 61336106\_B08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 244,633,211.97 份基金份额，其中包含认购利息折合 29,443.35 份基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2024 年 4 月 1 日起，本基金增设 C 类份额。

## 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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) 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；

(2) 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；

(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

### 3. 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	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	24,155,778.59	46,725,237.24
等于：本金	24,151,941.29	46,720,260.14
加：应计利息	3,837.30	4,977.10
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	24,155,778.59	46,725,237.24

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	451,645,648.20	-	456,830,548.14	5,184,899.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,002,800.00	46,641.10	8,048,241.10	-1,200.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	8,002,800.00	46,641.10	8,048,241.10	-1,200.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		459,648,448.20	46,641.10	464,878,789.24	5,183,699.94
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		317,343,387.63	-	328,052,694.72	10,709,307.09
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		317,343,387.63	-	328,052,694.72	10,709,307.09

#### 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

无。

##### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	305.10	89.12
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,699,695.65	1,626,188.68
其中：交易所市场	1,699,695.65	1,626,188.68
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
应付转出费	-	9.16
合计	1,750,000.75	1,676,286.96

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧量化驱动混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,949,872.18	309,949,872.18
本期申购	223,991,436.76	223,991,436.76
本期赎回（以“-”号填列）	-226,661,442.07	-226,661,442.07
本期末	307,279,866.87	307,279,866.87

##### 中欧量化驱动混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,799,253.98	14,799,253.98
本期申购	78,959,792.03	78,959,792.03
本期赎回（以“-”号填列）	-61,930,052.57	-61,930,052.57
本期末	31,828,993.44	31,828,993.44

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

##### 中欧量化驱动混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	179,191,821.92	-130,714,933.45	48,476,888.47
本期期初	179,191,821.92	-130,714,933.45	48,476,888.47
本期利润	119,437,853.69	-4,639,656.56	114,798,197.13
本期基金份额交易产生的变动数	-23,604,102.41	1,644,650.04	-21,959,452.37
其中：基金申购款	147,741,099.31	-95,220,522.64	52,520,576.67
基金赎回款	-171,345,201.72	96,865,172.68	-74,480,029.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	275,025,573.20	-133,709,939.97	141,315,633.23

##### 中欧量化驱动混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,480,616.76	-6,243,868.28	2,236,748.48
本期期初	8,480,616.76	-6,243,868.28	2,236,748.48
本期利润	7,478,470.42	-885,950.59	6,592,519.83
本期基金份额交易产生的变动数	11,967,896.75	-6,755,639.06	5,212,257.69

生的变动数			
其中：基金申购款	55,908,275.26	-33,286,127.11	22,622,148.15
基金赎回款	-43,940,378.51	26,530,488.05	-17,409,890.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,926,983.93	-13,885,457.93	14,041,526.00

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	208,568.41	294,772.14
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	81,884.10	242,154.97
其他	3,216.48	10,527.10
合计	293,668.99	547,454.21

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	7,464,201,793.91	9,347,946,526.62
减：卖出股票成本总额	7,328,444,829.96	9,432,601,831.17
减：交易费用	12,782,935.58	14,974,176.08
买卖股票差价收入	122,974,028.37	-99,629,480.63

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	26,818.63	593,040.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-20,526.00
债券投资收益——赎回	-	-

回差价收入		
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	26,818.63	572,514.00

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	97,886,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	95,620,526.00
减：应计利息总额	-	2,286,800.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-20,526.00

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	3,227,234.92	6,700,695.43

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,820,101.60	15,985,163.51
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	7,820,101.60	15,985,163.51

#### 7.4.7.15 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 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,525,607.15	72,356,680.09
股票投资	-5,524,407.15	72,410,474.09
债券投资	-1,200.00	-53,794.00
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	-5,525,607.15	72,356,680.09

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	210,855.71	691,666.50
基金转换费收入	14,014.76	272,669.04
合计	224,870.47	964,335.54

#### 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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,403.00	1,638.48
账户维护费	18,000.00	18,000.00
开户费	-	400.00

证券组合费	5,800.25	7,084.89
存托服务费	140.84	123.12
合计	195,344.09	197,246.49

#### 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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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：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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国都证券	128,339,178.13	0.86	1,046,326,933.03	6.08

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	55,942.18	0.85	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
国都证券	555,375.45	6.47	-	-

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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,229,058.91	10,813,012.17
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,346,342.93	2,275,390.47
应支付基金管理人的净管理费	4,882,715.98	8,537,621.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一

致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,038,176.50	1,802,168.62

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	合计
中欧基金	0.00	127,181.55	127,181.55
合计	0.00	127,181.55	127,181.55
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	合计
中欧基金	0.00	648.61	648.61
合计	0.00	648.61	648.61

注：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 0.60%。

计算方法如下：

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

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径一次性划付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 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

中欧量化驱动混合 C

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	149,402.39	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	149,402.39
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	149,402.39	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	149,402.39
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00	1.01%

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自有资金投资本基金 A 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

##### 中欧量化驱动混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 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	32,667.91	0.01%	167,568.77	0.05%

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	24,155,778.59	208,568.41	46,725,237.24	294,772.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券	证	成功	受	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	券名称	认购日	限期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股流通受限	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	6个月	新股流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云	2025	6个月	新股	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-

	汉 芯 城	年 9 月 23 日		流 通 受 限						
301575	艾 芬 达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建 发 致 新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山 大 电 力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广 东 建 科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南 网 数 字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联 合 动 力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	12.48	25.46	3,771	47,062.08	96,009.66	-
301667	纳 百 川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊 创 瑞 通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新 广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道 生 天 合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德	2025	6 个月	新 股	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-

	力佳	年 10 月 30 日		流通受限						
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	2,116	17,880.20	51,376.48	-
688759	必	2025	6 个月	新股	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-

	贝特	年 10 月 21 日		流通受限						
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	29.06	52.62	2,361	68,610.66	124,235.82	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股流通受限	8.62	18.36	8,847	76,261.14	162,430.92	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	83.06	117.19	406	33,722.36	47,579.14	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	114.28	416.18	506	57,825.68	210,587.08	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	104.66	399.31	339	35,479.74	135,366.09	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	187	15,911.83	38,018.97	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 2025 年 12 月 31 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 6,641,093.65 元, 于 2026 年 1 月 5 日和 6 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。

#### 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。本基金在严格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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金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上市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上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2025 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同约定到期日

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 2025 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	24,155,778.59	-	-	-	24,155,778.59
结算备付金	10,629,520.54	-	-	-	10,629,520.54
存出保证金	183,784.39	-	-	-	183,784.39
交易性金融资产	8,048,241.10	-	-	-456,830,548.14	464,878,789.24
应收申购款	-	-	-	103,448.45	103,448.45
应收清算款	-	-	-	4,000,503.69	4,000,503.69
资产总计	43,017,324.62	-	-	-460,934,500.28	503,951,824.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	359,506.70	359,506.70
应付管理人报酬	-	-	-	587,252.10	587,252.10
应付托管费	-	-	-	97,875.37	97,875.37
应付清算款	-	-	-	25,234.94	25,234.94
卖出回购金融资产款	6,641,093.65	-	-	-	6,641,093.65

应付销售服务费	-	-	-	24,841.85	24,841.85
其他负债	-	-	-	1,750,000.75	1,750,000.75
负债总计	6,641,093.65	-	-	2,844,711.71	9,485,805.36
利率敏感度缺口	36,376,230.97	-	-	-458,089,788.57	494,466,019.54
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	46,725,237.24	-	-	-	46,725,237.24
结算备付金	7,364,046.62	-	-	-	7,364,046.62
存出保证金	339,661.23	-	-	-	339,661.23
交易性金融资产	-	-	-	-328,052,694.72	328,052,694.72
应收申购款	-	-	-	32,092.68	32,092.68
资产总计	54,428,945.09	-	-	-328,084,787.40	382,513,732.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,340,560.98	2,340,560.98
应付管理人报酬	-	-	-	435,237.97	435,237.97
应付托管费	-	-	-	72,539.66	72,539.66
应付清算款	-	-	-	2,516,001.71	2,516,001.71
应付销售服务费	-	-	-	9,585.50	9,585.50
应交税费	-	-	-	756.60	756.60
其他负债	-	-	-	1,676,286.96	1,676,286.96
负债总计	-	-	-	7,050,969.38	7,050,969.38
利率敏感度缺口	54,428,945.09	-	-	-321,033,818.02	375,462,763.11

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 2025 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 1.63%（2024 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（2024 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			合计
	美元 折合人民	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	59,372,581.42	-	59,372,581.42
资产合计	-	59,372,581.42	-	59,372,581.42
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	59,372,581.42	-	59,372,581.42
	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72
资产合计	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 5%	-2,968,629.07	-3,382,264.24
港币相对人民币升值 5%	2,968,629.07	3,382,264.24	

	值 5%		
--	------	--	--

### 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 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	456,830,548.14	92.39	328,052,694.72	87.37
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	456,830,548.14	92.39	328,052,694.72	87.37

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	28,453,965.94	19,506,790.97
	业绩比较基准下降5%	-28,453,965.94	-19,506,790.97

## 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	455,448,064.39	327,397,058.38
第二层次	8,048,241.10	27,736.50
第三层次	1,382,483.75	627,899.84
合计	464,878,789.24	328,052,694.72

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	627,899.84	627,899.84
当期购买	0.00	617,487.48	617,487.48
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	627,899.84	627,899.84
当期利得或损失总额	0.00	764,996.27	764,996.27
其中：计入损益的利得或损失	0.00	764,996.27	764,996.27
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	1,382,483.75	1,382,483.75
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	764,996.27	764,996.27
项目	上年度可比期间 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	1,251,445.46	1,251,445.46
当期购买	0.00	253,713.33	253,713.33
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	1,251,445.46	1,251,445.46
当期利得或损失总额	0.00	374,186.51	374,186.51
其中：计入损益的利得或损失	0.00	374,186.51	374,186.51
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	627,899.84	627,899.84
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	374,186.51	374,186.51

#### 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	1,382,483.75	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1800-3.0791	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	627,899.84	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.2665-5.7444	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 2026 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	456,830,548.14	90.65
	其中：股票	456,830,548.14	90.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,048,241.10	1.60
	其中：债券	8,048,241.10	1.60
	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	34,785,299.13	6.90
8	其他各项资产	4,287,736.53	0.85

9	合计	503,951,824.90	100.00
---	----	----------------	--------

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 59,372,581.42 元，占基金资产净值比例 12.01%。

## 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	3,629,357.00	0.73
B	采矿业	20,161,659.19	4.08
C	制造业	252,324,717.32	51.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,940,546.96	3.22
E	建筑业	5,554,346.00	1.12
F	批发和零售业	15,593,176.44	3.15
G	交通运输、仓储和邮政业	11,906,667.60	2.41
H	住宿和餐饮业	1,635,771.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,744,840.40	3.59
J	金融业	30,879,699.00	6.25
K	房地产业	2,930,070.00	0.59
L	租赁和商务服务业	4,697,070.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	4,824,890.26	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	6,807,373.55	1.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	128,920.00	0.03
Q	卫生和社会工作	368,500.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,602,868.00	0.32
S	综合	727,494.00	0.15
	合计	397,457,966.72	80.38

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	2,097,254.26	0.42
消费者非必需品	13,772,798.94	2.79
消费者常用品	4,368,788.43	0.88
能源	1,138,870.10	0.23
金融	1,736,304.97	0.35
医疗保健	13,901,684.82	2.81
工业	2,253,262.94	0.46
信息技术	1,000,293.57	0.20
电信服务	15,581,628.86	3.15

公用事业	641,719.75	0.13
地产业	2,879,974.78	0.58
合计	59,372,581.42	12.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	28,800	15,581,628.86	3.15
2	300502	新易盛	14,200	6,118,496.00	1.24
3	300750	宁德时代	16,500	6,059,790.00	1.23
4	601318	中国平安	67,200	4,596,480.00	0.93
4	02318	中国平安	19,000	1,118,050.88	0.23
5	300308	中际旭创	8,100	4,941,000.00	1.00
6	601899	紫金矿业	137,325	4,733,592.75	0.96
7	01530	三生制药	201,000	4,389,811.78	0.89
8	03690	美团-W	45,900	4,282,590.53	0.87
9	600742	富维股份	401,110	4,011,100.00	0.81
10	02097	蜜雪集团	10,800	3,997,507.20	0.81
11	600030	中信证券	111,700	3,206,907.00	0.65
12	601108	财通证券	344,600	3,004,912.00	0.61
13	601107	四川成渝	427,300	2,597,984.00	0.53
14	601138	工业富联	40,000	2,482,000.00	0.50
15	601901	方正证券	310,300	2,420,340.00	0.49
16	002475	立讯精密	42,100	2,387,491.00	0.48
17	600497	驰宏锌锗	323,000	2,361,130.00	0.48
18	002258	利尔化学	177,700	2,318,985.00	0.47
19	601117	中国化学	281,700	2,121,201.00	0.43
20	01801	信达生物	30,500	2,100,551.01	0.42
21	09926	康方生物	20,000	2,041,277.20	0.41
22	002602	世纪华通	118,000	2,013,080.00	0.41
23	600999	招商证券	120,600	2,006,784.00	0.41
24	09858	优然牧业	437,000	2,005,112.27	0.41
25	002091	江苏国泰	214,700	1,938,741.00	0.39
26	600098	广州发展	293,800	1,921,452.00	0.39
27	688207	格灵深瞳	126,237	1,918,802.40	0.39
28	000531	穗恒运 A	296,200	1,898,642.00	0.38
29	600549	厦门钨业	45,200	1,855,912.00	0.38
30	300014	亿纬锂能	28,100	1,847,856.00	0.37
31	000060	中金岭南	315,500	1,845,675.00	0.37
32	601166	兴业银行	87,400	1,840,644.00	0.37
33	002558	巨人网络	42,300	1,831,167.00	0.37
34	600814	杭州解百	220,800	1,788,480.00	0.36

35	002367	康力电梯	220,200	1,774,812.00	0.36
36	600288	大恒科技	116,300	1,742,174.00	0.35
37	002463	沪电股份	23,800	1,739,066.00	0.35
38	00386	中国石油化工股份	270,000	1,138,870.10	0.23
38	600028	中国石化	79,000	488,220.00	0.10
39	601601	中国太保	38,700	1,621,917.00	0.33
40	000828	东莞控股	148,200	1,594,632.00	0.32
41	002736	国信证券	121,100	1,588,832.00	0.32
42	301603	乔锋智能	20,900	1,582,130.00	0.32
43	688512	慧智微	139,820	1,560,391.20	0.32
44	000923	河钢资源	72,600	1,536,942.00	0.31
45	601168	西部矿业	55,290	1,528,215.60	0.31
46	600210	紫江企业	200,900	1,476,615.00	0.30
47	600195	中牧股份	186,600	1,468,542.00	0.30
48	002517	恺英网络	67,100	1,467,477.00	0.30
49	600739	辽宁成大	126,500	1,414,270.00	0.29
50	603328	依顿电子	127,400	1,396,304.00	0.28
51	002624	完美世界	84,700	1,388,233.00	0.28
52	300409	道氏技术	61,100	1,374,139.00	0.28
53	603993	洛阳钼业	68,600	1,372,000.00	0.28
54	600166	福田汽车	462,200	1,349,624.00	0.27
55	603699	纽威股份	25,900	1,346,023.00	0.27
56	688079	美迪凯	117,173	1,326,398.36	0.27
57	000683	博源化工	177,640	1,321,641.60	0.27
58	000899	赣能股份	132,000	1,306,800.00	0.26
59	002384	东山精密	15,100	1,278,215.00	0.26
60	300018	中元股份	113,100	1,244,100.00	0.25
61	002436	兴森科技	58,400	1,236,328.00	0.25
62	600388	龙净环保	75,400	1,229,774.00	0.25
63	01364	古茗	54,800	1,226,522.18	0.25
64	00981	中芯国际	15,500	1,000,293.57	0.20
64	688981	中芯国际	1,749	214,829.67	0.04
65	002004	华邦健康	254,000	1,214,120.00	0.25
66	603766	隆鑫通用	74,900	1,206,639.00	0.24
67	600061	国投资本	157,600	1,205,640.00	0.24
68	002454	松芝股份	138,200	1,203,722.00	0.24
69	688327	云从科技	83,693	1,202,668.41	0.24
70	09987	百胜中国	3,600	1,198,536.81	0.24
71	600300	维维股份	339,100	1,190,241.00	0.24
72	02162	康诺亚-B	24,500	1,182,789.17	0.24
73	600795	国电电力	234,124	1,179,984.96	0.24
74	600983	惠而浦	122,500	1,171,100.00	0.24
75	600011	华能国际	155,400	1,159,284.00	0.23

