

中欧金安量化混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	71

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.12 投资组合报告附注	72
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 盈利投资者数量占比	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.4 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	73
§ 9 开放式基金份额变动	74
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	75
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧金安量化混合型证券投资基金	
基金简称	中欧金安量化混合	
基金主代码	014135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 20 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国金证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	779,284,394.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
下属分级基金的交 易代码	014135	014136
报告期末下属分级 基金的份额总额	572,112,559.32 份	207,171,835.00 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	国金证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	陈俐洁
	联系电话	021-68609600	021-20527198-15217
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	chenlj@gjzq.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95310
传真		021-50190017	028-86690353

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	
据和指标	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
本期已实现收益	82,820,411.41	46,280,568.68
本期利润	108,070,135.13	35,844,973.99
加权平均基金份额本期利润	0.1731	0.1016
本期加权平均净值利润率	11.74%	7.12%
本期基金份额净值增长率	16.34%	15.90%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
据和指标		
期末可供分配利润	261,649,500.31	84,226,852.34
期末可供分配基金份额利润	0.4573	0.4066

期末基金资产净值	888,809,540.06	310,667,909.41
期末基金份额净值	1.5536	1.4996
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	55.36%	49.96%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧金安量化混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.96%	1.34%	16.10%	1.51%	-4.14%	-0.17%
过去六个月	16.34%	1.41%	17.91%	1.53%	-1.57%	-0.12%
过去一年	45.54%	1.19%	46.05%	1.32%	-0.51%	-0.13%
过去三年	68.70%	1.33%	46.44%	1.38%	22.26%	-0.05%
自基金合同生效起至今	55.36%	1.26%	25.04%	1.31%	30.32%	-0.05%

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

中欧金安量化混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.73%	1.34%	16.10%	1.51%	-4.37%	-0.17%

过去六个月	15.90%	1.41%	17.91%	1.53%	-2.01%	-0.12%
过去一年	44.40%	1.19%	46.05%	1.32%	-1.65%	-0.13%
过去三年	64.72%	1.33%	46.44%	1.38%	18.28%	-0.05%
自基金合同生效起 至今	49.96%	1.26%	25.04%	1.31%	24.92%	-0.05%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





§ 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 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 / 基金经理助理	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。
徐熙宁	基金经理 / 基金经理助理	2026-03-09	—	3 年	2022-07-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
曲径	量化投决会主席 /	2022-01-20	—	19 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

	权益专户 投决会委员 / 量化 投资总监 / 基金 经理 / 投资 经理				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。
宋婷	量化投决 会委员 / 基金经理	2025-04- 02	-	8 年	历任上海千象资产管理有限公司股票研究员、股票投资经理。2023-07-03 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理；徐熙宁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	8,872,023,940.32	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,765,704,406.80	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	10,637,728,347.12	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济在温和通胀、政策积极支持的背景下平稳运行，呈现外需相对稳定、内需逐步恢复、新动能表现较好的特点，并在二季度进一步确认了温和复苏的方向，海外则始终笼罩在不确定性之中，美伊冲突推升油价与美联储货币政策转鹰成为贯穿全程的两条外部压制线索，而国内层面 3 月 PPI 同比 41 个月来首次转正、企业盈利拐点显现；行业层面，年初能源与资源板块成为亮点，但 5 月以来随大宗价格高位回落而明显调整，电子、通信为代表的“新质生产力”持续领涨，消费板块则全程偏弱。因子表现方面，今年以来表现突出的因子中，动量与 Beta 表现最为强劲，说明市场呈现显著的趋势行情，资金积极追逐高弹性资产。同时，成长性因子表现亮眼。相对而言，基本面质量与价值因子表现承压。投资质量、短期反转及盈利质量的表现偏弱，说明市场对传统防御性质量因子并不买账，市场呈现出极强的动量延续效应。

本基金是以中证 500 指数为主要基准权重指数的量化基金，对标基准保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中盘平衡风格。本基金的选股策略是基于交易所深度行情和上市公司基本面等信息，应用数量化的投资方法，系统性地捕捉市场的非有效性，力争获取相对基准的超额收益。展望 2026 年，在经济温和复苏与政策支撑并存的背景下，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，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。

4.4.2 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 16.34%，同期业绩比较基准收益率为 17.91%；基金 C 类份额净值增长率为 15.90%，同期业绩比较基准收益率为 17.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对中国主要股指持积极看多的判断，主要逻辑有三：其一，随着“反内卷”政策引导与供给自然出清逐见成效，资本开支增速下行，部分行业供需格局已显著改善，A 股有望

从流动性驱动转向业绩驱动，行情或得以延续；其二，估值仍有空间，横向折价充分。当前 A 股相较美股、韩股显著折价，与欧日大体接近，性价比突出；其三，《关于推动中长期资金入市工作的实施方案》落地，保险、社保、年金等长期资金加大入市力度，三年长周期考核引导“长钱长投”，资金端的制度红利将持续释放。