76	603505	金石资源	61,600	1,150,688.00	0.23
77	603969	银龙股份	113,600	1,148,496.00	0.23
78	00101	恒隆地产	147,000	1,143,178.46	0.23
79	09699	顺丰同城	113,800	1,130,650.80	0.23
80	300435	中泰股份	50,700	1,126,554.00	0.23
81	03808	中国重汽	45,000	1,122,612.14	0.23
82	002057	中钢天源	109,900	1,119,881.00	0.23
83	300363	博腾股份	48,000	1,115,520.00	0.23
84	603500	祥和实业	92,700	1,110,546.00	0.22
85	601918	新集能源	167,600	1,107,836.00	0.22
86	01972	太古地产	57,800	1,095,284.31	0.22
87	01833	平安好医生	85,700	1,089,875.83	0.22
88	300134	大富科技	86,800	1,085,000.00	0.22
89	09988	阿里巴巴-W	8,400	1,083,430.45	0.22
90	300003	乐普医疗	68,500	1,082,985.00	0.22
91	000600	建投能源	126,700	1,080,751.00	0.22
92	603027	千禾味业	109,660	1,077,957.80	0.22
93	603889	新澳股份	135,100	1,074,045.00	0.22
94	000738	航发控制	50,400	1,074,024.00	0.22
95	02192	医脉通	118,500	1,038,206.23	0.21
96	000426	兴业银锡	29,100	1,035,960.00	0.21
97	600546	山煤国际	100,700	1,016,063.00	0.21
98	600115	中国东航	169,300	1,015,800.00	0.21
99	002281	光迅科技	14,100	986,295.00	0.20
100	600378	昊华科技	30,500	974,780.00	0.20
101	002372	伟星新材	92,800	967,904.00	0.20
102	601066	中信建投	35,800	958,366.00	0.19
103	000651	格力电器	23,600	949,192.00	0.19
104	600887	伊利股份	32,700	935,220.00	0.19
105	002545	东方铁塔	50,500	931,725.00	0.19
106	300041	回天新材	83,100	920,748.00	0.19
107	601968	宝钢包装	171,400	915,276.00	0.19
108	688772	珠海冠宇	42,366	912,139.98	0.18
109	600415	小商品城	57,100	910,745.00	0.18
110	000415	渤海租赁	222,000	899,100.00	0.18
111	300257	开山股份	63,500	892,175.00	0.18
112	688678	福立旺	36,351	878,967.18	0.18
113	002561	徐家汇	98,900	868,342.00	0.18
114	600499	科达制造	62,500	866,875.00	0.18
115	688550	瑞联新材	18,668	845,847.08	0.17
116	300032	金龙机电	155,100	832,887.00	0.17
117	002419	天虹股份	150,300	831,159.00	0.17
118	603979	金诚信	10,900	830,035.00	0.17

119	300079	数码视讯	152,500	821,975.00	0.17
120	600027	华电国际	165,600	821,376.00	0.17
121	603588	高能环境	103,920	802,262.40	0.16
122	601555	东吴证券	88,200	799,092.00	0.16
123	600057	厦门象屿	93,500	796,620.00	0.16
124	688280	精进电动	91,536	796,363.20	0.16
125	000725	京东方 A	188,700	794,427.00	0.16
126	600961	株冶集团	49,200	792,120.00	0.16
127	600496	精工钢构	190,500	790,575.00	0.16
128	000902	新洋丰	49,900	779,438.00	0.16
129	002668	TCL 智家	75,000	778,500.00	0.16
130	603697	有友食品	63,400	776,650.00	0.16
131	002434	万里扬	81,400	775,742.00	0.16
132	600372	中航机载	57,800	775,676.00	0.16
133	605196	华通线缆	22,100	767,754.00	0.16
134	02099	中国黄金国际	5,400	765,262.18	0.15
135	00175	吉利汽车	47,000	759,878.99	0.15
136	301230	泓博医药	25,400	758,698.00	0.15
137	600970	中材国际	72,500	753,275.00	0.15
138	300850	新强联	18,200	752,934.00	0.15
139	601688	华泰证券	31,800	750,162.00	0.15
140	300476	胜宏科技	2,600	747,708.00	0.15
141	600262	北方股份	28,600	744,458.00	0.15
142	002895	川恒股份	20,300	744,198.00	0.15
143	605056	XD 咸亨国	45,100	744,150.00	0.15
144	600183	生益科技	10,400	742,664.00	0.15
145	00358	江西铜业股份	19,000	735,871.40	0.15
146	002414	高德红外	50,100	734,967.00	0.15
147	600778	友好集团	109,600	731,032.00	0.15
148	002787	华源控股	58,600	729,570.00	0.15
149	002039	黔源电力	40,000	726,800.00	0.15
150	601717	中创智领	29,400	721,770.00	0.15
151	688182	灿勤科技	24,445	721,616.40	0.15
152	002916	深南电路	3,100	720,099.00	0.15
153	688321	微芯生物	24,426	713,727.72	0.14
154	002345	潮宏基	57,000	712,500.00	0.14
155	300206	理邦仪器	55,700	712,403.00	0.14
156	603797	联泰环保	152,460	711,988.20	0.14
157	300929	华骐环保	65,900	708,425.00	0.14
158	688257	新锐股份	20,460	701,368.80	0.14
159	300274	阳光电源	4,100	701,264.00	0.14
160	002014	永新股份	58,600	698,512.00	0.14
161	603218	日月股份	52,700	698,275.00	0.14

162	002803	吉宏股份	42,600	696,936.00	0.14
163	603172	万丰股份	38,500	685,300.00	0.14
164	600859	王府井	44,000	683,320.00	0.14
165	002234	民和股份	78,800	679,256.00	0.14
166	000529	广弘控股	112,600	676,726.00	0.14
167	688222	成都先导	28,740	673,953.00	0.14
168	02315	百奥赛图-B	20,500	653,615.15	0.13
168	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
169	002392	北京利尔	89,600	670,208.00	0.14
170	600428	中远海特	93,856	666,377.60	0.13
171	002533	金杯电工	53,100	662,688.00	0.13
172	600352	浙江龙盛	61,500	655,590.00	0.13
173	002984	森麒麟	30,900	654,153.00	0.13
174	02228	晶泰控股	76,000	649,379.05	0.13
175	002645	华宏科技	44,300	648,552.00	0.13
176	002206	海利得	110,200	644,670.00	0.13
177	002811	郑中设计	43,400	644,056.00	0.13
178	300302	同有科技	35,500	643,970.00	0.13
179	00916	龙源电力	107,000	641,719.75	0.13
180	00016	新鸿基地产	7,500	641,512.01	0.13
181	06979	珍酒李渡	81,600	639,739.89	0.13
182	600522	中天科技	35,200	637,824.00	0.13
183	002590	万安科技	42,500	637,500.00	0.13
184	601007	金陵饭店	81,200	634,172.00	0.13
185	09985	卫龙美味	62,400	634,060.44	0.13
186	600219	南山铝业	116,900	628,922.00	0.13
187	01093	石药集团	82,000	624,359.86	0.13
188	600613	神奇制药	102,300	620,961.00	0.13
189	600114	东睦股份	20,300	620,165.00	0.13
190	09606	映恩生物-B	2,300	619,482.47	0.13
191	02628	中国人寿	25,000	618,254.09	0.13
192	600230	沧州大化	40,500	618,030.00	0.12
193	301081	严牌股份	60,800	615,904.00	0.12
194	06181	老铺黄金	1,100	614,008.96	0.12
195	09992	泡泡玛特	3,600	610,323.82	0.12
196	603915	国茂股份	33,000	607,530.00	0.12
197	300747	锐科激光	22,400	605,472.00	0.12
198	688127	蓝特光学	15,675	603,330.75	0.12
199	06990	科伦博泰生物-B	1,700	602,212.90	0.12
200	600382	广东明珠	84,200	600,346.00	0.12
201	603136	天目湖	50,800	598,424.00	0.12
202	300644	南京聚隆	16,200	597,942.00	0.12
203	03939	万国黄金集团	86,500	596,120.68	0.12

204	001322	箭牌家居	65,400	580,098.00	0.12
205	603986	兆易创新	2,700	578,475.00	0.12
206	300171	东富龙	36,800	577,760.00	0.12
207	601061	中信金属	40,100	577,440.00	0.12
208	300408	三环集团	12,600	576,450.00	0.12
209	603187	海容冷链	36,300	569,547.00	0.12
210	000428	华天酒店	170,800	563,640.00	0.11
211	603132	金徽股份	38,200	560,394.00	0.11
212	600561	江西长运	85,600	554,688.00	0.11
213	000601	韶能股份	118,000	554,600.00	0.11
214	688779	五矿新能	73,564	550,994.36	0.11
215	000582	北部湾港	58,700	550,606.00	0.11
216	002080	中材科技	15,100	548,734.00	0.11
217	600628	新世界	69,600	547,056.00	0.11
218	301607	富特科技	13,600	545,496.00	0.11
219	603379	三美股份	8,900	540,408.00	0.11
220	600478	科力远	78,300	539,487.00	0.11
221	002627	三峡旅游	72,600	538,692.00	0.11
222	000911	广农糖业	73,600	538,016.00	0.11
223	000978	桂林旅游	74,000	535,760.00	0.11
224	002299	圣农发展	32,200	532,588.00	0.11
225	600690	海尔智家	20,400	532,236.00	0.11
226	002922	伊戈尔	17,200	526,664.00	0.11
227	000702	正虹科技	78,700	525,716.00	0.11
228	605305	中际联合	12,600	524,916.00	0.11
229	601336	新华保险	7,500	522,750.00	0.11
230	002246	北化股份	28,800	518,976.00	0.10
231	300249	依米康	35,200	514,976.00	0.10
232	002157	正邦科技	158,800	514,512.00	0.10
233	600309	万华化学	6,700	513,756.00	0.10
234	601728	中国电信	81,500	513,450.00	0.10
235	000100	TCL 科技	112,500	510,750.00	0.10
236	688373	盟科药业	84,180	508,447.20	0.10
237	688700	东威科技	14,400	508,032.00	0.10
238	000338	潍柴动力	29,400	505,680.00	0.10
239	300283	温州宏丰	67,100	505,263.00	0.10
240	600279	重庆港	92,100	502,866.00	0.10
241	600125	铁龙物流	77,900	501,676.00	0.10
242	002412	汉森制药	77,700	498,057.00	0.10
243	300098	高新兴	81,500	497,150.00	0.10
244	601919	中远海控	32,500	493,350.00	0.10
245	300498	温氏股份	29,000	489,520.00	0.10
246	002758	浙农股份	48,400	487,388.00	0.10

247	601857	中国石油	46,600	485,106.00	0.10
248	300531	优博讯	26,800	483,472.00	0.10
249	002222	福晶科技	8,500	478,890.00	0.10
250	300073	当升科技	8,200	473,960.00	0.10
251	000612	焦作万方	43,000	473,860.00	0.10
252	002707	众信旅游	65,800	473,102.00	0.10
253	301110	青木科技	7,100	469,878.00	0.10
254	300221	银禧科技	45,400	468,528.00	0.09
255	605060	联德股份	12,600	465,696.00	0.09
256	002442	龙星科技	74,600	463,266.00	0.09
257	600469	风神股份	66,200	459,428.00	0.09
258	600758	辽宁能源	126,100	459,004.00	0.09
259	300119	瑞普生物	24,300	456,111.00	0.09
260	600487	亨通光电	18,300	452,559.00	0.09
261	002858	力盛体育	30,100	451,500.00	0.09
262	000893	亚钾国际	9,300	446,121.00	0.09
263	603701	德宏股份	21,900	441,504.00	0.09
264	002493	荣盛石化	37,600	440,296.00	0.09
265	600686	金龙汽车	24,200	429,308.00	0.09
266	600888	新疆众和	52,200	427,518.00	0.09
267	300394	天孚通信	2,100	426,363.00	0.09
268	688410	山外山	28,433	425,642.01	0.09
269	600127	金健米业	63,300	425,376.00	0.09
270	300144	宋城演艺	51,800	424,242.00	0.09
271	300034	钢研高纳	21,500	420,970.00	0.09
272	688220	翱捷科技	5,094	420,815.34	0.09
273	600926	杭州银行	27,500	420,200.00	0.08
274	600490	鹏欣资源	54,100	418,193.00	0.08
275	688025	杰普特	2,932	415,083.24	0.08
276	002508	老板电器	21,400	414,090.00	0.08
277	300207	欣旺达	15,800	413,170.00	0.08
278	600067	冠城新材	99,500	412,925.00	0.08
279	600241	时代万恒	49,400	412,490.00	0.08
280	603568	伟明环保	16,200	411,156.00	0.08
281	002357	富临运业	37,900	406,288.00	0.08
282	601988	中国银行	70,800	405,684.00	0.08
283	603808	歌力思	47,600	405,552.00	0.08
284	600673	东阳光	18,000	403,740.00	0.08
285	002448	中原内配	31,000	400,830.00	0.08
286	002594	比亚迪	4,100	400,652.00	0.08
287	300263	隆华科技	45,300	400,452.00	0.08
288	688428	诺诚健华	19,484	399,811.68	0.08
289	000792	盐湖股份	14,100	397,056.00	0.08

290	601038	一拖股份	28,000	396,760.00	0.08
291	600893	航发动力	9,900	396,297.00	0.08
292	600938	中国海油	13,000	392,340.00	0.08
293	300129	泰胜风能	37,500	392,250.00	0.08
294	002572	索菲亚	28,600	389,246.00	0.08
295	601939	建设银行	41,800	387,904.00	0.08
296	600419	天润乳业	39,000	386,100.00	0.08
297	001260	坤泰股份	19,100	384,292.00	0.08
298	603926	铁流股份	22,500	384,075.00	0.08
299	601009	南京银行	33,500	382,905.00	0.08
300	603799	华友钴业	5,600	382,256.00	0.08
301	300447	全信股份	21,000	379,680.00	0.08
302	600594	益佰制药	94,700	376,906.00	0.08
303	003030	祖名股份	18,600	375,534.00	0.08
304	300059	东方财富	16,200	375,516.00	0.08
305	600704	物产中大	67,200	374,304.00	0.08
306	000977	浪潮信息	5,600	372,960.00	0.08
307	600725	云维股份	88,900	371,602.00	0.08
308	300616	尚品宅配	26,600	370,538.00	0.07
309	600830	香溢融通	38,700	370,359.00	0.07
310	688639	华恒生物	11,236	366,068.88	0.07
311	300416	苏试试验	20,400	363,936.00	0.07
312	002233	塔牌集团	40,200	362,202.00	0.07
313	002023	海特高新	26,700	361,518.00	0.07
314	002626	金达威	18,100	356,751.00	0.07
315	600359	新农开发	49,700	355,355.00	0.07
316	002117	东港股份	25,700	354,917.00	0.07
317	300915	海融科技	14,900	353,875.00	0.07
318	600801	华新建材	14,400	353,376.00	0.07
319	600389	江山股份	13,900	351,392.00	0.07
320	001259	利仁科技	11,700	351,117.00	0.07
321	600391	航发科技	9,400	348,740.00	0.07
322	600578	京能电力	68,300	348,330.00	0.07
323	601616	广电电气	89,400	345,084.00	0.07
324	688565	力源科技	30,695	343,477.05	0.07
325	603289	泰瑞机器	33,700	341,044.00	0.07
326	002182	宝武镁业	22,100	338,130.00	0.07
327	600399	抚顺特钢	57,600	336,384.00	0.07
328	603288	海天味业	9,000	333,180.00	0.07
329	300549	优德精密	17,600	331,936.00	0.07
330	002625	光启技术	6,800	331,568.00	0.07
331	002204	大连重工	42,700	326,655.00	0.07
332	002133	广宇集团	95,700	324,423.00	0.07

333	002760	凤形股份	14,900	323,479.00	0.07
334	600039	四川路桥	32,300	321,385.00	0.06
335	000543	皖能电力	40,400	321,180.00	0.06
336	002159	三特索道	20,900	320,397.00	0.06
337	300438	鹏辉能源	6,000	319,320.00	0.06
338	301107	瑜欣电子	11,300	319,112.00	0.06
339	600540	新赛股份	69,300	316,701.00	0.06
340	600558	大西洋	51,400	313,540.00	0.06
341	002051	中工国际	34,500	312,915.00	0.06
342	601058	赛轮轮胎	19,300	312,274.00	0.06
343	600958	东方证券	28,600	311,740.00	0.06
344	002225	濮耐股份	54,400	310,080.00	0.06
345	605180	华生科技	21,300	309,915.00	0.06
346	300149	睿智医药	32,400	309,744.00	0.06
347	600150	中国船舶	9,300	309,318.00	0.06
348	002452	长高电新	37,500	308,625.00	0.06
349	688352	颀中科技	24,436	308,137.96	0.06
350	301049	超越科技	14,300	307,164.00	0.06
351	603188	亚邦股份	66,900	307,071.00	0.06
352	002591	恒大高新	37,800	306,936.00	0.06
353	002701	奥瑞金	51,200	304,640.00	0.06
354	001228	永泰运	11,600	304,384.00	0.06
355	002161	远望谷	41,600	304,096.00	0.06
356	002793	罗欣药业	63,300	303,840.00	0.06
357	301059	金三江	24,100	303,660.00	0.06
358	000421	南京公用	43,900	303,349.00	0.06
359	300487	蓝晓科技	4,900	302,575.00	0.06
360	000605	渤海股份	44,900	301,279.00	0.06
361	603037	凯众股份	20,800	300,768.00	0.06
362	002967	广电计量	13,600	299,336.00	0.06
363	002837	英维克	2,800	299,292.00	0.06
364	300912	凯龙高科	18,100	298,650.00	0.06
365	603937	丽岛新材	24,700	296,153.00	0.06
366	688488	艾迪药业	18,117	295,850.61	0.06
367	000011	深物业A	32,500	292,825.00	0.06
368	603596	伯特利	5,700	292,239.00	0.06
369	002487	大金重工	5,600	290,808.00	0.06
370	002830	名雕股份	14,900	290,550.00	0.06
371	000833	粤桂股份	14,900	289,954.00	0.06
372	002016	世荣兆业	49,900	288,422.00	0.06
373	605366	宏柏新材	44,800	277,760.00	0.06
374	600584	长电科技	7,500	275,850.00	0.06
375	000755	山西高速	54,700	274,594.00	0.06

376	603329	上海雅仕	24,930	274,230.00	0.06
377	002828	贝肯能源	25,600	272,896.00	0.06
378	600160	巨化股份	7,100	272,782.00	0.06
379	002931	锋龙股份	8,600	272,620.00	0.06
380	300365	恒华科技	43,100	272,392.00	0.06
381	002193	如意集团	51,000	271,320.00	0.05
382	600585	海螺水泥	12,400	271,064.00	0.05
383	002333	罗普斯金	48,200	270,884.00	0.05
384	688472	阿特斯	18,076	269,513.16	0.05
385	300132	青松股份	30,900	269,139.00	0.05
386	603022	新通联	26,200	269,074.00	0.05
387	600031	三一重工	12,700	268,351.00	0.05
388	000538	云南白药	4,700	266,772.00	0.05
389	605268	王力安防	25,000	266,750.00	0.05
390	688277	天智航	17,498	265,794.62	0.05
391	601226	华电科工	33,900	265,776.00	0.05
392	002912	中新赛克	8,800	265,232.00	0.05
393	000959	首钢股份	54,100	265,090.00	0.05
394	600063	皖维高新	45,000	265,050.00	0.05
395	000630	铜陵有色	43,800	263,238.00	0.05
396	000603	盛达资源	8,500	263,160.00	0.05
397	603456	九洲药业	14,700	263,130.00	0.05
398	301163	宏德股份	9,800	262,542.00	0.05
399	000733	振华科技	5,000	262,050.00	0.05
400	002638	勤上股份	84,600	261,414.00	0.05
401	002631	德尔未来	43,700	261,326.00	0.05
402	300838	浙江力诺	17,100	260,775.00	0.05
403	600927	永安期货	16,200	260,334.00	0.05
404	301100	风光股份	12,200	259,982.00	0.05
405	301193	家联科技	12,000	258,840.00	0.05
406	002993	奥海科技	5,900	257,889.00	0.05
407	300594	朗进科技	13,100	256,891.00	0.05
408	002799	环球印务	30,100	256,753.00	0.05
409	600962	国投中鲁	11,700	256,581.00	0.05
410	600900	长江电力	9,400	255,586.00	0.05
411	688661	和林微纳	4,928	255,073.28	0.05
412	600761	安徽合力	12,200	254,858.00	0.05
413	300694	蠡湖股份	21,000	253,680.00	0.05
414	002522	浙江众成	44,800	252,672.00	0.05
415	001376	百通能源	14,900	250,916.00	0.05
416	300385	雪浪环境	40,100	249,422.00	0.05
417	605300	佳禾食品	21,500	249,400.00	0.05
418	002160	常铝股份	47,500	247,000.00	0.05

419	300042	朗科科技	9,600	246,720.00	0.05
420	300602	飞荣达	7,400	245,384.00	0.05
421	002198	嘉应制药	34,700	243,941.00	0.05
422	300489	光智科技	4,800	243,840.00	0.05
423	603660	苏州科达	22,100	243,763.00	0.05
424	603163	圣晖集成	3,550	243,530.00	0.05
425	300604	长川科技	2,400	243,144.00	0.05
426	002748	世龙实业	18,800	242,708.00	0.05
427	688283	坤恒顺维	6,010	242,203.00	0.05
428	600138	中青旅	24,400	241,072.00	0.05
429	601916	浙商银行	78,800	239,552.00	0.05
430	688059	华锐精密	3,036	238,933.20	0.05
431	300285	国瓷材料	8,700	238,467.00	0.05
432	600676	交运股份	40,500	238,140.00	0.05
433	002309	中利集团	70,200	237,978.00	0.05
434	603317	天味食品	19,000	237,880.00	0.05
435	601933	永辉超市	50,700	237,783.00	0.05
436	002156	通富微电	6,300	237,510.00	0.05
437	603818	曲美家居	65,100	235,011.00	0.05
438	600787	中储股份	41,700	234,354.00	0.05
439	002353	杰瑞股份	3,300	233,739.00	0.05
440	688311	盟升电子	5,125	233,700.00	0.05
441	002474	榕基软件	23,700	233,682.00	0.05
442	002483	润邦股份	32,700	233,478.00	0.05
443	002775	文科股份	54,500	233,260.00	0.05
444	002340	格林美	27,900	233,244.00	0.05
445	002111	威海广泰	22,100	232,492.00	0.05
446	600152	维科技术	31,700	231,410.00	0.05
447	002486	嘉麟杰	74,300	231,073.00	0.05
448	002355	兴民智通	38,100	230,886.00	0.05
449	300395	菲利华	2,300	230,690.00	0.05
450	603385	惠达卫浴	33,600	229,824.00	0.05
451	000798	中水渔业	21,500	227,470.00	0.05
452	688701	卓锦股份	27,873	227,164.95	0.05
453	301106	骏成科技	7,600	226,252.00	0.05
454	002836	新宏泽	15,100	226,198.00	0.05
455	600029	南方航空	28,200	225,882.00	0.05
456	601702	华峰铝业	11,000	225,170.00	0.05
457	688556	高测股份	19,700	224,974.00	0.05
458	000657	中钨高新	8,100	224,451.00	0.05
459	000157	中联重科	26,000	224,380.00	0.05
460	300428	立中集团	9,600	224,160.00	0.05
461	600724	宁波富达	38,900	224,064.00	0.05

462	600176	中国巨石	13,100	224,010.00	0.05
463	000566	海南海药	31,300	223,795.00	0.05
464	600579	中化装备	26,900	223,270.00	0.05
465	601998	中信银行	28,800	221,760.00	0.04
466	688387	信科移动	17,106	220,667.40	0.04
467	300151	昌红科技	14,600	220,168.00	0.04
468	002188	中天服务	36,200	220,096.00	0.04
469	002300	太阳电缆	23,900	219,880.00	0.04
470	301130	西点药业	7,700	219,758.00	0.04
471	688663	新风光	5,668	219,748.36	0.04
472	300973	立高食品	5,100	219,300.00	0.04
473	300532	今天国际	18,500	217,930.00	0.04
474	603566	普莱柯	17,500	217,525.00	0.04
475	605018	长华集团	18,700	216,546.00	0.04
476	601198	东兴证券	15,600	216,528.00	0.04
477	600989	宝丰能源	11,000	215,930.00	0.04
478	000017	深中华 A	27,400	215,638.00	0.04
479	300303	聚飞光电	31,400	214,776.00	0.04
480	300693	盛弘股份	5,600	214,368.00	0.04
481	600791	京能置业	45,800	214,344.00	0.04
482	603810	丰山集团	13,400	213,998.00	0.04
483	000528	柳工	18,000	213,660.00	0.04
484	300030	阳普医疗	29,000	213,440.00	0.04
485	000852	石化机械	29,300	213,011.00	0.04
486	600009	上海机场	6,500	212,940.00	0.04
487	300081	恒信东方	41,000	212,790.00	0.04
488	002491	通鼎互联	35,400	212,400.00	0.04
489	600459	贵研铂业	11,400	212,154.00	0.04
490	300223	北京君正	2,000	212,080.00	0.04
491	000975	山金国际	8,700	211,671.00	0.04
492	301321	翰博高新	11,100	211,455.00	0.04
493	002125	湘潭电化	14,900	210,984.00	0.04
494	688135	利扬芯片	7,600	210,976.00	0.04
495	001210	金房能源	12,300	210,699.00	0.04
496	688795	摩尔线程	506	210,587.08	0.04
497	002284	亚太股份	14,100	210,513.00	0.04
498	603177	德创环保	18,900	210,357.00	0.04
499	002960	青鸟消防	19,900	209,149.00	0.04
500	300126	锐奇股份	24,400	208,864.00	0.04
501	600909	华安证券	30,800	208,824.00	0.04
502	002970	锐明技术	4,300	208,550.00	0.04
503	002975	博杰股份	2,700	207,900.00	0.04
504	688255	凯尔达	5,662	207,399.06	0.04

505	301198	喜悦智行	16,500	207,240.00	0.04
506	001216	华瓷股份	12,100	207,031.00	0.04
507	002582	好想你	18,700	206,635.00	0.04
508	000912	泸天化	49,700	206,255.00	0.04
509	300700	岱勒新材	16,700	206,245.00	0.04
510	603611	诺力股份	8,400	205,380.00	0.04
511	000786	北新建材	8,200	204,754.00	0.04
512	600312	平高电气	11,800	204,730.00	0.04
513	600850	电科数字	6,900	204,516.00	0.04
514	600697	欧亚集团	15,500	204,445.00	0.04
515	301285	鸿日达	3,000	203,340.00	0.04
516	002724	海洋王	29,900	202,722.00	0.04
517	002100	天康生物	27,500	202,675.00	0.04
518	301365	矩阵股份	8,500	202,640.00	0.04
519	002842	翔鹭钨业	14,000	202,440.00	0.04
520	000680	山推股份	16,900	202,293.00	0.04
521	600212	绿能慧充	25,100	202,055.00	0.04
522	002404	嘉欣丝绸	28,800	201,888.00	0.04
523	300550	和仁科技	13,900	201,689.00	0.04
524	688120	华海清科	1,341	201,257.28	0.04
525	605138	盛泰集团	28,900	201,144.00	0.04
526	601002	晋亿实业	39,000	200,460.00	0.04
527	605338	巴比食品	6,400	200,448.00	0.04
528	000967	盈峰环境	27,300	200,382.00	0.04
529	601838	成都银行	12,400	199,888.00	0.04
530	301286	侨源股份	4,700	198,763.00	0.04
531	000811	冰轮环境	10,700	198,164.00	0.04
532	002667	威领股份	15,100	197,659.00	0.04
533	600841	动力新科	32,400	197,316.00	0.04
534	002331	皖通科技	22,100	197,132.00	0.04
535	600869	远东股份	24,400	196,420.00	0.04
536	603506	南都物业	15,000	195,900.00	0.04
537	002849	威星智能	12,300	195,570.00	0.04
538	300790	宇瞳光学	6,500	194,415.00	0.04
539	603121	华培动力	9,100	192,556.00	0.04
540	002324	普利特	12,000	191,880.00	0.04
541	002389	航天彩虹	8,000	191,840.00	0.04
542	002966	苏州银行	23,100	191,499.00	0.04
543	688296	和达科技	14,421	191,078.25	0.04
544	002632	道明光学	15,300	190,485.00	0.04
545	301073	君亭酒店	7,300	190,238.00	0.04
546	002905	金逸影视	16,800	189,840.00	0.04
547	600748	上实发展	35,000	189,700.00	0.04

548	301113	雅艺科技	7,930	189,685.60	0.04
549	002725	跃岭股份	11,200	189,280.00	0.04
550	603335	迪生力	33,500	188,605.00	0.04
551	002373	千方科技	16,000	188,320.00	0.04
552	600860	京城股份	15,000	188,100.00	0.04
553	601083	锦江航运	16,800	187,488.00	0.04
554	601208	东材科技	6,900	186,921.00	0.04
555	002963	豪尔赛	12,500	186,000.00	0.04
556	002595	豪迈科技	2,200	185,922.00	0.04
557	000635	英力特	20,900	185,801.00	0.04
558	603739	蔚蓝生物	13,100	185,365.00	0.04
559	000768	中航西飞	7,300	185,274.00	0.04
560	002753	永东股份	25,900	184,667.00	0.04
561	601778	晶科科技	49,600	184,512.00	0.04
562	000823	超声电子	13,600	184,416.00	0.04
563	002273	水晶光电	7,300	183,376.00	0.04
564	600784	鲁银投资	26,100	182,178.00	0.04
565	002337	赛象科技	27,700	181,989.00	0.04
566	000632	三木集团	32,200	181,930.00	0.04
567	601999	出版传媒	26,400	181,368.00	0.04
568	000933	神火股份	6,600	181,302.00	0.04
569	002755	奥赛康	11,100	181,263.00	0.04
570	601111	中国国航	19,300	180,841.00	0.04
571	301336	趣睡科技	3,500	180,775.00	0.04
572	601369	陕鼓动力	18,000	180,180.00	0.04
573	600596	新安股份	15,700	180,079.00	0.04
574	002534	西子洁能	10,700	179,439.00	0.04
575	603977	国泰集团	12,900	179,310.00	0.04
576	002516	旷达科技	27,200	179,248.00	0.04
577	603356	华菱精工	12,600	178,794.00	0.04
578	002601	龙佰集团	9,100	178,178.00	0.04
579	000520	凤凰航运	36,700	177,628.00	0.04
580	600829	人民同泰	16,400	177,284.00	0.04
581	300620	光库科技	1,200	176,460.00	0.04
582	600249	两面针	30,600	175,950.00	0.04
583	688148	芳源股份	20,044	175,785.88	0.04
584	301026	浩通科技	6,200	175,708.00	0.04
585	003031	中瓷电子	2,400	175,584.00	0.04
586	002354	天娱数科	27,500	175,175.00	0.04
587	000955	欣龙控股	28,100	174,782.00	0.04
588	002596	海南瑞泽	32,400	174,636.00	0.04
589	603536	惠发食品	15,700	174,584.00	0.04
590	600156	华升股份	21,100	174,286.00	0.04

591	300334	津膜科技	25,000	174,000.00	0.04
592	603499	翔港科技	8,500	173,740.00	0.04
593	603321	梅轮电梯	21,600	173,664.00	0.04
594	002942	新农股份	9,000	172,980.00	0.03
595	002677	浙江美大	20,700	172,845.00	0.03
596	688496	清越科技	29,082	172,747.08	0.03
597	600463	空港股份	15,200	172,064.00	0.03
598	000501	武商集团	17,000	172,040.00	0.03
599	002790	瑞尔特	20,500	171,995.00	0.03
600	600863	内蒙华电	38,300	171,584.00	0.03
601	603396	金辰股份	5,100	171,105.00	0.03
602	300959	线上线下	1,800	170,460.00	0.03
603	002128	电投能源	6,100	170,251.00	0.03
604	605337	李子园	14,300	170,027.00	0.03
605	300806	斯迪克	5,500	169,070.00	0.03
606	600598	北大荒	11,300	168,935.00	0.03
607	002521	齐峰新材	20,300	168,896.00	0.03
608	002465	海格通信	10,700	168,525.00	0.03
609	000039	中集集团	16,700	168,503.00	0.03
610	301372	科净源	6,600	167,376.00	0.03
611	000938	紫光股份	6,800	167,280.00	0.03
612	603129	春风动力	600	167,208.00	0.03
613	002075	沙钢股份	29,000	166,750.00	0.03
614	605162	新中港	19,500	166,530.00	0.03
615	301587	中瑞股份	7,100	166,140.00	0.03
616	000002	万科A	35,700	166,005.00	0.03
617	688131	皓元医药	2,300	165,784.00	0.03
618	002142	宁波银行	5,900	165,731.00	0.03
619	688048	长光华芯	1,322	165,712.70	0.03
620	601377	兴业证券	22,300	165,466.00	0.03
621	603063	禾望电气	5,000	165,350.00	0.03
622	000952	广济药业	23,500	165,205.00	0.03
623	002671	龙泉股份	31,400	164,536.00	0.03
624	603616	韩建河山	31,700	164,523.00	0.03
625	603306	华懋科技	2,600	163,826.00	0.03
626	600392	盛和资源	7,600	163,628.00	0.03
627	300966	共同药业	8,300	163,427.00	0.03
628	300782	卓胜微	2,000	162,960.00	0.03
629	688783	西安奕材	8,847	162,430.92	0.03
630	300244	迪安诊断	10,200	161,670.00	0.03
631	603182	嘉华股份	10,200	161,364.00	0.03
632	600706	曲江文旅	15,200	161,120.00	0.03
633	300400	劲拓股份	8,100	160,380.00	0.03