基金将坚持稳健的原则，通过基本面因子与量价因子的特征规律挖掘，平衡组合在高波动环境下的风险暴露。同时，密切关注宏观经济走势、政策导向落地节奏以及行业供需格局变化，把握结构性的投资机会；严格控制组合风险暴露，借助基本面与量价因子的负相关性，力争实现超额收益的平稳性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守法律法规的规定、基金合同和托管协议（如有）的有关约定，诚信、尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	58,755,733.24	64,502,230.10
结算备付金		3,193,394.81	5,947,804.06
存出保证金		1,928,491.20	3,005,572.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,168,636,208.30	695,120,683.74
其中：股票投资		1,112,388,626.99	687,072,442.64
基金投资		-	-
债券投资		56,247,581.31	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1, 042, 806. 94	3, 199, 386. 15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 5	-	-
资产总计		1, 233, 556, 634. 49	771, 775, 676. 85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		29, 996, 030. 71	6, 501, 507. 38
应付清算款		-	-
应付赎回款		2, 287, 408. 03	5, 311, 892. 27
应付管理人报酬		1, 237, 337. 88	692, 922. 37
应付托管费		206, 223. 00	115, 487. 08
应付销售服务费		236, 355. 74	107, 024. 29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		943. 49	22, 089. 83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 6	114, 886. 17	57, 809. 46
负债合计		34, 079, 185. 02	12, 808, 732. 68
净资产:			
实收基金	6. 4. 7. 7	779, 284, 394. 32	572, 241, 957. 68
未分配利润	6. 4. 7. 8	420, 193, 055. 15	186, 724, 986. 49
净资产合计		1, 199, 477, 449. 47	758, 966, 944. 17
负债和净资产总计		1, 233, 556, 634. 49	771, 775, 676. 85

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 779, 284, 394. 32 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1. 5536 元，基金份额总额 572, 112, 559. 32 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1. 4996 元，基金份额总额 207, 171, 835. 00 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年
-----	-----	------------------------------	-----------------------------------

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、营业总收入		156,059,400.21	59,018,477.76
1. 利息收入		74,943.31	38,595.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	74,943.31	38,595.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		138,149,613.08	28,585,969.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	125,773,865.88	23,512,070.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	408,215.45	23,430.14
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	3,111,093.35	429,120.28
股利收益	6.4.7.14	8,856,438.40	4,621,348.55
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	14,814,129.03	30,238,289.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,020,714.79	155,623.41
减：二、营业总支出		12,144,291.09	3,354,498.77
1. 管理人报酬		8,457,155.36	2,617,293.33
2. 托管费		1,409,525.92	436,215.54
3. 销售服务费		1,986,331.00	206,033.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		185,008.02	-
其中：卖出回购金融资产支出		185,008.02	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		12,768.23	1,550.24
8. 其他费用	6.4.7.18	93,502.56	93,406.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		143,915,109.12	55,663,978.99
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		143,915,109.12	55,663,978.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		143,915,109.12	55,663,978.99

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	572,241,957.68	-	186,724,986.49	758,966,944.17
二、本期期初净资产	572,241,957.68	-	186,724,986.49	758,966,944.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	207,042,436.64	-	233,468,068.66	440,510,505.30
（一）、综合收益总额	-	-	143,915,109.12	143,915,109.12
（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）	207,042,436.64	-	89,552,959.54	296,595,396.18
其中：1. 基金申购款	1,268,648,453.21	-	563,947,490.23	1,832,595,943.44
2. 基金赎回款	-1,061,606,016.57	-	-474,394,530.69	-1,536,000,547.26
（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	779,284,394.32	-	420,193,055.15	1,199,477,449.47
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	515,361,631.96	-	-31,702,696.10	483,658,935.86
二、本期期初净资产	515,361,631.96	-	-31,702,696.10	483,658,935.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-156,880,844.50	-	54,552,832.26	-102,328,012.24
(一)、综合收益总额	-	-	55,663,978.99	55,663,978.99
(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)	-156,880,844.50	-	-1,111,146.73	-157,991,991.23
其中：1. 基金申购款	59,838,977.79	-	-1,651,077.18	58,187,900.61
2. 基金赎回款	-216,719,822.29	-	539,930.45	-216,179,891.84
(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	358,480,787.46	-	22,850,136.16	381,330,923.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧金安量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3328 号文《关于准予中欧金安量化混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期

限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,032,691,612.76 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,032,840,253.50 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 148,640.74 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 893,269,013.78 份，包含认购利息折合 133,841.80 份；C 类基金的基金份额总额为 139,571,239.72 份，包含认购利息折合 14,798.94 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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；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。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》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《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《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《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

本基金运作过程中如有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《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《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	619,709.26
等于：本金	618,973.60
加：应计利息	735.66
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	58,136,023.98
等于：本金	58,134,833.52
加：应计利息	1,190.46
减：坏账准备	-
合计	58,755,733.24

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,086,688,054.73	-	1,112,388,626.99	25,700,572.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	55,641,275.05	623,711.31	56,247,581.31	-17,405.05
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	55,641,275.05	623,711.31	56,247,581.31	-17,405.05
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,142,329,329.78	623,711.31	1,168,636,208.30	25,683,167.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日		
		合同/名义 金额	公允价值	
			资产	负债
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,556,960.00	-	-	-
其中：股指期货	15,556,960.00	-	-	-

投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,556,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	9.00	16,070,760.00	513,800.00
合计				513,800.00
减：可抵销期货暂收款				513,800.00
净额				0.00

注：1. 衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,828.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	24,795.19
其他应付	26,755.37
合计	114,886.17