634	300118	东方日升	10,900	159,794.00	0.03
635	002612	朗姿股份	7,800	159,432.00	0.03
636	300670	大烨智能	22,400	159,264.00	0.03
637	300239	东宝生物	27,100	158,806.00	0.03
638	000993	闽东电力	13,200	158,136.00	0.03
639	300619	金银河	3,600	158,040.00	0.03
640	002648	卫星化学	8,900	157,352.00	0.03
641	000928	中钢国际	23,800	157,318.00	0.03
642	603026	石大胜华	2,100	157,101.00	0.03
643	600235	民丰特纸	23,100	157,080.00	0.03
644	301219	腾远钴业	2,300	157,044.00	0.03
645	601825	沪农商行	16,900	157,001.00	0.03
646	002244	滨江集团	15,600	156,780.00	0.03
647	002174	游族网络	12,800	156,672.00	0.03
648	603048	浙江黎明	7,400	156,436.00	0.03
649	300805	电声股份	14,800	156,140.00	0.03
650	003003	天元股份	11,800	155,996.00	0.03
651	603378	亚士创能	22,900	155,949.00	0.03
652	000878	云南铜业	7,600	155,876.00	0.03
653	603095	越剑智能	8,700	155,208.00	0.03
654	688396	华润微	2,936	155,196.96	0.03
655	001359	平安电工	2,184	155,064.00	0.03
656	300106	西部牧业	14,400	154,800.00	0.03
657	002554	惠博普	48,500	154,715.00	0.03
658	000301	东方盛虹	14,200	154,638.00	0.03
659	300346	南大光电	3,600	154,440.00	0.03
660	002370	亚太药业	21,100	154,241.00	0.03
661	600250	南京商旅	13,400	154,234.00	0.03
662	600802	福建水泥	23,500	154,160.00	0.03
663	600287	苏豪时尚	28,200	153,972.00	0.03
664	002745	木林森	16,000	153,120.00	0.03
665	300837	浙矿股份	4,500	153,090.00	0.03
666	600470	六国化工	25,600	153,088.00	0.03
667	000692	惠天热电	44,400	152,736.00	0.03
668	300375	鹏翎股份	29,000	152,540.00	0.03
669	688718	唯赛勃	11,631	152,133.48	0.03
670	000726	鲁泰 A	21,200	150,944.00	0.03
671	000886	海南高速	22,000	150,920.00	0.03
672	002968	新大正	12,400	150,784.00	0.03
673	300036	超图软件	8,300	150,728.00	0.03
674	601162	天风证券	36,200	150,592.00	0.03
675	300054	鼎龙股份	4,000	150,400.00	0.03
676	688126	沪硅产业	6,949	150,376.36	0.03

677	603659	璞泰来	5,500	150,370.00	0.03
678	301338	凯格精机	1,700	149,787.00	0.03
679	603399	永杉锂业	14,400	149,616.00	0.03
680	600078	澄星股份	15,600	149,604.00	0.03
681	600293	三峡新材	47,400	149,310.00	0.03
682	000626	远大控股	18,800	149,084.00	0.03
683	600191	华资实业	11,600	149,060.00	0.03
684	688800	瑞可达	1,792	148,736.00	0.03
685	600149	廊坊发展	29,800	148,702.00	0.03
686	300935	盈建科	4,900	148,666.00	0.03
687	002810	山东赫达	10,000	148,300.00	0.03
688	603150	万朗磁塑	3,900	148,122.00	0.03
689	600785	新华百货	10,900	147,695.00	0.03
690	601319	中国人保	16,500	147,675.00	0.03
691	300684	中石科技	3,000	147,660.00	0.03
692	688385	复旦微电	1,994	146,957.80	0.03
693	300511	雪榕生物	23,500	146,640.00	0.03
694	300925	法本信息	6,900	146,556.00	0.03
695	603168	莎普爱思	19,900	146,464.00	0.03
696	000020	深华发 A	10,500	145,635.00	0.03
697	301086	鸿富瀚	1,300	145,457.00	0.03
698	600141	兴发集团	4,200	145,236.00	0.03
699	601011	宝泰隆	42,700	145,180.00	0.03
700	601633	长城汽车	6,400	144,832.00	0.03
701	002185	华天科技	13,200	144,804.00	0.03
702	002772	众兴菌业	9,900	144,441.00	0.03
703	603170	宝立食品	10,100	144,228.00	0.03
704	001203	大中矿业	4,700	144,055.00	0.03
705	002556	辉隆股份	23,800	143,752.00	0.03
706	002995	天地在线	8,700	143,724.00	0.03
707	002078	太阳纸业	9,100	143,325.00	0.03
708	300898	熊猫乳品	5,300	142,729.00	0.03
709	601615	明阳智能	9,800	141,904.00	0.03
710	600588	用友网络	10,700	141,882.00	0.03
711	002398	垒知集团	25,200	141,624.00	0.03
712	300667	必创科技	8,000	141,440.00	0.03
713	300948	冠中生态	6,500	140,985.00	0.03
714	300086	康芝药业	11,700	140,751.00	0.03
715	600137	浪莎股份	7,300	140,379.00	0.03
716	002084	海鸥住工	36,100	140,068.00	0.03
717	688331	荣昌生物	1,800	140,022.00	0.03
718	600298	安琪酵母	3,200	139,968.00	0.03
719	001209	洪兴股份	6,700	139,762.00	0.03

720	600939	重庆建工	44,000	139,480.00	0.03
721	600754	锦江酒店	5,500	138,985.00	0.03
722	301418	协昌科技	3,800	138,700.00	0.03
723	301571	国科天成	2,400	138,432.00	0.03
724	600331	宏达股份	10,800	138,132.00	0.03
725	601577	长沙银行	14,200	137,740.00	0.03
726	000895	双汇发展	5,200	137,644.00	0.03
727	600397	江钨装备	18,100	137,560.00	0.03
728	002334	英威腾	15,200	137,104.00	0.03
729	601696	中银证券	9,100	136,409.00	0.03
730	600367	红星发展	7,800	136,266.00	0.03
731	002271	东方雨虹	10,000	135,900.00	0.03
732	603369	今世缘	3,900	135,642.00	0.03
733	605388	均瑶健康	18,200	135,408.00	0.03
734	688802	沐曦股份	339	135,366.09	0.03
735	600302	标准股份	12,900	135,321.00	0.03
736	301080	百普赛斯	2,500	135,000.00	0.03
737	600159	大龙地产	48,700	134,899.00	0.03
738	600847	万里股份	11,600	134,792.00	0.03
739	600319	亚星化学	14,500	134,560.00	0.03
740	600202	哈空调	22,900	134,423.00	0.03
741	300656	民德电子	6,100	134,322.00	0.03
742	688651	盛邦安全	3,049	134,216.98	0.03
743	603269	海鸥股份	10,200	133,518.00	0.03
744	688005	容百科技	3,766	133,316.40	0.03
745	002394	联发股份	8,400	133,224.00	0.03
746	600346	恒力石化	5,900	132,927.00	0.03
747	002444	巨星科技	3,900	132,678.00	0.03
748	600963	岳阳林纸	28,300	132,161.00	0.03
749	000670	盈方微	17,900	132,102.00	0.03
750	300072	海新能科	28,700	132,020.00	0.03
751	000777	中核科技	5,100	131,835.00	0.03
752	688049	炬芯科技	2,500	131,500.00	0.03
753	603606	东方电缆	2,200	131,450.00	0.03
754	002255	海陆重工	10,400	131,248.00	0.03
755	000619	海螺新材	21,100	131,031.00	0.03
756	603155	新亚强	7,600	130,188.00	0.03
757	003042	中农联合	8,100	130,086.00	0.03
758	300765	新诺威	3,600	129,852.00	0.03
759	603127	昭衍新药	3,700	129,537.00	0.03
760	603617	君禾股份	17,100	128,934.00	0.03
761	002659	凯文教育	22,000	128,920.00	0.03
762	002297	博云新材	10,700	128,079.00	0.03

763	600188	兖矿能源	9,700	127,555.00	0.03
764	000555	神州信息	7,700	127,435.00	0.03
765	301391	卡莱特	1,500	127,275.00	0.03
766	601156	东航物流	6,900	127,029.00	0.03
767	600278	东方创业	16,700	126,920.00	0.03
768	600692	亚通股份	18,100	126,881.00	0.03
769	603032	德新科技	6,600	126,456.00	0.03
770	301118	恒光股份	5,100	126,276.00	0.03
771	688525	佰维存储	1,100	126,269.00	0.03
772	002950	奥美医疗	11,500	125,580.00	0.03
773	600356	恒丰纸业	14,300	125,554.00	0.03
774	002114	罗平锌电	14,900	125,458.00	0.03
775	002574	明牌珠宝	22,300	125,326.00	0.03
776	000333	美的集团	1,600	125,040.00	0.03
777	002085	万丰奥威	7,800	124,878.00	0.03
778	002783	凯龙股份	13,000	124,410.00	0.03
779	688765	禾元生物	2,361	124,235.82	0.03
780	601898	中煤能源	9,900	123,156.00	0.02
781	002651	利君股份	10,500	122,745.00	0.02
782	603912	佳力图	14,300	122,551.00	0.02
783	002459	晶澳科技	10,700	122,515.00	0.02
784	600674	川投能源	8,800	122,320.00	0.02
785	002406	远东传动	15,400	122,276.00	0.02
786	600482	中国动力	5,900	122,130.00	0.02
787	601225	陕西煤业	5,700	121,524.00	0.02
788	600710	苏美达	11,200	121,072.00	0.02
789	000682	东方电子	10,200	120,972.00	0.02
790	000761	本钢板材	36,100	120,935.00	0.02
791	600966	博汇纸业	17,700	120,891.00	0.02
792	000655	金岭矿业	12,700	120,650.00	0.02
793	300232	洲明科技	17,000	120,530.00	0.02
794	300737	科顺股份	21,900	120,450.00	0.02
795	002838	道恩股份	5,000	120,400.00	0.02
796	002155	湖南黄金	5,700	120,213.00	0.02
797	002644	佛慈制药	13,900	120,096.00	0.02
798	300190	维尔利	27,900	119,691.00	0.02
799	002328	新朋股份	18,000	118,980.00	0.02
800	300849	锦盛新材	7,600	118,788.00	0.02
801	301419	阿莱德	3,500	118,580.00	0.02
802	002223	鱼跃医疗	3,100	118,451.00	0.02
803	000672	上峰水泥	9,100	118,209.00	0.02
804	002738	中矿资源	1,500	117,825.00	0.02
805	300316	晶盛机电	3,200	117,600.00	0.02

806	688107	安路科技	4,320	117,417.60	0.02
807	688588	凌志软件	8,187	117,155.97	0.02
808	601399	国机重装	24,500	117,110.00	0.02
809	300891	惠云钛业	13,300	117,040.00	0.02
810	002633	申科股份	7,100	116,795.00	0.02
811	688599	天合光能	7,052	116,710.60	0.02
812	300464	星徽股份	18,400	116,656.00	0.02
813	002470	金正大	65,500	116,590.00	0.02
814	002714	牧原股份	2,300	116,334.00	0.02
815	600251	冠农股份	12,600	116,298.00	0.02
816	002859	洁美科技	4,200	115,920.00	0.02
817	300919	中伟股份	2,500	115,825.00	0.02
818	605001	威奥股份	15,100	115,213.00	0.02
819	600233	圆通速递	7,000	114,940.00	0.02
820	603313	梦百合	12,900	114,810.00	0.02
821	601128	常熟银行	16,300	114,752.00	0.02
822	002208	合肥城建	9,200	113,896.00	0.02
823	300339	润和软件	2,300	113,850.00	0.02
824	600328	中盐化工	13,800	113,712.00	0.02
825	000728	国元证券	13,600	113,560.00	0.02
826	002566	益盛药业	14,800	112,924.00	0.02
827	002348	高乐股份	19,600	112,700.00	0.02
828	601599	浙文影业	28,300	112,634.00	0.02
829	002609	捷顺科技	12,100	112,409.00	0.02
830	300696	爱乐达	3,500	111,685.00	0.02
831	603365	水星家纺	5,300	111,512.00	0.02
832	300551	古鳌科技	6,700	111,488.00	0.02
833	002105	信隆健康	15,200	111,264.00	0.02
834	603680	今创集团	7,200	110,952.00	0.02
835	600335	国机汽车	17,000	110,670.00	0.02
836	603871	嘉友国际	7,900	110,205.00	0.02
837	688119	中钢洛耐	19,673	109,972.07	0.02
838	000920	沃顿科技	8,800	109,560.00	0.02
839	605006	山东玻纤	15,000	109,500.00	0.02
840	600844	金煤科技	37,900	109,152.00	0.02
841	002622	皓宸医疗	36,700	108,999.00	0.02
842	688021	奥福科技	5,933	108,870.55	0.02
843	003007	直真科技	2,900	108,141.00	0.02
844	002851	麦格米特	1,200	108,084.00	0.02
845	000553	安道麦 A	19,600	107,408.00	0.02
846	002165	红宝丽	14,200	107,352.00	0.02
847	000567	海德股份	16,700	107,214.00	0.02
848	301087	可孚医疗	2,400	107,208.00	0.02

849	301307	美利信	3,100	107,198.00	0.02
850	002319	乐通股份	8,900	107,156.00	0.02
851	300402	宝色股份	4,900	105,399.00	0.02
852	002055	ST 得润	15,600	105,144.00	0.02
853	688319	欧林生物	4,125	104,610.00	0.02
854	688062	迈威生物	2,709	104,215.23	0.02
855	688001	华兴源创	3,448	104,060.64	0.02
856	001280	中国铀业	2,288	103,954.84	0.02
857	000059	华锦股份	19,300	103,255.00	0.02
858	300141	和顺电气	8,200	103,074.00	0.02
859	688689	银河微电	3,624	102,849.12	0.02
860	300103	达刚控股	12,800	102,784.00	0.02
861	688234	天岳先进	1,155	102,656.40	0.02
862	000155	川能动力	8,800	102,520.00	0.02
863	688557	兰剑智能	2,814	102,514.02	0.02
864	002033	丽江股份	11,200	102,480.00	0.02
865	600671	天目药业	5,900	102,129.00	0.02
866	600803	新奥股份	4,900	101,724.00	0.02
867	002634	棒杰股份	18,000	101,700.00	0.02
868	600026	中远海能	8,700	101,616.00	0.02
869	300627	华测导航	2,900	101,239.00	0.02
870	605358	立昂微	2,900	100,978.00	0.02
871	300358	楚天科技	10,300	100,837.00	0.02
872	002374	中锐股份	27,800	100,080.00	0.02
873	688629	华丰科技	999	99,959.94	0.02
874	000887	中鼎股份	4,300	99,803.00	0.02
875	605016	百龙创园	4,600	99,360.00	0.02
876	605589	圣泉集团	3,500	99,050.00	0.02
877	301526	国际复材	14,100	98,700.00	0.02
878	002318	久立特材	3,400	98,430.00	0.02
879	000663	永安林业	13,300	98,154.00	0.02
880	603696	安记食品	4,800	97,344.00	0.02
881	002169	智光电气	8,400	97,188.00	0.02
882	001360	南矿集团	4,500	96,975.00	0.02
883	603681	永冠新材	5,100	96,798.00	0.02
884	301191	菲菱科思	900	96,768.00	0.02
885	003037	三和管桩	11,900	96,390.00	0.02
886	600737	中粮糖业	5,600	96,376.00	0.02
887	603836	海程邦达	7,000	96,320.00	0.02
888	301039	中集车辆	10,500	96,075.00	0.02
889	301656	联合动力	3,771	96,009.66	0.02
890	603887	城地香江	7,100	95,992.00	0.02
891	002532	天山铝业	5,900	95,462.00	0.02

892	000400	许继电气	3,700	95,127.00	0.02
893	600626	申达股份	19,600	94,668.00	0.02
894	000548	湖南投资	17,400	94,656.00	0.02
895	688322	奥比中光	1,055	94,601.85	0.02
896	600897	厦门空港	5,500	94,600.00	0.02
897	000019	深粮控股	13,600	94,520.00	0.02
898	000637	茂化实华	21,900	94,170.00	0.02
899	300082	奥克股份	9,500	94,050.00	0.02
900	603318	水发燃气	14,000	93,800.00	0.02
901	688350	富淼科技	3,645	93,785.85	0.02
902	300677	英科医疗	2,400	93,360.00	0.02
903	002873	新天药业	9,400	93,248.00	0.02
903	601126	四方股份	3,100	93,248.00	0.02
904	600547	山东黄金	2,400	92,904.00	0.02
905	300628	亿联网络	2,600	92,690.00	0.02
906	688597	煜邦电力	11,289	92,682.69	0.02
907	300570	太辰光	800	92,440.00	0.02
908	002302	西部建设	15,100	92,412.00	0.02
909	605277	新亚电子	4,200	92,400.00	0.02
910	002603	以岭药业	5,400	92,178.00	0.02
911	000623	吉林敖东	4,700	91,791.00	0.02
912	000009	中国宝安	9,300	91,605.00	0.02
913	601872	招商轮船	10,200	91,596.00	0.02
914	603185	弘元绿能	3,000	91,500.00	0.02
915	300567	精测电子	1,000	91,200.00	0.02
916	001696	宗申动力	4,200	91,098.00	0.02
917	688180	君实生物	2,661	90,899.76	0.02
918	002552	宝鼎科技	5,500	90,805.00	0.02
919	300626	华瑞股份	5,700	90,687.00	0.02
920	300780	德恩精工	4,700	90,616.00	0.02
921	002429	兆驰股份	12,200	90,524.00	0.02
922	600177	雅戈尔	11,900	90,440.00	0.02
923	002044	美年健康	17,100	90,288.00	0.02
924	002939	长城证券	8,800	89,760.00	0.02
925	300067	安诺其	17,800	89,000.00	0.02
926	002512	达华智能	14,200	88,466.00	0.02
927	301499	维科精密	3,000	88,290.00	0.02
928	603058	永吉股份	9,400	88,078.00	0.02
929	688285	高铁电气	10,146	88,067.28	0.02
930	300340	科恒股份	7,100	87,472.00	0.02
931	301088	戎美股份	5,100	87,465.00	0.02
932	000753	漳州发展	11,100	87,357.00	0.02
933	001202	炬申股份	5,500	87,230.00	0.02

934	002739	万达电影	7,700	87,164.00	0.02
935	002064	华峰化学	7,900	86,900.00	0.02
936	300699	光威复材	2,200	86,812.00	0.02
937	000607	华媒控股	20,900	86,735.00	0.02
938	688266	泽璟制药	931	86,303.70	0.02
939	300997	欢乐家	3,300	86,295.00	0.02
940	002843	泰嘉股份	4,300	86,172.00	0.02
941	688216	气派科技	3,864	86,089.92	0.02
942	002203	海亮股份	6,800	86,088.00	0.02
943	300545	联得装备	2,800	85,932.00	0.02
944	601216	君正集团	17,800	85,796.00	0.02
945	688669	聚石化学	3,689	85,732.36	0.02
946	600981	苏豪汇鸿	27,200	85,408.00	0.02
947	001236	弘业期货	8,000	84,800.00	0.02
948	002235	安妮股份	8,200	84,788.00	0.02
949	002679	福建金森	7,200	84,672.00	0.02
950	002119	康强电子	5,100	83,997.00	0.02
951	002641	公元股份	19,400	83,808.00	0.02
951	601019	山东出版	9,700	83,808.00	0.02
952	000519	中兵红箭	4,600	83,766.00	0.02
953	600258	首旅酒店	5,000	83,750.00	0.02
954	300094	国联水产	23,500	83,660.00	0.02
955	600516	方大炭素	14,700	83,643.00	0.02
956	600435	北方导航	5,400	83,268.00	0.02
957	002796	世嘉科技	3,000	83,190.00	0.02
958	002484	江海股份	2,800	83,160.00	0.02
959	300920	润阳科技	1,800	82,926.00	0.02
960	605178	时空科技	1,600	82,864.00	0.02
961	300012	华测检测	6,100	82,655.00	0.02
962	605399	晨光新材	6,100	82,472.00	0.02
963	301009	可靠股份	6,500	82,420.00	0.02
964	002949	华阳国际	5,300	82,415.00	0.02
965	002303	美盈森	20,400	82,212.00	0.02
966	603008	喜临门	4,000	81,920.00	0.02
967	688733	壹石通	2,822	81,781.56	0.02
968	605066	天正电气	11,200	81,760.00	0.02
969	300278	华昌达	13,300	81,130.00	0.02
970	600792	云煤能源	20,900	81,092.00	0.02
971	600348	华阳股份	9,800	80,948.00	0.02
972	300505	川金诺	3,600	80,604.00	0.02
973	301295	美硕科技	2,700	80,460.00	0.02
974	300972	万辰集团	400	80,428.00	0.02
975	002218	拓日新能	18,500	80,290.00	0.02

976	603166	福达股份	5,100	80,070.00	0.02
977	301306	西测测试	700	80,052.00	0.02
978	300756	金马游乐	1,400	79,632.00	0.02
979	300586	美联新材	7,300	79,497.00	0.02
980	603338	浙江鼎力	1,400	79,296.00	0.02
981	603345	安井食品	1,000	79,280.00	0.02
982	002768	国恩股份	1,500	79,020.00	0.02
983	300318	博晖创新	12,600	79,002.00	0.02
984	600025	华能水电	8,700	78,996.00	0.02
985	600208	衢州发展	20,400	78,948.00	0.02
986	688670	金迪克	3,879	78,472.17	0.02
987	301468	博盈特焊	1,500	78,420.00	0.02
988	002443	金洲管道	9,600	78,336.00	0.02
989	600192	长城电工	7,700	78,078.00	0.02
990	002056	横店东磁	4,000	78,000.00	0.02
991	600820	隧道股份	12,000	77,880.00	0.02
992	002669	康达新材	5,100	77,520.00	0.02
993	000729	燕京啤酒	6,900	77,487.00	0.02
994	002313	日海智能	7,600	77,444.00	0.02
995	301611	珂玛科技	900	77,157.00	0.02
996	688510	航亚科技	2,868	77,149.20	0.02
997	000723	美锦能源	16,400	77,080.00	0.02
998	600768	宁波富邦	5,500	77,000.00	0.02
999	603816	顾家家居	2,500	76,850.00	0.02
1,000	000035	中国天楹	13,900	76,728.00	0.02
1,001	000572	海马汽车	9,400	76,704.00	0.02
1,002	000785	居然智家	26,200	76,504.00	0.02
1,003	002911	佛燃能源	6,300	76,356.00	0.02
1,004	002926	华西证券	8,200	76,096.00	0.02
1,005	605567	春雪食品	6,900	75,900.00	0.02
1,006	688166	博瑞医药	1,547	75,895.82	0.02
1,007	600371	万向德农	8,700	75,864.00	0.02
1,008	601609	金田股份	7,000	75,600.00	0.02
1,009	002853	皮阿诺	3,600	75,456.00	0.02
1,010	600060	海信视像	3,100	75,268.00	0.02
1,011	000593	德龙汇能	6,700	75,040.00	0.02
1,012	601958	金钼股份	4,800	74,784.00	0.02
1,013	002430	杭氧股份	2,500	74,675.00	0.02
1,014	300405	科隆股份	11,700	74,646.00	0.02
1,015	002314	南山控股	26,100	74,385.00	0.02
1,016	688009	中国通号	13,590	74,337.30	0.02
1,017	603861	白云电器	6,100	74,237.00	0.02
1,018	002589	瑞康医药	23,000	74,060.00	0.01

1,019	600967	内蒙一机	4,400	73,920.00	0.01
1,020	600649	城投控股	16,600	73,870.00	0.01
1,021	001389	广合科技	900	73,467.00	0.01
1,022	603897	长城科技	2,700	73,440.00	0.01
1,023	301108	洁雅股份	2,200	73,172.00	0.01
1,024	601699	潞安环能	6,200	73,160.00	0.01
1,025	601018	宁波港	20,100	72,963.00	0.01
1,026	605336	帅丰电器	4,600	72,404.00	0.01
1,027	002593	日上集团	12,200	72,102.00	0.01
1,028	002405	四维图新	8,000	72,080.00	0.01
1,029	600398	海澜之家	11,900	71,995.00	0.01
1,030	300818	耐普矿机	1,900	71,953.00	0.01
1,031	300169	天晟新材	11,500	71,875.00	0.01
1,032	601106	中国一重	18,000	71,820.00	0.01
1,033	000757	浩物股份	14,700	71,589.00	0.01
1,034	600320	振华重工	13,900	71,585.00	0.01
1,035	000629	钒钛股份	23,000	71,300.00	0.01
1,036	603527	众源新材	6,400	70,976.00	0.01
1,037	600429	三元股份	13,700	70,966.00	0.01
1,038	688382	益方生物	2,600	70,824.00	0.01
1,039	002972	科安达	5,900	70,505.00	0.01
1,040	601991	大唐发电	20,200	70,498.00	0.01
1,041	301122	采纳股份	2,700	70,362.00	0.01
1,042	002020	京新药业	3,700	70,226.00	0.01
1,043	002025	航天电器	1,400	70,182.00	0.01
1,044	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.01
1,045	603815	交建股份	9,400	69,936.00	0.01
1,046	002301	齐心集团	9,100	69,888.00	0.01
1,047	601869	长飞光纤	600	69,816.00	0.01
1,048	300088	长信科技	11,500	69,690.00	0.01
1,049	688679	通源环境	2,610	69,426.00	0.01
1,050	300753	爱朋医疗	2,500	69,375.00	0.01
1,051	603878	武进不锈	7,400	68,524.00	0.01
1,052	300938	信测标准	2,100	68,460.00	0.01
1,053	300265	通光线缆	5,100	68,340.00	0.01
1,054	002718	友邦吊顶	1,900	68,286.00	0.01
1,055	603585	苏利股份	3,600	67,896.00	0.01
1,056	688202	美迪西	1,200	67,680.00	0.01
1,057	605100	华丰股份	1,500	67,455.00	0.01
1,058	603488	展鹏科技	8,600	67,080.00	0.01
1,059	603159	上海亚虹	2,600	66,846.00	0.01
1,060	601068	中铝国际	12,600	66,654.00	0.01
1,061	688103	国力电子	1,100	66,649.00	0.01

1,062	300931	通用电梯	6,000	66,420.00	0.01
1,063	301235	华康洁净	1,800	66,366.00	0.01
1,064	600521	华海药业	3,900	66,183.00	0.01
1,065	301058	中粮科工	6,000	65,760.00	0.01
1,066	301116	益客食品	6,000	65,580.00	0.01
1,067	600318	新力金融	7,300	65,554.00	0.01
1,068	002782	可立克	3,600	65,376.00	0.01
1,069	000987	越秀资本	8,000	65,120.00	0.01
1,070	603511	爱慕股份	4,200	65,058.00	0.01
1,071	688150	莱特光电	2,405	65,007.15	0.01
1,072	301167	建研设计	4,000	65,000.00	0.01
1,073	002090	金智科技	5,500	64,900.00	0.01
1,074	002706	良信股份	6,000	64,680.00	0.01
1,075	003027	同兴科技	2,900	64,670.00	0.01
1,076	300665	飞鹿股份	6,600	64,416.00	0.01
1,077	000705	浙江震元	7,100	64,255.00	0.01
1,078	601865	福莱特	4,100	64,247.00	0.01
1,079	000599	青岛双星	9,700	64,214.00	0.01
1,080	000856	冀东装备	6,200	63,612.00	0.01
1,081	300259	新天科技	14,300	63,492.00	0.01
1,082	600998	九州通	12,400	63,488.00	0.01
1,083	600226	亨通股份	11,900	63,427.00	0.01
1,084	300025	华星创业	11,000	63,360.00	0.01
1,085	300596	利安隆	1,500	63,315.00	0.01
1,086	002121	科陆电子	8,200	63,140.00	0.01
1,087	603676	卫信康	6,000	63,120.00	0.01
1,088	601608	中信重工	9,500	62,605.00	0.01
1,089	600685	中船防务	2,200	62,590.00	0.01
1,090	002112	三变科技	4,700	62,322.00	0.01
1,091	300886	华业香料	2,400	62,184.00	0.01
1,092	300791	仙乐健康	2,400	62,064.00	0.01
1,093	605020	永和股份	2,300	61,847.00	0.01
1,094	600602	云赛智联	3,300	61,677.00	0.01
1,095	300749	顶固集创	5,100	61,557.00	0.01
1,096	600076	康欣新材	18,000	60,660.00	0.01
1,097	688041	海光信息	270	60,590.70	0.01
1,098	603711	香飘飘	4,500	60,435.00	0.01
1,099	002780	三夫户外	4,200	60,312.00	0.01
1,100	000783	长江证券	7,400	60,310.00	0.01
1,101	300146	汤臣倍健	5,000	60,050.00	0.01
1,102	001278	一彬科技	3,100	59,954.00	0.01
1,103	002623	亚玛顿	3,300	59,730.00	0.01
1,104	000825	太钢不锈	12,200	59,658.00	0.01

1, 105	600126	杭钢股份	7, 300	59, 568. 00	0. 01
1, 106	300984	金沃股份	700	59, 416. 00	0. 01
1, 107	603330	天洋新材	8, 200	59, 368. 00	0. 01
1, 108	000892	欢瑞世纪	8, 500	59, 330. 00	0. 01
1, 109	600583	海油工程	10, 800	59, 292. 00	0. 01
1, 110	600831	广电网络	14, 100	59, 220. 00	0. 01
1, 111	688097	博众精工	1, 568	59, 192. 00	0. 01
1, 112	300154	瑞凌股份	6, 000	59, 100. 00	0. 01
1, 113	600793	宜宾纸业	2, 800	59, 080. 00	0. 01
1, 114	600995	南网储能	4, 700	59, 079. 00	0. 01
1, 115	600121	郑州煤电	14, 100	58, 797. 00	0. 01
1, 116	600698	湖南天雁	6, 500	58, 760. 00	0. 01
1, 117	002451	摩恩电气	5, 800	58, 754. 00	0. 01
1, 118	300923	研奥股份	2, 300	58, 719. 00	0. 01
1, 119	000797	中国武夷	14, 900	58, 557. 00	0. 01
1, 120	002423	中粮资本	5, 000	58, 500. 00	0. 01
1, 120	600848	上海临港	5, 000	58, 500. 00	0. 01
1, 121	603029	天鹅股份	3, 200	58, 368. 00	0. 01
1, 122	301197	工大科雅	2, 800	58, 352. 00	0. 01
1, 123	002137	实益达	6, 800	58, 344. 00	0. 01
1, 124	601666	平煤股份	7, 400	58, 238. 00	0. 01
1, 125	600207	安彩高科	11, 300	58, 195. 00	0. 01
1, 126	601001	晋控煤业	4, 400	57, 860. 00	0. 01
1, 127	000419	通程控股	9, 000	57, 510. 00	0. 01
1, 128	300474	景嘉微	800	57, 496. 00	0. 01
1, 129	002576	通达动力	3, 300	57, 420. 00	0. 01
1, 130	000534	万泽股份	2, 600	57, 200. 00	0. 01
1, 131	001300	三柏硕	3, 700	57, 165. 00	0. 01
1, 132	000921	海信家电	2, 300	57, 063. 00	0. 01
1, 133	002547	春兴精工	12, 200	56, 974. 00	0. 01
1, 134	688517	金冠电气	3, 653	56, 950. 27	0. 01
1, 135	002773	康弘药业	1, 900	56, 943. 00	0. 01
1, 136	002588	史丹利	5, 700	56, 886. 00	0. 01
1, 137	600423	柳化股份	15, 200	56, 544. 00	0. 01
1, 138	002344	海宁皮城	11, 900	56, 406. 00	0. 01
1, 139	603217	元利科技	2, 200	56, 364. 00	0. 01
1, 140	002702	海欣食品	7, 900	56, 248. 00	0. 01
1, 141	688179	阿拉丁	4, 500	56, 205. 00	0. 01
1, 142	603115	海星股份	3, 000	56, 130. 00	0. 01
1, 143	000957	中通客车	4, 900	55, 958. 00	0. 01
1, 144	000598	兴蓉环境	7, 800	55, 926. 00	0. 01
1, 145	300136	信维通信	900	55, 800. 00	0. 01
1, 146	600535	天士力	3, 700	55, 759. 00	0. 01