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	446,952,432.80	446,952,432.80
本期申购	636,312,267.79	636,312,267.79
本期赎回（以“-”号填列）	-511,152,141.27	-511,152,141.27
本期末	572,112,559.32	572,112,559.32

中欧金安量化混合 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	125,289,524.88	125,289,524.88
本期申购	632,336,185.42	632,336,185.42
本期赎回（以“-”号填列）	-550,453,875.30	-550,453,875.30
本期末	207,171,835.00	207,171,835.00

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	138,102,223.70	11,799,087.05	149,901,310.75
本期期初	138,102,223.70	11,799,087.05	149,901,310.75
本期利润	82,820,411.41	25,249,723.72	108,070,135.13
本期基金份额交易产生的变动数	40,726,865.20	17,998,669.66	58,725,534.86
其中：基金申购款	249,853,023.75	53,794,032.72	303,647,056.47
基金赎回款	-209,126,158.55	-35,795,363.06	-244,921,521.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	261,649,500.31	55,047,480.43	316,696,980.74

中欧金安量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,632,469.93	3,191,205.81	36,823,675.74
本期期初	33,632,469.93	3,191,205.81	36,823,675.74
本期利润	46,280,568.68	-10,435,594.69	35,844,973.99
本期基金份额交易产生的变动数	4,313,813.73	26,513,610.95	30,827,424.68
其中：基金申购款	211,844,909.26	48,455,524.50	260,300,433.76
基金赎回款	-207,531,095.53	-21,941,913.55	-229,473,009.08
本期已分配利润	-	-	-

本期末	84,226,852.34	19,269,222.07	103,496,074.41
-----	---------------	---------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,799.74
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	16,696.65
结算备付金利息收入	21,265.94
其他	23,180.98
合计	74,943.31

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,972,960,263.82
减：卖出股票成本总额	5,841,555,981.20
减：交易费用	5,630,416.74
买卖股票差价收入	125,773,865.88

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	413,451.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,235.95
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	408,215.45

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	38,276,401.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,926,098.95
减：应计利息总额	355,538.99

减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-5,235.95

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,111,093.35

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,856,438.40
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	8,856,438.40

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,128,499.29
股票投资	15,148,904.34
债券投资	-20,405.05
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-314,370.26
权证投资	-
期货投资	-314,370.26
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	14,814,129.03

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,998,089.52
基金转换费收入	22,625.27
合计	3,020,714.79

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
开户费	200.00
合计	93,502.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
国金证券股份有限公司（“国金证券”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国金证券	1,340.28	0.00	503,328.64	0.01

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国金证券	0.58	0.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国金证券	219.33	0.03	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,457,155.36	2,617,293.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,198,050.83	1,015,101.99
应支付基金管理人的净管理费	6,259,104.53	1,602,191.34

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,409,525.92	436,215.54

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券股份有限公司	0.00	9,299.51	9,299.51
中欧财富	0.00	3,690.03	3,690.03
中欧基金	0.00	857,348.24	857,348.24
合计	0.00	870,337.78	870,337.78
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		

方名称	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券股份有限公司	0.00	13,810.51	13,810.51
中欧财富	0.00	2,007.42	2,007.42
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	15,817.93	15,817.93

注：本基金 A 基金份额不收取销售服务费，本基金 C 基金份额的年销售服务费费率为 0.80%。计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧金安量化混合 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	35, 532. 34	0. 02%	—	—

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 A 类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国金证券股份有限公司	619, 709. 26	13, 807. 29	2, 483, 905. 35	17, 239. 04

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1, 596. 00	1, 583. 46	—
001237	惠康	2026 年 5 月	6 个月	新股流通	53.26	58.74	285	15, 179. 10	16, 740. 90	—

	科技	月 15 日		受限						
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	41,054	415,055.94	415,055.94	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	17,594	177,875.34	177,875.34	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	11.18	17.59	731	8,172.58	12,858.29	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	11,300	104,545.89	102,265.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 29,996,030.71 元，于 2026 年 7 月 1 日、2 日和 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	58,755,733.24	-	-	-	58,755,733.24
结算备付金	3,193,394.81	-	-	-	3,193,394.81
存出保证金	-	-	-	1,928,491.20	1,928,491.20
交易性金融资产	56,247,581.31	-	-	1,112,388,626.99	1,168,636,208.30
应收申购款	-	-	-	1,042,806.94	1,042,806.94
资产总计	118,196,709.36	-	-	1,115,359,925.13	1,233,556,634.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,287,408.03	2,287,408.03
应付管理人报酬	-	-	-	1,237,337.88	1,237,337.88
应付托管费	-	-	-	206,223.00	206,223.00
卖出回购金融资产款	29,996,030.71	-	-	-	29,996,030.71
应付销售服务费	-	-	-	236,355.74	236,355.74
应交税费	-	-	-	943.49	943.49
其他负债	-	-	-	114,886.17	114,886.17
负债总计	29,996,030.71	-	-	4,083,154.31	34,079,185.02
利率敏感度缺口	88,200,678.65	-	-	1,111,276,770.82	1,199,477,449.47
上年度末 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	64,502,230.10	-	-	-	64,502,230.10
结算备付金	5,947,804.06	-	-	-	5,947,804.06
存出保证金	-	-	-	3,005,572.80	3,005,572.80
交易性金融资产	8,048,241.10	-	-	687,072,442.64	695,120,683.74
应收申购款	-	-	-	3,199,386.15	3,199,386.15
资产总计	78,498,275.26	-	-	693,277,401.59	771,775,676.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,311,892.27	5,311,892.27
应付管理人报酬	-	-	-	692,922.37	692,922.37
应付托管费	-	-	-	115,487.08	115,487.08
卖出回购金融资产款	6,501,507.38	-	-	-	6,501,507.38
应付销售服务费	-	-	-	107,024.29	107,024.29
应交税费	-	-	-	22,089.83	22,089.83
其他负债	-	-	-	57,809.46	57,809.46
负债总计	6,501,507.38	-	-	6,307,225.30	12,808,732.68
利率敏感度缺口	71,996,767.88	-	-	686,970,176.29	758,966,944.17