1,147	600662	外服控股	11,100	55,722.00	0.01
1,148	600380	健康元	4,800	55,440.00	0.01
1,149	688521	芯原股份	400	54,788.00	0.01
1,150	688281	华秦科技	741	54,685.80	0.01
1,151	002097	山河智能	4,400	54,604.00	0.01
1,152	601118	海南橡胶	9,300	54,405.00	0.01
1,153	000050	深天马 A	6,000	54,180.00	0.01
1,154	002831	裕同科技	1,900	54,169.00	0.01
1,155	000062	深圳华强	2,200	54,164.00	0.01
1,156	000796	凯撒旅业	7,500	54,000.00	0.01
1,157	688235	百济神州	200	53,720.00	0.01
1,158	002265	建设工业	2,000	53,640.00	0.01
1,159	605499	东鹏饮料	200	53,478.00	0.01
1,160	002536	飞龙股份	1,800	53,460.00	0.01
1,161	300286	安科瑞	2,300	53,084.00	0.01
1,162	301268	铭利达	2,900	52,867.00	0.01
1,163	600655	豫园股份	10,300	52,839.00	0.01
1,164	300932	三友联众	4,400	52,756.00	0.01
1,165	002270	华明装备	2,100	52,584.00	0.01
1,166	300821	东岳硅材	4,500	52,470.00	0.01
1,167	300196	长海股份	3,600	52,416.00	0.01
1,168	000951	中国重汽	3,100	52,390.00	0.01
1,169	600403	大有能源	7,500	52,350.00	0.01
1,170	600483	福能股份	5,500	52,085.00	0.01
1,171	300779	惠城环保	400	52,044.00	0.01
1,172	600808	马钢股份	12,300	51,906.00	0.01
1,173	688309	恒誉环保	2,142	51,686.46	0.01
1,174	603098	森特股份	3,700	51,467.00	0.01
1,175	688729	屹唐股份	2,116	51,376.48	0.01
1,176	300053	航宇微	2,700	51,354.00	0.01
1,177	002256	兆新股份	14,700	51,303.00	0.01
1,178	000838	财信发展	16,600	51,294.00	0.01
1,179	002913	奥士康	1,200	51,288.00	0.01
1,180	003012	东鹏控股	7,800	51,090.00	0.01
1,181	600386	北巴传媒	11,500	50,485.00	0.01
1,182	000523	红棉股份	13,300	50,141.00	0.01
1,183	300191	潜能恒信	2,700	49,896.00	0.01
1,184	603103	横店影视	3,000	49,740.00	0.01
1,185	300137	先河环保	4,800	49,728.00	0.01
1,186	301360	荣旗科技	700	49,630.00	0.01
1,187	001366	播恩集团	3,700	49,469.00	0.01
1,188	300251	光线传媒	3,000	49,140.00	0.01
1,189	300065	海兰信	2,700	49,059.00	0.01

1,190	603126	中材节能	7,300	49,056.00	0.01
1,191	300057	万顺新材	8,600	48,934.00	0.01
1,192	600110	诺德股份	6,900	48,921.00	0.01
1,193	002153	石基信息	4,500	48,735.00	0.01
1,194	603899	晨光股份	1,800	48,708.00	0.01
1,195	601218	吉鑫科技	9,600	48,576.00	0.01
1,196	600153	建发股份	5,200	48,100.00	0.01
1,197	000088	盐田港	10,800	48,060.00	0.01
1,198	601598	中国外运	7,900	47,874.00	0.01
1,199	688208	道通科技	1,300	47,840.00	0.01
1,200	300963	中洲特材	2,300	47,794.00	0.01
1,201	688141	杰华特	1,100	47,773.00	0.01
1,202	603657	春光科技	1,600	47,680.00	0.01
1,203	688790	昂瑞微	406	47,579.14	0.01
1,204	000739	普洛药业	2,900	47,183.00	0.01
1,205	002670	国盛证券	2,800	47,152.00	0.01
1,206	300234	开尔新材	8,500	46,750.00	0.01
1,207	300691	联合光电	2,700	46,629.00	0.01
1,208	300323	华灿光电	5,800	46,284.00	0.01
1,209	688003	天准科技	785	46,236.50	0.01
1,210	300270	中威电子	4,200	46,032.00	0.01
1,211	601089	福元医药	1,900	45,600.00	0.01
1,212	600562	国睿科技	1,600	45,216.00	0.01
1,213	600517	国网英大	7,500	45,075.00	0.01
1,214	000066	中国长城	3,100	44,671.00	0.01
1,215	688176	亚虹医药	3,876	44,612.76	0.01
1,216	300658	延江股份	3,000	44,460.00	0.01
1,217	603031	安孚科技	1,000	44,300.00	0.01
1,218	301548	崇德科技	800	44,248.00	0.01
1,219	600308	华泰股份	11,300	44,070.00	0.01
1,220	601808	中海油服	3,100	43,524.00	0.01
1,221	688114	华大智造	710	43,139.60	0.01
1,222	603057	紫燕食品	2,100	42,714.00	0.01
1,223	002312	川发龙蟒	3,900	42,627.00	0.01
1,224	688116	天奈科技	900	42,435.00	0.01
1,225	300465	高伟达	2,100	42,273.00	0.01
1,226	300675	建科院	2,700	42,174.00	0.01
1,227	603565	中谷物流	4,200	42,168.00	0.01
1,228	600566	济川药业	1,600	42,080.00	0.01
1,229	600774	汉商集团	4,600	42,044.00	0.01
1,230	688191	智洋创新	1,300	41,834.00	0.01
1,231	000831	中国稀土	900	41,796.00	0.01
1,232	003022	联泓新科	2,100	41,601.00	0.01

1,233	601366	利群股份	8,500	41,480.00	0.01
1,234	600637	东方明珠	4,200	41,370.00	0.01
1,235	300751	迈为股份	200	41,198.00	0.01
1,236	688455	科捷智能	2,046	41,104.14	0.01
1,237	600968	海油发展	10,700	41,088.00	0.01
1,238	688709	成都华微	885	40,701.15	0.01
1,239	600988	赤峰黄金	1,300	40,612.00	0.01
1,240	688002	睿创微纳	400	40,320.00	0.01
1,241	603489	八方股份	1,300	39,754.00	0.01
1,242	600053	九鼎投资	2,000	39,740.00	0.01
1,243	300386	飞天诚信	2,200	39,732.00	0.01
1,244	300069	金利华电	2,300	39,675.00	0.01
1,245	001277	速达股份	1,000	39,500.00	0.01
1,246	300673	佩蒂股份	2,200	39,446.00	0.01
1,247	000078	海王生物	11,400	39,444.00	0.01
1,248	300189	神农种业	5,300	39,432.00	0.01
1,249	300835	龙磁科技	600	39,348.00	0.01
1,250	300195	长荣股份	4,900	39,249.00	0.01
1,251	603628	清源股份	2,900	39,150.00	0.01
1,252	002600	领益智造	2,500	38,850.00	0.01
1,253	688210	统联精密	700	38,724.00	0.01
1,254	002227	奥特迅	3,200	38,528.00	0.01
1,255	002379	宏创控股	1,600	38,272.00	0.01
1,256	300623	捷捷微电	1,400	38,038.00	0.01
1,257	688809	强一股份	187	38,018.97	0.01
1,258	000586	汇源通信	2,800	37,884.00	0.01
1,259	002555	三七互娱	1,600	37,760.00	0.01
1,260	002460	赣锋锂业	600	37,734.00	0.01
1,261	301215	中汽股份	5,500	37,675.00	0.01
1,262	000070	特发信息	3,200	37,568.00	0.01
1,263	301040	中环海陆	1,300	36,907.00	0.01
1,264	002011	盾安环境	2,900	36,772.00	0.01
1,265	603819	神力股份	3,000	36,420.00	0.01
1,266	002947	恒铭达	700	36,414.00	0.01
1,267	300553	集智股份	900	36,351.00	0.01
1,268	688189	南新制药	4,560	36,343.20	0.01
1,269	600266	城建发展	7,100	35,997.00	0.01
1,270	600295	鄂尔多斯	2,900	35,844.00	0.01
1,271	002243	力合科创	3,600	35,820.00	0.01
1,272	002069	獐子岛	9,600	35,808.00	0.01
1,273	300504	天邑股份	2,400	35,736.00	0.01
1,274	605299	舒华体育	3,100	35,619.00	0.01
1,275	300569	天能重工	6,200	35,588.00	0.01

1,276	600456	宝钛股份	900	35,505.00	0.01
1,277	601677	明泰铝业	2,400	35,496.00	0.01
1,278	688187	时代电气	692	35,492.68	0.01
1,279	605158	华达新材	4,400	35,376.00	0.01
1,280	301055	张小泉	1,800	35,298.00	0.01
1,281	603233	大参林	2,000	35,240.00	0.01
1,282	688528	秦川物联	3,243	34,927.11	0.01
1,283	601965	中国汽研	2,100	34,860.00	0.01
1,284	002998	优彩资源	4,600	34,730.00	0.01
1,285	603725	天安新材	3,700	34,225.00	0.01
1,286	300824	北鼎股份	3,000	33,930.00	0.01
1,287	600620	天宸股份	5,200	33,800.00	0.01
1,288	300857	协创数据	200	33,736.00	0.01
1,289	002683	广东宏大	700	33,460.00	0.01
1,290	300139	晓程科技	1,100	33,396.00	0.01
1,291	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.01
1,292	600886	国投电力	2,500	32,800.00	0.01
1,293	688520	神州细胞	743	32,179.33	0.01
1,294	600097	开创国际	2,800	31,808.00	0.01
1,295	000429	粤高速 A	2,700	31,806.00	0.01
1,296	002382	蓝帆医疗	5,600	31,360.00	0.01
1,297	002817	黄山胶囊	4,100	31,160.00	0.01
1,298	301183	东田微	200	31,018.00	0.01
1,299	300084	海默科技	3,100	30,969.00	0.01
1,300	603239	浙江仙通	1,500	30,765.00	0.01
1,301	000985	大庆华科	1,600	30,576.00	0.01
1,302	300987	川网传媒	1,800	30,240.00	0.01
1,303	300599	雄塑科技	3,700	30,155.00	0.01
1,304	002731	萃华珠宝	2,400	30,144.00	0.01
1,305	002805	丰元股份	1,700	30,141.00	0.01
1,306	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.01
1,307	300564	筑博设计	1,900	29,925.00	0.01
1,308	688209	英集芯	1,500	29,910.00	0.01
1,309	301182	凯旺科技	700	29,834.00	0.01
1,310	603282	亚光股份	1,500	29,760.00	0.01
1,311	301098	金埔园林	3,400	29,172.00	0.01
1,312	001896	豫能控股	5,600	29,120.00	0.01
1,313	301536	星辰科技	481	28,816.71	0.01
1,314	002871	伟隆股份	1,600	28,800.00	0.01
1,315	603665	康隆达	900	28,728.00	0.01
1,316	603929	亚翔集成	300	28,650.00	0.01
1,317	002245	蔚蓝锂芯	1,600	28,480.00	0.01
1,318	603109	神驰机电	1,100	28,369.00	0.01

1,319	002568	百润股份	1,300	28,353.00	0.01
1,320	600333	长春燃气	5,100	28,203.00	0.01
1,321	688602	康鹏科技	3,198	27,758.64	0.01
1,322	600643	爱建集团	5,000	27,650.00	0.01
1,323	600339	中油工程	8,200	27,470.00	0.01
1,324	300735	光弘科技	1,100	27,346.00	0.01
1,325	300240	飞力达	3,600	27,144.00	0.01
1,326	600884	杉杉股份	2,000	27,020.00	0.01
1,327	002286	保龄宝	3,000	26,820.00	0.01
1,328	603326	我乐家居	3,000	26,700.00	0.01
1,329	300741	华宝股份	1,400	26,012.00	0.01
1,330	600032	浙江新能	3,500	25,935.00	0.01
1,331	002846	英联股份	1,600	25,824.00	0.01
1,332	603421	鼎信通讯	3,600	25,776.00	0.01
1,333	600257	大湖股份	4,100	25,748.00	0.01
1,334	300513	恒实科技	2,700	25,623.00	0.01
1,335	600749	西藏旅游	1,500	25,620.00	0.01
1,336	301356	天振股份	1,200	25,428.00	0.01
1,337	600996	贵广网络	2,500	25,100.00	0.01
1,338	605108	同庆楼	1,300	24,986.00	0.01
1,339	603066	音飞储存	2,300	24,725.00	0.01
1,340	605151	西上海	1,300	24,557.00	0.00
1,341	002458	益生股份	2,900	24,302.00	0.00
1,342	300732	设研院	3,200	24,000.00	0.00
1,343	603298	杭叉集团	900	23,913.00	0.00
1,344	603091	众鑫股份	300	23,763.00	0.00
1,345	002523	天桥起重	5,500	23,595.00	0.00
1,346	301522	上大股份	600	23,502.00	0.00
1,347	600642	申能股份	3,000	23,340.00	0.00
1,348	600186	莲花控股	3,900	23,322.00	0.00
1,349	603101	汇嘉时代	2,400	23,184.00	0.00
1,350	000716	黑芝麻	3,700	23,051.00	0.00
1,351	000803	山高环能	3,200	22,880.00	0.00
1,352	301361	众智科技	700	22,813.00	0.00
1,353	002918	蒙娜丽莎	1,600	22,768.00	0.00
1,354	688558	国盛智科	784	22,681.12	0.00
1,355	603727	博迈科	1,600	22,368.00	0.00
1,356	003011	海象新材	1,000	22,040.00	0.00
1,357	603231	索宝蛋白	1,200	21,984.00	0.00
1,358	688419	耐科装备	775	21,692.25	0.00
1,359	002877	智能自控	2,300	21,114.00	0.00
1,360	300560	中富通	1,300	21,008.00	0.00
1,361	300140	节能环保	3,100	20,987.00	0.00

1,362	600515	海南机场	3,900	20,787.00	0.00
1,363	603161	科华控股	1,500	20,595.00	0.00
1,364	300490	华自科技	1,700	20,383.00	0.00
1,365	600822	上海物贸	1,900	20,349.00	0.00
1,366	300480	光力科技	1,200	20,052.00	0.00
1,367	000830	鲁西化工	1,200	19,884.00	0.00
1,368	600299	安迪苏	2,200	19,734.00	0.00
1,369	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
1,370	600833	第一医药	1,500	19,395.00	0.00
1,371	688175	高凌信息	600	19,326.00	0.00
1,372	301228	实朴检测	500	19,305.00	0.00
1,373	001258	立新能源	2,700	19,197.00	0.00
1,374	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
1,375	603682	锦和商管	2,900	19,111.00	0.00
1,376	000936	华西股份	2,300	18,929.00	0.00
1,377	600426	华鲁恒升	600	18,858.00	0.00
1,378	600980	北矿科技	800	18,384.00	0.00
1,379	300778	新城市	1,300	18,044.00	0.00
1,380	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
1,381	002660	茂硕电源	1,900	17,499.00	0.00
1,382	600448	华纺股份	5,500	17,325.00	0.00
1,383	600722	金牛化工	2,900	17,226.00	0.00
1,384	600658	电子城	3,100	17,019.00	0.00
1,385	600936	北投科技	4,000	16,880.00	0.00
1,386	002585	双星新材	2,500	16,825.00	0.00
1,387	002461	珠江啤酒	1,800	16,722.00	0.00
1,388	300629	新劲刚	700	16,646.00	0.00
1,389	002798	帝欧水华	2,900	16,617.00	0.00
1,390	688288	鸿泉技术	619	16,595.39	0.00
1,391	688115	思林杰	252	16,526.16	0.00
1,392	000695	滨海能源	1,300	16,523.00	0.00
1,393	603408	建霖家居	1,200	16,248.00	0.00
1,394	001313	粤海饲料	2,200	16,104.00	0.00
1,395	001255	博菲电气	500	16,015.00	0.00
1,396	688620	安凯微	1,298	15,627.92	0.00
1,397	301277	新天地	1,324	15,609.96	0.00
1,398	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
1,399	000032	深桑达 A	800	15,480.00	0.00
1,400	300184	力源信息	1,500	14,985.00	0.00
1,401	603028	赛福天	1,600	14,912.00	0.00
1,402	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
1,403	301168	通灵股份	300	14,010.00	0.00
1,404	600158	中体产业	1,600	13,968.00	0.00