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 4.69%（2025 年 12 月 31 日：1.06%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,112,388,626.99	92.74	687,072,442.64	90.53
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	1,112,388,626.99	92.74	687,072,442.64	90.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	53,124,518.69	31,352,820.34
	业绩比较基准下降 5%	-53,124,518.69	-31,352,820.34

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,109,512,866.98	685,717,790.25
第二层次	56,942,777.59	8,048,241.10
第三层次	2,180,563.73	1,354,652.39
合计	1,168,636,208.30	695,120,683.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,112,388,626.99	90.18
	其中：股票	1,112,388,626.99	90.18
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	56,247,581.31	4.56
	其中：债券	56,247,581.31	4.56
	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	61,949,128.05	5.02
8	其他各项资产	2,971,298.14	0.24
9	合计	1,233,556,634.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,450,428.10	0.20
B	采矿业	35,720,757.42	2.98
C	制造业	839,983,428.34	70.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供	28,467,665.28	2.37

	应业		
E	建筑业	3,009,606.64	0.25
F	批发和零售业	25,030,136.32	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	7,955,963.66	0.66
H	住宿和餐饮业	526,351.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,220,545.43	5.02
J	金融业	58,413,154.95	4.87
K	房地产业	6,669,582.00	0.56
L	租赁和商务服务业	6,668,916.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	17,372,204.33	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	16,234,046.52	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	6,200.00	0.00
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	955,149.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	2,688,372.00	0.22
S	综合	16,120.00	0.00
	合计	1,112,388,626.99	92.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	9,349	17,632,214.00	1.47
2	001309	德明利	14,400	13,577,760.00	1.13
3	002008	大族激光	82,200	12,339,042.00	1.03
4	300604	长川科技	36,100	12,325,262.00	1.03
5	300857	协创数据	35,560	12,086,844.00	1.01
6	688347	华虹宏力	34,447	11,584,526.10	0.97
7	300475	香农芯创	36,000	10,800,000.00	0.90
8	601688	华泰证券	513,800	10,594,556.00	0.88
9	002281	光迅科技	39,000	10,020,660.00	0.84
10	300223	北京君正	39,500	9,831,550.00	0.82
11	600999	招商证券	415,500	8,767,050.00	0.73
12	688361	中科飞测	18,903	8,128,290.00	0.68
13	600105	永鼎股份	118,000	7,962,640.00	0.66
14	300136	信维通信	63,900	7,620,075.00	0.64
15	600886	国投电力	536,400	7,139,484.00	0.60
16	002273	水晶光电	198,400	7,039,232.00	0.59
17	002436	兴森科技	134,700	6,862,965.00	0.57
18	300285	国瓷材料	66,400	6,851,152.00	0.57

19	688120	华海清科	20,593	6,634,652.74	0.55
20	002851	麦格米特	37,200	6,219,096.00	0.52
21	000060	中金岭南	811,200	6,140,784.00	0.51
22	688777	中控技术	51,082	6,002,135.00	0.50
23	605088	冠盛股份	208,300	5,869,894.00	0.49
24	300054	鼎龙股份	54,800	5,807,156.00	0.48
25	301526	国际复材	122,400	5,712,408.00	0.48
26	300548	长芯博创	20,500	5,699,000.00	0.48
27	000776	广发证券	242,900	5,683,860.00	0.47
28	300390	天华新能	60,030	5,613,405.30	0.47
29	300666	江丰电子	15,000	5,529,000.00	0.46
30	603345	安井食品	68,600	5,501,034.00	0.46
31	300757	罗博特科	8,886	5,500,434.00	0.46
32	300373	扬杰科技	34,400	5,408,712.00	0.45
33	002299	圣农发展	339,100	5,140,756.00	0.43
34	000938	紫光股份	176,700	5,099,562.00	0.43
35	601211	国泰海通	273,500	4,977,700.00	0.41
36	002266	浙富控股	974,200	4,929,452.00	0.41
37	300395	菲利华	35,500	4,747,415.00	0.40
38	600498	烽火通信	64,000	4,710,400.00	0.39
39	002738	中矿资源	79,000	4,660,210.00	0.39
40	603256	宏和科技	17,500	4,643,275.00	0.39
41	688037	芯源微	10,142	4,452,845.10	0.37
42	601168	西部矿业	163,800	4,445,532.00	0.37
43	601869	长飞光纤	8,100	4,421,790.00	0.37
44	002064	华峰化学	440,900	4,184,141.00	0.35
45	688220	翱捷科技	33,625	4,180,260.00	0.35
46	600601	方正科技	301,200	4,168,608.00	0.35
47	300567	精测电子	13,100	4,160,560.00	0.35
48	300073	当升科技	86,100	4,136,244.00	0.34
49	601766	中国中车	793,700	4,127,240.00	0.34
50	600926	杭州银行	284,200	4,106,690.00	0.34
51	600711	盛屯矿业	365,600	4,010,632.00	0.33
52	600030	中信证券	137,515	3,950,805.95	0.33
53	688002	睿创微纳	25,302	3,913,966.38	0.33
54	001389	广合科技	16,400	3,890,900.00	0.32
55	300058	蓝色光标	280,300	3,856,928.00	0.32
56	002126	银轮股份	76,300	3,799,740.00	0.32
57	601233	桐昆股份	175,100	3,790,915.00	0.32
58	688200	华峰测控	7,178	3,769,167.80	0.31
59	301391	卡莱特	65,500	3,740,050.00	0.31
60	002517	恺英网络	229,400	3,727,750.00	0.31
61	603179	新泉股份	75,000	3,723,750.00	0.31

62	600256	广汇能源	750,600	3,707,964.00	0.31
63	002465	海格通信	289,500	3,696,915.00	0.31
64	300748	金力永磁	119,700	3,692,745.00	0.31
65	300017	网宿科技	282,510	3,675,455.10	0.31
66	600352	浙江龙盛	302,000	3,657,220.00	0.30
67	688172	燕东微	43,585	3,646,321.10	0.30
68	688678	福立旺	150,455	3,636,497.35	0.30
69	605358	立昂微	46,300	3,592,880.00	0.30
70	301358	湖南裕能	47,300	3,588,651.00	0.30
71	300346	南大光电	38,600	3,576,290.00	0.30
72	300751	迈为股份	12,480	3,525,100.80	0.29
73	600988	赤峰黄金	132,600	3,490,032.00	0.29
74	001286	陕西能源	342,400	3,471,936.00	0.29
75	603225	新凤鸣	175,900	3,456,435.00	0.29
76	688313	仕佳光子	18,600	3,434,490.00	0.29
77	688226	威腾电气	80,156	3,433,081.48	0.29
78	300623	捷捷微电	76,200	3,428,238.00	0.29
79	002850	科达利	18,100	3,426,330.00	0.29
80	600482	XD 中国动	102,300	3,355,440.00	0.28
81	002053	云南能投	340,900	3,351,047.00	0.28
82	688469	芯联集成	315,082	3,343,020.02	0.28
83	002155	湖南黄金	136,400	3,255,868.00	0.27
84	600595	中孚实业	562,800	3,162,936.00	0.26
85	603659	璞泰来	109,300	3,162,049.00	0.26
86	600685	中船防务	123,900	3,152,016.00	0.26
87	688578	艾力斯	28,696	3,133,603.20	0.26
88	601665	齐鲁银行	542,400	3,129,648.00	0.26
89	600150	中国船舶	92,500	3,125,575.00	0.26
90	300620	光库科技	8,200	3,101,240.00	0.26
91	603173	福斯达	90,900	3,081,510.00	0.26
92	688702	盛科通信	7,748	3,021,642.52	0.25
93	002755	奥赛康	220,700	3,005,934.00	0.25
94	603920	世运电路	62,500	3,002,500.00	0.25
95	603588	高能环境	154,500	2,966,400.00	0.25
96	000967	盈峰环境	277,100	2,917,863.00	0.24
97	600955	维远股份	196,900	2,898,368.00	0.24
98	688382	益方生物	160,331	2,885,958.00	0.24
99	002286	保龄宝	348,500	2,875,125.00	0.24
100	300037	新宙邦	30,900	2,869,065.00	0.24
101	002488	金固股份	319,600	2,847,636.00	0.24
102	000155	川能动力	237,400	2,844,052.00	0.24
103	603308	应流股份	46,900	2,832,760.00	0.24
104	300424	航新科技	179,400	2,823,756.00	0.24