1,405	688229	博睿数据	216	13,538.88	0.00
1,406	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
1,407	600008	XD 首创环	4,500	13,500.00	0.00
1,408	600714	金瑞矿业	1,100	13,486.00	0.00
1,409	002320	海峡股份	1,100	13,387.00	0.00
1,410	002835	同为股份	800	13,104.00	0.00
1,411	600513	联环药业	700	12,817.00	0.00
1,412	301667	纳百川	201	12,630.07	0.00
1,413	603806	福斯特	900	12,564.00	0.00
1,414	002154	报喜鸟	3,200	12,320.00	0.00
1,415	002356	赫美集团	3,100	12,276.00	0.00
1,416	603758	秦安股份	700	12,173.00	0.00
1,417	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
1,418	301212	联盛化学	400	11,984.00	0.00
1,419	600683	京投发展	2,800	11,956.00	0.00
1,420	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
1,421	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
1,422	600353	旭光电子	700	11,284.00	0.00
1,423	688221	前沿生物	623	11,245.15	0.00
1,424	301516	中远通	700	10,927.00	0.00
1,425	300062	中能电气	1,300	10,829.00	0.00
1,426	002961	瑞达期货	400	10,828.00	0.00
1,427	301519	舜禹股份	800	10,736.00	0.00
1,428	002498	汉缆股份	2,800	10,724.00	0.00
1,429	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
1,430	301227	森鹰窗业	200	10,604.00	0.00
1,431	300897	山科智能	400	10,288.00	0.00
1,432	002890	弘宇股份	700	10,220.00	0.00
1,433	300878	维康药业	400	10,204.00	0.00
1,434	000890	法尔胜	2,000	10,140.00	0.00
1,435	603276	恒兴新材	601	9,976.60	0.00
1,436	688659	元琛科技	1,041	9,837.45	0.00
1,437	300331	苏大维格	300	9,708.00	0.00
1,438	002492	恒基达鑫	1,100	9,614.00	0.00
1,439	300724	捷佳伟创	100	9,560.00	0.00
1,440	301601	惠通科技	342	9,504.18	0.00
1,441	300558	贝达药业	200	9,338.00	0.00
1,442	603221	爱丽家居	700	9,170.00	0.00
1,443	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
1,444	001287	中电港	400	9,064.00	0.00
1,445	300436	广生堂	100	8,915.00	0.00
1,446	603208	江山欧派	600	8,730.00	0.00
1,447	600663	陆家嘴	1,100	8,701.00	0.00

1,448	603156	养元饮品	300	8,625.00	0.00
1,449	000559	万向钱潮	500	8,600.00	0.00
1,450	600488	津药药业	2,100	8,589.00	0.00
1,451	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
1,452	000422	湖北宜化	600	8,526.00	0.00
1,453	600617	国新能源	2,700	8,478.00	0.00
1,454	688038	中科通达	467	8,251.89	0.00
1,455	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
1,456	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
1,457	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
1,458	000988	华工科技	100	7,933.00	0.00
1,459	003033	征和工业	100	7,861.00	0.00
1,460	603918	金桥信息	500	7,845.00	0.00
1,461	301449	天溯计量	118	7,812.34	0.00
1,462	603790	雅运股份	400	7,796.00	0.00
1,463	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
1,464	300888	稳健医疗	200	7,568.00	0.00
1,465	002172	澳洋健康	1,900	7,543.00	0.00
1,466	601339	百隆东方	1,300	7,527.00	0.00
1,467	002158	汉钟精机	300	7,509.00	0.00
1,468	300645	正元智慧	400	7,492.00	0.00
1,469	688426	康为世纪	313	7,458.79	0.00
1,470	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
1,471	603228	景旺电子	100	7,309.00	0.00
1,472	002664	信质集团	300	7,188.00	0.00
1,473	605500	森林包装	800	7,160.00	0.00
1,474	000958	电投产融	1,100	7,117.00	0.00
1,475	301518	长华化学	200	7,114.00	0.00
1,476	600986	浙文互联	900	7,038.00	0.00
1,477	600345	长江通信	200	6,932.00	0.00
1,478	601388	怡球资源	2,300	6,923.00	0.00
1,479	300819	聚杰微纤	200	6,914.00	0.00
1,480	603466	风语筑	700	6,552.00	0.00
1,481	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
1,482	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
1,483	603880	南卫股份	1,000	6,230.00	0.00
1,484	301231	荣信文化	200	6,216.00	0.00
1,485	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
1,486	002955	鸿合科技	200	6,054.00	0.00
1,487	600918	中泰证券	900	5,850.00	0.00
1,488	300807	天迈科技	100	5,519.00	0.00
1,489	301125	腾亚精工	300	5,514.00	0.00
1,490	603515	欧普照明	300	5,484.00	0.00

1,491	002658	雪迪龙	600	5,418.00	0.00
1,492	300588	熙菱信息	200	5,400.00	0.00
1,493	300745	欣锐科技	200	5,152.00	0.00
1,494	002127	南极电商	1,500	5,055.00	0.00
1,495	603248	锡华科技	292	4,941.04	0.00
1,496	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
1,497	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
1,498	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
1,499	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
1,500	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
1,501	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	00700	腾讯控股	51,443,557.11	13.70
2	09988	阿里巴巴-W	24,150,737.49	6.43
3	002335	科华数据	22,516,780.00	6.00
4	00981	中芯国际	16,431,694.51	4.38
4	688981	中芯国际	5,453,262.69	1.45
5	300502	新易盛	21,345,018.00	5.68
6	03690	美团-W	20,683,824.13	5.51
7	601901	方正证券	18,527,570.00	4.93
8	300972	万辰集团	17,099,534.89	4.55
9	600941	中国移动	11,391,066.63	3.03
9	00941	中国移动	5,482,054.43	1.46
10	601899	紫金矿业	14,799,983.50	3.94
10	02899	紫金矿业	1,635,194.02	0.44
11	601168	西部矿业	16,227,774.50	4.32
12	09858	优然牧业	15,554,131.07	4.14
13	002487	大金重工	15,516,730.00	4.13
14	600188	兖矿能源	9,378,163.30	2.50
14	01171	兖矿能源	5,927,898.86	1.58
15	000729	燕京啤酒	15,144,710.00	4.03
16	300014	亿纬锂能	15,010,502.00	4.00
17	600428	中远海特	14,956,363.20	3.98
18	002463	沪电股份	14,693,090.30	3.91
19	002624	完美世界	14,649,622.00	3.90
20	00763	中兴通讯	7,818,474.18	2.08
20	000063	中兴通讯	6,721,505.49	1.79
21	600873	梅花生物	14,369,921.00	3.83
22	601138	工业富联	14,270,927.00	3.80
23	002345	潮宏基	13,828,601.00	3.68

24	300395	菲利华	13,638,355.00	3.63
25	601319	中国人保	9,179,250.00	2.44
25	01339	中国人民保险集团	4,338,841.91	1.16
26	000600	建投能源	13,379,342.00	3.56
27	300750	宁德时代	13,136,787.00	3.50
28	002847	盐津铺子	13,127,475.00	3.50
29	300850	新强联	13,112,169.30	3.49
30	01177	中国生物制药	13,024,015.82	3.47
31	601208	东材科技	12,687,293.00	3.38
32	000726	鲁泰A	12,418,515.00	3.31
33	002080	中材科技	12,160,235.00	3.24
34	600183	生益科技	12,137,645.00	3.23
35	000893	亚钾国际	11,921,900.00	3.18
36	601107	四川成渝	11,892,820.92	3.17
37	601991	大唐发电	7,268,921.00	1.94
37	00991	大唐发电	4,609,468.85	1.23
38	600011	华能国际	8,681,404.00	2.31
38	00902	华能国际电力股份	3,129,162.52	0.83
39	600064	南京高科	11,740,713.00	3.13
40	601601	中国太保	6,785,008.00	1.81
40	02601	中国太保	4,767,756.90	1.27
41	01024	快手-W	11,539,637.20	3.07
42	01801	信达生物	11,538,944.26	3.07
43	600060	海信视像	11,535,191.00	3.07
44	688258	卓易信息	11,504,970.74	3.06
45	600795	国电电力	11,477,657.80	3.06
46	600219	南山铝业	11,322,149.00	3.02
47	688182	灿勤科技	11,237,699.44	2.99
48	600166	福田汽车	11,134,065.00	2.97
49	688428	诺诚健华	5,598,188.64	1.49
49	09969	诺诚健华	5,495,295.42	1.46
50	600315	上海家化	11,034,904.29	2.94
51	300363	博腾股份	11,020,590.00	2.94
52	601579	会稽山	11,013,256.98	2.93
53	600292	远达环保	10,910,003.00	2.91
54	600027	华电国际	8,021,146.00	2.14
54	01071	华电国际电力股份	2,852,260.91	0.76
55	000596	古井贡酒	10,798,964.00	2.88
56	600176	中国巨石	10,752,110.20	2.86
57	300308	中际旭创	10,746,634.00	2.86
58	600761	安徽合力	10,746,336.00	2.86

59	603225	新凤鸣	10,713,151.00	2.85
60	603993	洛阳钼业	8,373,857.00	2.23
60	03993	洛阳钼业	2,305,848.91	0.61
61	600866	星湖科技	10,663,591.00	2.84
62	09868	小鹏汽车-W	10,638,791.50	2.83
63	01530	三生制药	10,553,628.40	2.81
64	00857	中国石油股份	5,768,200.36	1.54
64	601857	中国石油	4,764,406.00	1.27
65	603659	璞泰来	10,523,501.44	2.80
66	688041	海光信息	10,514,763.27	2.80
67	600938	中国海油	5,895,030.00	1.57
67	00883	中国海洋石油	4,541,222.35	1.21
68	002414	高德红外	10,423,232.00	2.78
69	688629	华丰科技	10,280,626.41	2.74
70	688550	瑞联新材	10,076,664.00	2.68
71	000902	新洋丰	9,984,371.00	2.66
72	300476	胜宏科技	9,963,155.00	2.65
73	300731	科创新源	9,937,488.00	2.65
74	600039	四川路桥	9,917,628.00	2.64
75	300723	一品红	9,877,552.50	2.63
76	01787	山东黄金	6,336,880.31	1.69
76	600547	山东黄金	3,508,801.00	0.93
77	605305	中际联合	9,761,377.00	2.60
78	688313	仕佳光子	9,735,070.66	2.59
79	601336	新华保险	6,395,272.00	1.70
79	01336	新华保险	3,324,198.63	0.89
80	601318	中国平安	7,268,247.00	1.94
80	02318	中国平安	2,395,629.87	0.64
81	300738	奥飞数据	9,636,436.81	2.57
82	688578	艾力斯	9,616,684.37	2.56
83	06181	老铺黄金	9,548,736.68	2.54
84	300570	太辰光	9,489,413.00	2.53
85	002838	道恩股份	9,460,863.75	2.52
86	002384	东山精密	9,460,631.00	2.52
87	688382	益方生物	9,441,773.86	2.51
88	600585	海螺水泥	9,400,966.84	2.50
89	600673	东阳光	9,397,627.00	2.50
90	601117	中国化学	9,319,175.00	2.48
91	600499	科达制造	9,317,905.00	2.48
92	605208	永茂泰	9,277,229.25	2.47
93	605117	德业股份	9,258,110.80	2.47
94	601988	中国银行	9,239,432.00	2.46
95	603986	兆易创新	9,209,418.00	2.45

96	600909	华安证券	9,199,965.00	2.45
97	603566	普莱柯	9,194,143.18	2.45
98	01164	中广核矿业	9,144,403.96	2.44
99	002626	金达威	9,135,515.00	2.43
100	600801	华新建材	6,211,631.80	1.65
100	06655	华新建材	2,896,907.41	0.77
101	300207	欣旺达	9,106,667.72	2.43
102	09896	名创优品	9,087,449.68	2.42
103	02628	中国人寿	5,878,450.00	1.57
103	601628	中国人寿	3,202,573.00	0.85
104	600901	江苏金租	9,062,060.48	2.41
105	01093	石药集团	9,050,625.83	2.41
106	002558	巨人网络	9,020,412.00	2.40
107	002736	国信证券	9,007,579.00	2.40
108	002851	麦格米特	9,002,087.00	2.40
109	002706	良信股份	8,989,672.00	2.39
110	002284	亚太股份	8,919,895.00	2.38
111	300119	瑞普生物	8,909,801.00	2.37
112	000988	华工科技	8,879,046.00	2.36
113	600273	嘉化能源	8,850,615.00	2.36
114	600861	北京人力	8,831,724.96	2.35
115	000783	长江证券	8,775,976.50	2.34
116	01686	新意网集团	8,773,929.73	2.34
117	600875	东方电气	7,784,869.00	2.07
117	01072	东方电气	969,435.09	0.26
118	000568	泸州老窖	8,749,580.00	2.33
119	600887	伊利股份	8,738,110.00	2.33
120	688123	聚辰股份	8,720,340.45	2.32
121	600710	苏美达	8,640,618.00	2.30
122	601998	中信银行	6,257,270.00	1.67
122	00998	中信银行	2,377,364.27	0.63
123	300777	中简科技	8,608,953.00	2.29
124	002568	百润股份	8,589,403.32	2.29
125	000975	山金国际	8,574,280.00	2.28
126	002299	圣农发展	8,563,438.00	2.28
127	301280	珠城科技	8,474,908.00	2.26
128	002991	甘源食品	8,444,797.00	2.25
129	688531	日联科技	8,404,409.70	2.24
130	002281	光迅科技	8,400,910.00	2.24
131	300079	数码视讯	8,380,094.00	2.23
132	300765	新诺威	8,376,234.00	2.23
133	600276	恒瑞医药	7,300,997.00	1.94
133	01276	恒瑞医药	1,056,644.20	0.28

134	000425	徐工机械	8,349,953.53	2.22
135	600098	广州发展	8,325,341.96	2.22
136	000899	赣能股份	8,308,815.00	2.21
137	002895	川恒股份	8,289,944.00	2.21
138	300369	绿盟科技	8,289,028.00	2.21
139	002517	恺英网络	8,261,144.00	2.20
140	002170	芭田股份	8,245,248.00	2.20
141	000938	紫光股份	8,198,025.00	2.18
142	600549	厦门钨业	8,190,132.00	2.18
143	600282	南钢股份	8,148,358.00	2.17
144	300454	深信服	8,115,326.40	2.16
145	601665	齐鲁银行	8,096,989.00	2.16
146	002913	奥士康	8,093,722.50	2.16
147	600378	昊华科技	8,086,084.31	2.15
148	600109	国金证券	8,079,926.00	2.15
149	603596	伯特利	8,079,632.00	2.15
150	301510	固高科技	7,985,396.90	2.13
151	000878	云南铜业	7,961,276.00	2.12
152	603296	华勤技术	7,946,140.00	2.12
153	603228	景旺电子	7,945,956.08	2.12
154	600266	城建发展	7,926,849.00	2.11
155	603300	海南华铁	7,908,287.00	2.11
156	600073	光明肉业	7,869,581.00	2.10
157	002434	万里扬	7,861,815.00	2.09
158	603816	顾家家居	7,853,419.00	2.09
159	603267	鸿远电子	7,841,531.00	2.09
160	601939	建设银行	6,230,719.00	1.66
160	00939	建设银行	1,607,558.29	0.43
161	688676	金盘科技	7,816,533.05	2.08
162	002202	金风科技	5,625,707.00	1.50
162	02208	金风科技	2,176,001.33	0.58
163	600415	小商品城	7,773,046.00	2.07
164	688196	卓越新能	7,759,072.04	2.07
165	301210	金杨精密	7,746,998.48	2.06
166	301367	瑞迈特	7,728,477.48	2.06
167	300443	金雷股份	7,728,132.00	2.06
168	601126	四方股份	7,720,253.00	2.06
169	601083	锦江航运	7,704,918.75	2.05
170	688256	寒武纪	7,694,276.78	2.05
171	600893	航发动力	7,688,995.00	2.05
172	688266	泽璟制药	7,688,121.34	2.05
173	02328	中国财险	7,677,546.63	2.04
174	601231	环旭电子	7,664,234.00	2.04

175	01211	比亚迪股份	4,278,028.36	1.14
175	002594	比亚迪	3,384,839.00	0.90
176	300624	万兴科技	7,627,247.19	2.03
177	603565	中谷物流	7,613,048.00	2.03
178	603766	隆鑫通用	7,580,625.00	2.02
179	000690	宝新能源	7,574,542.00	2.02
180	600998	九州通	7,554,864.00	2.01