105	688202	美迪西	34,980	2,823,235.80	0.24
106	688180	君实生物	83,201	2,813,857.82	0.23
107	688387	信科移动	141,754	2,812,399.36	0.23
108	688689	银河微电	42,927	2,778,235.44	0.23
109	600019	宝钢股份	509,500	2,766,585.00	0.23
110	300432	富临精工	137,700	2,766,393.00	0.23
111	600801	华新建材	176,200	2,748,720.00	0.23
112	603507	振江股份	82,200	2,703,558.00	0.23
113	688275	万润新能	20,865	2,661,330.75	0.22
114	000960	锡业股份	61,500	2,625,435.00	0.22
115	600316	洪都航空	93,800	2,620,772.00	0.22
116	600919	江苏银行	240,300	2,590,434.00	0.22
117	301611	珂玛科技	14,300	2,575,001.00	0.21
118	301393	昊帆生物	39,700	2,571,369.00	0.21
119	603181	皇马科技	158,500	2,570,870.00	0.21
120	003031	中瓷电子	14,200	2,560,260.00	0.21
121	002271	东方雨虹	215,600	2,559,172.00	0.21
122	688099	晶晨股份	24,795	2,551,405.50	0.21
123	603198	迎驾贡酒	86,100	2,548,560.00	0.21
124	301377	鼎泰高科	4,600	2,534,140.00	0.21
125	000949	新乡化纤	397,000	2,516,980.00	0.21
126	688166	博瑞医药	71,611	2,507,101.11	0.21
127	600428	中远海特	316,000	2,467,960.00	0.21
128	300797	钢研纳克	184,700	2,449,122.00	0.20
129	000803	山高环能	353,900	2,399,442.00	0.20
130	002812	恩捷股份	35,700	2,388,687.00	0.20
131	600167	联美控股	425,400	2,377,986.00	0.20
132	002545	东方铁塔	146,500	2,376,230.00	0.20
133	600577	精达股份	240,900	2,356,002.00	0.20
134	002645	华宏科技	85,440	2,350,454.40	0.20
135	000957	中通客车	251,000	2,349,360.00	0.20
136	002602	世纪华通	166,200	2,343,420.00	0.20
137	000683	博源化工	404,500	2,329,920.00	0.19
138	603127	昭衍新药	60,900	2,327,598.00	0.19
139	300322	硕贝德	92,300	2,325,960.00	0.19
140	688411	海博思创	7,927	2,308,342.40	0.19
141	601858	中国科传	133,100	2,303,961.00	0.19
142	603915	国茂股份	162,100	2,300,199.00	0.19
143	002429	兆驰股份	220,200	2,287,878.00	0.19
144	600390	五矿资本	495,800	2,260,848.00	0.19
145	000059	华锦股份	600,800	2,253,000.00	0.19
146	002197	证通电子	389,800	2,237,452.00	0.19
147	300408	三环集团	13,400	2,236,460.00	0.19

148	600143	金发科技	144,500	2,232,525.00	0.19
149	000703	恒逸石化	164,500	2,232,265.00	0.19
150	688255	凯尔达	79,660	2,214,548.00	0.18
151	002290	禾盛新材	24,100	2,214,067.00	0.18
152	300115	长盈精密	78,600	2,196,084.00	0.18
153	000100	TCL 科技	376,900	2,193,558.00	0.18
154	002250	联化科技	159,600	2,181,732.00	0.18
155	002203	海亮股份	94,800	2,166,180.00	0.18
156	301200	大族数控	6,000	2,163,900.00	0.18
157	601061	中信金属	199,900	2,152,923.00	0.18
158	688416	恒烁股份	15,375	2,152,500.00	0.18
159	600884	杉杉股份	157,900	2,139,545.00	0.18
160	000951	中国重汽	109,043	2,127,428.93	0.18
161	688239	航宇科技	35,446	2,120,734.18	0.18
162	301321	翰博高新	47,900	2,114,785.00	0.18
163	002756	永兴材料	37,300	2,112,672.00	0.18
164	688110	东芯股份	10,356	2,109,517.20	0.18
165	605189	富春染织	174,300	2,100,315.00	0.18
166	603867	新化股份	62,500	2,093,125.00	0.17
167	300761	立华股份	127,400	2,090,634.00	0.17
168	301026	浩通科技	102,800	2,078,616.00	0.17
169	002432	九安医疗	29,400	2,077,992.00	0.17
170	300277	汽轮科技	136,300	2,049,952.00	0.17
171	688062	迈威生物	72,301	2,042,503.25	0.17
172	688683	莱尔科技	53,543	2,030,350.56	0.17
173	002832	比音勒芬	98,000	2,022,720.00	0.17
174	603638	艾迪精密	85,817	2,012,408.65	0.17
175	300871	回盛生物	90,800	2,003,048.00	0.17
176	603826	坤彩科技	78,300	2,001,348.00	0.17
177	301285	鸿日达	18,100	1,996,973.00	0.17
178	688257	新锐股份	19,422	1,979,101.80	0.16
179	603379	三美股份	26,000	1,973,140.00	0.16
180	688343	云天励飞	24,152	1,972,252.32	0.16
181	002443	金洲管道	206,800	1,970,804.00	0.16
182	688299	长阳科技	117,655	1,966,015.05	0.16
183	002056	横店东磁	64,300	1,959,864.00	0.16
184	688262	国芯科技	45,325	1,959,399.75	0.16
185	300480	光力科技	45,800	1,954,744.00	0.16
186	000831	中国稀土	35,200	1,953,248.00	0.16
187	688019	安集科技	5,744	1,949,858.24	0.16
188	001203	大中矿业	64,600	1,934,770.00	0.16
189	688199	久日新材	55,878	1,929,467.34	0.16
190	603156	养元饮品	39,300	1,928,451.00	0.16

191	300323	华灿光电	93,500	1,907,400.00	0.16
192	600497	驰宏锌锗	156,400	1,894,004.00	0.16
193	301085	亚康股份	31,200	1,891,032.00	0.16
194	600346	恒力石化	106,400	1,884,344.00	0.16
195	000878	云南铜业	116,300	1,846,844.00	0.15
196	603112	华翔股份	109,700	1,835,281.00	0.15
197	000039	中集集团	224,900	1,823,939.00	0.15
198	300207	欣旺达	95,500	1,813,545.00	0.15
199	300134	大富科技	206,700	1,767,285.00	0.15
200	600623	华谊集团	218,600	1,764,102.00	0.15
201	688378	奥来德	28,253	1,751,686.00	0.15
202	301246	宏源药业	65,000	1,748,500.00	0.15
203	002048	宁波华翔	75,900	1,745,700.00	0.15
204	300034	钢研高纳	101,800	1,744,852.00	0.15
205	688629	华丰科技	9,188	1,722,841.88	0.14
206	301096	百诚医药	29,800	1,704,262.00	0.14
207	301389	隆扬电子	19,600	1,701,084.00	0.14
208	300629	新劲刚	79,000	1,695,340.00	0.14
209	601058	赛轮轮胎	146,700	1,691,451.00	0.14
210	601677	明泰铝业	101,500	1,684,900.00	0.14
211	300953	震裕科技	12,580	1,681,946.00	0.14
212	688197	首药控股	50,266	1,679,387.06	0.14
213	605228	神通科技	124,900	1,677,407.00	0.14
214	300547	川环科技	50,100	1,672,839.00	0.14
215	688221	前沿生物	73,743	1,651,843.20	0.14
216	603197	保隆科技	59,100	1,651,254.00	0.14
217	601699	潞安环能	113,800	1,625,064.00	0.14
218	600246	万通发展	85,500	1,624,500.00	0.14
219	600475	华光环能	106,400	1,622,600.00	0.14
220	301626	苏州天脉	4,200	1,612,632.00	0.13
221	301149	隆华新材	151,100	1,598,638.00	0.13
222	688035	德邦科技	17,357	1,593,372.60	0.13
223	300404	博济医药	180,800	1,583,808.00	0.13
224	300759	康龙化成	54,600	1,579,578.00	0.13
225	600717	天津港	402,900	1,567,281.00	0.13
226	603228	景旺电子	21,600	1,564,056.00	0.13
227	600037	歌华有线	249,400	1,563,738.00	0.13
228	600499	科达制造	112,300	1,549,740.00	0.13
229	688052	纳芯微	5,320	1,533,809.20	0.13
230	301002	崧盛股份	39,700	1,532,420.00	0.13
231	600489	中金黄金	84,800	1,530,640.00	0.13
232	688379	华光新材	18,149	1,525,060.47	0.13
233	600409	三友化工	247,200	1,510,392.00	0.13

234	002493	荣盛石化	140,100	1,506,075.00	0.13
235	300919	中伟新材	34,300	1,500,625.00	0.13
236	301191	菲菱科思	13,120	1,489,776.00	0.12
237	300677	英科医疗	38,000	1,488,460.00	0.12
238	603615	茶花股份	91,800	1,482,570.00	0.12
239	688778	厦钨新能	27,006	1,469,126.40	0.12
240	688156	路德科技	48,214	1,458,473.50	0.12
241	603090	宏盛股份	28,400	1,450,104.00	0.12
242	300457	赢合科技	68,100	1,435,548.00	0.12
243	000893	亚钾国际	35,100	1,435,239.00	0.12
244	300236	上海新阳	10,900	1,433,350.00	0.12
245	600166	福田汽车	490,500	1,427,355.00	0.12
246	300755	华致酒行	124,400	1,416,916.00	0.12
247	001283	豪鹏科技	28,900	1,416,678.00	0.12
248	603400	华之杰	26,200	1,415,324.00	0.12
249	603926	铁流股份	79,800	1,411,662.00	0.12
250	300661	圣邦股份	9,800	1,406,104.00	0.12
251	300382	斯莱克	60,700	1,402,777.00	0.12
252	688365	光云科技	88,632	1,397,726.64	0.12
253	000543	皖能电力	184,100	1,393,637.00	0.12
254	002409	雅克科技	6,200	1,391,900.00	0.12
255	600027	华电国际	311,600	1,386,620.00	0.12
256	603939	益丰药房	77,100	1,386,258.00	0.12
257	688561	奇安信	57,723	1,384,197.54	0.12
258	000001	平安银行	136,400	1,370,820.00	0.11
259	000697	炼石航空	132,000	1,370,160.00	0.11
260	300049	福瑞医科	35,000	1,360,800.00	0.11
261	600188	兖矿能源	76,500	1,359,405.00	0.11
262	600189	泉阳泉	179,900	1,354,647.00	0.11
263	688700	东威科技	14,999	1,340,910.60	0.11
264	600201	生物股份	114,800	1,337,420.00	0.11
265	688676	金盘科技	15,726	1,331,048.64	0.11
266	001313	粤海饲料	186,300	1,320,867.00	0.11
267	002683	广东宏大	44,600	1,306,334.00	0.11
268	688385	复旦微电	18,246	1,300,757.34	0.11
269	688449	联芸科技	15,054	1,299,310.74	0.11
270	300590	移为通信	90,500	1,298,675.00	0.11
271	300473	德尔股份	41,900	1,273,760.00	0.11
272	000045	深纺织 A	120,100	1,265,854.00	0.11
273	688234	天岳先进	7,286	1,264,193.86	0.11
274	601788	光大证券	87,600	1,264,068.00	0.11
275	300363	博腾股份	77,700	1,261,848.00	0.11
276	000036	华联控股	288,200	1,259,434.00	0.10