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	00700	腾讯控股	44,290,773.47	11.80
2	03690	美团-W	31,740,372.18	8.45
3	09988	阿里巴巴-W	24,316,161.25	6.48
4	002335	科华数据	22,838,362.99	6.08
5	00981	中芯国际	15,190,832.22	4.05
5	688981	中芯国际	5,142,986.05	1.37
6	300502	新易盛	19,548,431.80	5.21
7	600188	兖矿能源	12,207,854.75	3.25
7	01171	兖矿能源	6,136,551.44	1.63
8	601168	西部矿业	17,833,370.10	4.75
9	01810	小米集团-W	17,692,109.94	4.71
10	300972	万辰集团	17,122,871.60	4.56
11	600941	中国移动	11,434,077.05	3.05
11	00941	中国移动	5,612,336.63	1.49
12	000729	燕京啤酒	16,760,945.00	4.46
13	01177	中国生物制药	15,983,242.67	4.26
14	09868	小鹏汽车-W	15,737,220.28	4.19
15	002487	大金重工	15,730,937.00	4.19
16	601901	方正证券	15,444,025.00	4.11
17	601319	中国人保	10,449,126.00	2.78
17	01339	中国人民保险集团	4,600,742.81	1.23
18	601138	工业富联	14,678,519.00	3.91
19	600873	梅花生物	14,482,460.34	3.86
20	002624	完美世界	14,390,321.00	3.83
21	600428	中远海特	14,381,914.00	3.83
22	00763	中兴通讯	7,517,554.84	2.00
22	000063	中兴通讯	6,537,113.00	1.74
23	300395	菲利华	13,635,331.00	3.63
24	002847	盐津铺子	13,613,658.20	3.63
25	00285	比亚迪电子	13,522,922.93	3.60
26	601208	东材科技	13,513,619.00	3.60

27	002463	沪电股份	13,375,423.40	3.56
28	002345	潮宏基	13,255,168.07	3.53
29	000600	建投能源	13,251,860.00	3.53
30	300014	亿纬锂能	12,910,873.00	3.44
31	600183	生益科技	12,862,420.00	3.43
32	688258	卓易信息	12,854,976.59	3.42
33	601899	紫金矿业	11,031,774.00	2.94
33	02899	紫金矿业	1,675,198.75	0.45
34	300476	胜宏科技	12,669,032.34	3.37
35	002080	中材科技	12,607,648.30	3.36
36	600901	江苏金租	12,606,634.00	3.36
37	000893	亚钾国际	12,595,231.00	3.35
38	09858	优然牧业	12,529,915.10	3.34
39	600064	南京高科	12,369,168.60	3.29
40	002414	高德红外	12,274,886.00	3.27
41	601857	中国石油	6,214,452.00	1.66
41	00857	中国石油股份	6,050,105.73	1.61
42	688041	海光信息	12,248,591.84	3.26
43	601988	中国银行	12,179,292.00	3.24
44	300850	新强联	12,094,041.40	3.22
45	000726	鲁泰 A	11,962,705.00	3.19
46	601998	中信银行	9,585,456.81	2.55
46	00998	中信银行	2,352,794.47	0.63
47	601601	中国太保	6,896,239.00	1.84
47	02601	中国太保	5,041,540.14	1.34
48	600795	国电电力	11,913,039.00	3.17
49	688182	灿勤科技	11,854,617.40	3.16
50	601991	大唐发电	7,191,691.00	1.92
50	00991	大唐发电	4,632,497.09	1.23
51	01024	快手-W	11,755,308.25	3.13
52	600219	南山铝业	11,715,796.00	3.12
53	600060	海信视像	11,652,358.00	3.10
54	600282	南钢股份	11,602,520.00	3.09
55	600315	上海家化	11,566,444.00	3.08
56	000988	华工科技	11,341,590.48	3.02
57	605117	德业股份	11,291,767.30	3.01
58	601579	会稽山	11,210,314.00	2.99
59	603225	新凤鸣	11,171,769.00	2.98
60	601336	新华保险	7,471,518.00	1.99
60	01336	新华保险	3,635,348.56	0.97
61	600011	华能国际	7,818,136.00	2.08
61	00902	华能国际电力 股份	3,275,172.94	0.87
62	688629	华丰科技	11,073,960.57	2.95

63	600176	中国巨石	10,950,583.80	2.92
64	601939	建设银行	9,323,000.00	2.48
64	00939	建设银行	1,578,326.19	0.42
65	300363	博腾股份	10,785,088.00	2.87
66	300750	宁德时代	10,780,157.00	2.87
67	688668	鼎通科技	10,749,721.67	2.86
68	600866	星湖科技	10,735,987.00	2.86
69	300308	中际旭创	10,728,653.89	2.86
70	000596	古井贡酒	10,701,496.00	2.85
71	600292	远达环保	10,694,339.00	2.85
72	09969	诺诚健华	5,342,313.49	1.42
72	688428	诺诚健华	5,341,287.68	1.42
73	300777	中简科技	10,674,829.00	2.84
74	605305	中际联合	10,585,807.00	2.82
75	02628	中国人寿	5,696,553.11	1.52
75	601628	中国人寿	4,823,153.00	1.28
76	688313	仕佳光子	10,433,641.20	2.78
77	300731	科创新源	10,410,658.00	2.77
78	600761	安徽合力	10,278,311.00	2.74
79	601088	中国神华	9,088,392.00	2.42
79	01088	中国神华	1,122,864.50	0.30
80	603659	璞泰来	10,169,992.69	2.71
81	300207	欣旺达	10,136,222.00	2.70
82	01787	山东黄金	6,585,240.43	1.75
82	600547	山东黄金	3,516,421.00	0.94
83	600938	中国海油	5,482,984.00	1.46
83	00883	中国海洋石油	4,616,445.86	1.23
84	600875	东方电气	9,007,488.99	2.40
84	01072	东方电气	1,074,089.87	0.29
85	002284	亚太股份	10,069,045.00	2.68
86	688183	生益电子	10,022,114.76	2.67
87	600027	华电国际	7,280,025.00	1.94
87	01071	华电国际电力 股份	2,735,765.89	0.73
88	300723	一品红	9,961,402.00	2.65
89	601328	交通银行	9,898,107.00	2.64
90	600166	福田汽车	9,892,709.00	2.63
91	603993	洛阳钼业	7,540,451.00	2.01
91	03993	洛阳钼业	2,343,829.33	0.62
92	002838	道恩股份	9,789,186.45	2.61
93	688578	艾力斯	9,787,582.39	2.61
94	601169	北京银行	9,752,253.00	2.60
95	600395	盘江股份	9,687,645.00	2.58
96	600499	科达制造	9,651,939.00	2.57

97	300738	奥飞数据	9,501,196.00	2.53
98	000783	长江证券	9,496,746.00	2.53
99	002706	良信股份	9,470,629.00	2.52
100	600348	华阳股份	9,464,600.40	2.52
101	000902	新洋丰	9,392,486.00	2.50
102	688123	聚辰股份	9,370,240.32	2.50
103	688550	瑞联新材	9,325,049.16	2.48
104	002851	麦格米特	9,321,428.00	2.48
105	01801	信达生物	9,313,404.83	2.48
106	600039	四川路桥	9,302,801.00	2.48
107	01211	比亚迪股份	6,096,159.91	1.62
107	002594	比亚迪	3,136,327.00	0.84
108	603566	普莱柯	9,112,907.00	2.43
109	300570	太辰光	9,112,747.00	2.43
110	600585	海螺水泥	9,105,348.00	2.43
111	688382	益方生物	9,070,672.68	2.42
112	600909	华安证券	9,058,524.00	2.41
113	601229	上海银行	9,054,537.88	2.41
114	600801	华新建材	6,048,002.00	1.61
114	06655	华新建材	3,002,103.44	0.80
115	601107	四川成渝	9,036,772.27	2.41
116	000425	徐工机械	9,004,208.73	2.40
117	002281	光迅科技	8,944,331.79	2.38
118	688531	日联科技	8,937,149.51	2.38
119	301280	珠城科技	8,935,794.60	2.38
120	002913	奥士康	8,929,673.00	2.38
121	688002	睿创微纳	8,927,852.28	2.38
122	603296	华勤技术	8,873,947.60	2.36
123	600276	恒瑞医药	7,800,853.00	2.08
123	01276	恒瑞医药	1,009,269.64	0.27
124	600673	东阳光	8,801,133.00	2.34
125	002568	百润股份	8,788,794.60	2.34
126	002626	金达威	8,761,037.00	2.33
127	603986	兆易创新	8,708,191.00	2.32
128	600861	北京人力	8,687,812.00	2.31
129	301210	金杨精密	8,676,632.44	2.31
130	002233	塔牌集团	8,666,317.00	2.31
131	000568	泸州老窖	8,628,634.00	2.30
132	600273	嘉化能源	8,593,318.00	2.29
133	002991	甘源食品	8,590,546.00	2.29
134	301510	固高科技	8,576,731.00	2.28
135	002170	芭田股份	8,576,303.00	2.28
136	01164	中广核矿业	8,567,110.54	2.28

137	000938	紫光股份	8,520,221.00	2.27
138	01093	石药集团	8,519,139.40	2.27
139	09992	泡泡玛特	8,503,955.31	2.26
140	002384	东山精密	8,501,805.00	2.26
141	300765	新诺威	8,478,104.80	2.26
142	603267	鸿远电子	8,452,177.00	2.25
143	000975	山金国际	8,433,646.00	2.25
144	300119	瑞普生物	8,430,013.00	2.25
145	000983	山西焦煤	8,416,559.00	2.24
146	09896	名创优品	8,405,783.39	2.24
147	300454	深信服	8,405,541.60	2.24
148	002299	圣农发展	8,388,537.00	2.23
149	600710	苏美达	8,365,750.00	2.23
150	601288	农业银行	8,350,648.00	2.22
151	01686	新意网集团	8,348,004.42	2.22
152	600109	国金证券	8,282,284.00	2.21
153	002736	国信证券	8,266,425.00	2.20
154	605208	永茂泰	8,261,392.60	2.20
155	688256	寒武纪	8,236,827.27	2.19
156	002027	分众传媒	8,224,006.00	2.19
157	603300	海南华铁	8,178,351.88	2.18
158	601009	南京银行	8,165,264.58	2.17
159	300624	万兴科技	8,135,198.00	2.17
160	300369	绿盟科技	8,133,219.00	2.17
161	002558	巨人网络	8,100,749.00	2.16
162	601225	陕西煤业	8,096,125.00	2.16
163	603766	隆鑫通用	8,065,932.00	2.15
164	601231	环旭电子	8,044,450.00	2.14
165	603816	顾家家居	8,018,861.62	2.14
166	601665	齐鲁银行	8,005,808.00	2.13
167	002517	恺英网络	7,999,364.00	2.13
168	601006	大秦铁路	7,997,916.00	2.13
169	01415	高伟电子	7,988,905.47	2.13
170	600266	城建发展	7,936,012.00	2.11
171	600073	光明肉业	7,897,911.75	2.10
172	688266	泽璟制药	7,863,729.22	2.09
173	605599	菜百股份	7,859,856.00	2.09
174	600461	洪城环境	7,855,597.00	2.09
175	688676	金盘科技	7,845,658.70	2.09
176	300602	飞荣达	7,812,713.00	2.08
177	600096	云天化	7,797,233.00	2.08
178	603228	景旺电子	7,795,242.00	2.08
179	02328	中国财险	7,793,366.22	2.08

180	600998	九州通	7,776,097.03	2.07
181	000878	云南铜业	7,744,004.00	2.06
182	600378	昊华科技	7,742,696.00	2.06
183	002202	金风科技	5,734,048.74	1.53
183	02208	金风科技	1,995,069.20	0.53
184	688196	卓越新能	7,722,388.49	2.06
185	600887	伊利股份	7,721,366.00	2.06
186	601688	华泰证券	7,720,148.00	2.06
187	301367	瑞迈特	7,714,503.45	2.05
188	603565	中谷物流	7,705,100.00	2.05
189	002895	川恒股份	7,659,813.00	2.04
190	600489	中金黄金	7,649,724.00	2.04
191	002434	万里扬	7,621,200.00	2.03
192	300638	广和通	7,619,979.00	2.03
193	300443	金雷股份	7,601,721.00	2.02
194	603918	金桥信息	7,593,175.00	2.02
195	601126	四方股份	7,576,209.00	2.02
196	000915	华特达因	7,545,806.00	2.01

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	7,462,747,090.53
卖出股票收入（成交）总额	7,464,201,793.91

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	8,048,241.10	1.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,048,241.10	1.63

## 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	019785	25 国债 13	80,000	8,048,241.10	1.63

## 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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 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	183,784.39
2	应收清算款	4,000,503.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	103,448.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,287,736.53

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
中欧量化驱动混合 A	27,997	10,975.46	207,822,751.28	67.63%	99,457,115.59	32.37%
中欧量化驱动混合 C	90	353,655.48	31,455,895.96	98.83%	373,097.48	1.17%
合计	28,087	12,073.52	239,278,647.24	70.56%	99,830,213.07	29.44%

### 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	中欧量化驱动混合 A	35,161.80	0.01%
	中欧量化驱动混合 C	0.00	0.00%
	合计	35,161.80	0.01%

## 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	中欧量化驱动混合 A	0
	中欧量化驱动混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化驱动混合 A	0
	中欧量化驱动混合 C	0
	合计	0

## 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	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
基金合同生效日 (2018年5月16日) 基金份额总额	244,633,211.97	-
本报告期期初基金份额总额	309,949,872.18	14,799,253.98
本报告期基金总申购份额	223,991,436.76	78,959,792.03
减：本报告期基金总赎回份额	226,661,442.07	61,930,052.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	307,279,866.87	31,828,993.44

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 06 月 10 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券基金经营机构信息技术管理办法》
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

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
浙商证券	1	2,212,385,570.19	14.83	1,003,282.28	15.17	-
民生证券	2	1,622,327,280.04	10.87	718,170.67	10.86	-
华福证券	1	1,619,880,376.65	10.86	729,174.40	11.03	-
华源证券	1	1,619,433,990.31	10.85	705,923.37	10.67	-
东方财富	1	1,115,346,208.47	7.47	486,190.98	7.35	-
中泰证券	2	727,638,011.83	4.88	317,187.61	4.80	-
国海证券	1	723,965,534.81	4.85	320,469.70	4.85	-
华创证券	2	697,878,715.73	4.68	304,210.81	4.60	-
天风证券	1	625,337,371.61	4.19	272,576.87	4.12	-
中金公司	1	513,198,622.09	3.44	223,706.21	3.38	本报告期新增1个
国金证券	1	493,665,870.39	3.31	215,190.19	3.25	-
国盛证券	1	389,800,348.81	2.61	169,922.46	2.57	-
兴业证券	1	372,214,170.	2.49	162,290.77	2.45	-

		88				
东方证券	1	336,280,047.69	2.25	159,371.86	2.41	-
华泰证券	1	218,589,790.85	1.46	95,285.17	1.44	-
东吴证券	1	201,347,903.76	1.35	87,769.28	1.33	-
财通证券	1	193,656,362.48	1.30	91,913.76	1.39	-
中信证券	4	172,644,004.43	1.16	75,823.45	1.15	本报告期新增2个
国信证券	1	170,526,348.45	1.14	74,336.91	1.12	-
广发证券	1	169,148,298.60	1.13	73,741.45	1.12	-
西南证券	1	165,497,621.29	1.11	72,141.23	1.09	-
开源证券	1	142,758,534.66	0.96	71,379.24	1.08	-
国都证券	2	128,339,178.13	0.86	55,942.18	0.85	-
申万宏源证券	1	126,315,911.37	0.85	55,064.22	0.83	-
中信建投	1	108,156,193.66	0.72	47,144.75	0.71	-
长江证券	1	55,962,084.54	0.38	24,864.10	0.38	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	本报告期新增1个
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增1个

平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	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，国泰君安证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

### 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 (%)
浙商证券	-	-	63,540,000.00	22.34	-	-
民生证券	-	-	20,000,000.00	7.03	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	1,640,000.00	0.58	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	8,022,622.47	100.00	25,240,000.00	8.87	-	-
天风证券	-	-	64,000,000.00	22.50	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	34,000,000.0 0	11.95	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	76,000,000.0 0	26.72	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 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。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券，国泰君安证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	中欧量化驱动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	2025-01-22
3	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	2025-01-22
4	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
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别份额转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-24
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	中欧量化驱动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金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
10	中欧量化驱动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	中欧量化驱动混合型证券投资基金基	中国证监会指定媒介	2025-06-03

	金产品资料概要更新		
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
15	中欧量化驱动混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 7 月）	中国证监会指定媒介	2025-07-08
16	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
17	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
18	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
19	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
20	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	2025-10-18
21	中欧量化驱动混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-10-28
22	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-10-28

## § 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

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 01 日至 2025 年 01 月 13 日;2025 年 07 月 09 日至 2025 年 07 月 09 日	73,091,107.09	0.00	73,091,107.09	0.00	0.00%
	2	2025 年 06 月	0.00	88,411,0	0.00	88,411,005.87	26.07%

		13 日至 2025 年 11 月 04 日;2025 年 11 月 11 日至 2025 年 12 月 31 日		05.87			%
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。

## 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

2026 年 3 月 31 日