277	000626	远大控股	196,700	1,245,111.00	0.10
278	300128	锦富技术	210,200	1,244,384.00	0.10
279	000034	神州数码	44,660	1,239,315.00	0.10
280	600336	澳柯玛	197,600	1,231,048.00	0.10
281	003022	联泓新科	47,500	1,230,250.00	0.10
282	002487	大金重工	21,200	1,228,964.00	0.10
283	688108	赛诺医疗	65,744	1,218,236.32	0.10
284	002179	中航光电	26,300	1,215,060.00	0.10
285	600549	厦门钨业	14,200	1,209,840.00	0.10
286	600418	江淮汽车	46,800	1,208,844.00	0.10
287	600985	淮北矿业	85,400	1,199,870.00	0.10
288	300570	太辰光	4,800	1,184,208.00	0.10
289	600885	宏发股份	34,200	1,179,558.00	0.10
290	688605	先锋精科	11,314	1,176,882.28	0.10
291	300681	英搏尔	41,000	1,173,420.00	0.10
292	002593	日上集团	293,300	1,170,267.00	0.10
293	688291	金橙子	19,860	1,161,412.80	0.10
294	603958	哈森股份	68,400	1,158,696.00	0.10
295	600115	中国东航	303,500	1,156,335.00	0.10
296	002246	北化股份	61,500	1,156,200.00	0.10
297	300249	依米康	75,000	1,155,000.00	0.10
298	688720	艾森股份	11,404	1,151,804.00	0.10
299	688612	威迈斯	38,824	1,148,802.16	0.10
300	301012	扬电科技	48,580	1,141,144.20	0.10
301	688293	奥浦迈	27,348	1,140,138.12	0.10
302	000426	兴业银锡	34,100	1,123,936.00	0.09
303	688766	普冉股份	1,462	1,120,769.20	0.09
304	688129	东来技术	42,744	1,119,465.36	0.09
305	301172	君逸数码	43,100	1,118,445.00	0.09
306	603087	甘李药业	19,600	1,112,496.00	0.09
307	600989	宝丰能源	54,600	1,110,018.00	0.09
308	603093	南华期货	61,100	1,108,965.00	0.09
309	688063	派能科技	20,667	1,100,931.09	0.09
310	300483	首华燃气	62,500	1,098,750.00	0.09
311	603799	华友钴业	22,600	1,090,676.00	0.09
312	300201	海伦哲	51,700	1,089,319.00	0.09
313	002929	润建股份	16,200	1,083,456.00	0.09
314	002484	江海股份	10,300	1,081,500.00	0.09
315	300715	凯伦股份	65,500	1,078,130.00	0.09
316	603766	隆鑫通用	90,200	1,076,086.00	0.09
317	600641	先导基电	26,600	1,060,276.00	0.09
318	688710	益诺思	15,573	1,046,505.60	0.09
319	603979	金诚信	17,600	1,038,928.00	0.09

320	603217	元利科技	46,300	1,038,509.00	0.09
321	603126	中材节能	163,100	1,027,530.00	0.09
322	300568	星源材质	54,600	1,022,112.00	0.09
323	688628	优利德	10,309	1,019,972.46	0.09
324	688360	德马科技	56,803	1,016,773.70	0.08
325	688307	中润光学	12,635	1,010,168.25	0.08
326	601777	千里科技	123,600	1,008,576.00	0.08
327	688345	博力威	17,345	1,007,397.60	0.08
328	300840	酷特智能	48,800	1,006,744.00	0.08
329	688181	八亿时空	16,057	1,005,168.20	0.08
330	688322	奥比中光	7,689	1,003,798.95	0.08
331	688028	沃尔德	6,425	1,001,464.75	0.08
332	601579	会稽山	67,900	997,451.00	0.08
333	000062	深圳华强	31,100	989,602.00	0.08
334	002821	凯莱英	6,100	988,200.00	0.08
335	300539	横河精密	48,100	979,797.00	0.08
336	605090	九丰能源	26,300	977,571.00	0.08
337	301216	万凯新材	42,000	965,580.00	0.08
338	688175	高凌信息	38,263	962,314.45	0.08
339	688222	成都先导	29,835	958,001.85	0.08
340	603626	科森科技	51,700	956,450.00	0.08
341	301382	蜂助手	20,600	947,600.00	0.08
342	300842	帝科股份	10,600	945,202.00	0.08
343	605123	派克新材	9,700	940,997.00	0.08
344	300331	苏大维格	13,200	938,652.00	0.08
345	600718	东软集团	126,600	916,584.00	0.08
346	600521	华海药业	63,400	912,960.00	0.08
347	688219	会通股份	70,434	911,415.96	0.08
348	600000	浦发银行	105,700	910,077.00	0.08
349	002406	远东传动	138,300	907,248.00	0.08
350	301369	联动科技	3,700	906,500.00	0.08
351	601231	环旭电子	27,900	903,960.00	0.08
352	300263	隆华科技	55,400	903,020.00	0.08
353	603118	共进股份	73,500	890,085.00	0.07
354	002906	华阳集团	35,400	883,584.00	0.07
355	300552	万集科技	38,600	882,010.00	0.07
356	300955	嘉亨家化	24,400	880,596.00	0.07
357	300398	飞凯材料	14,200	876,850.00	0.07
358	600208	衢州发展	307,800	871,074.00	0.07
359	002746	仙坛股份	169,800	865,980.00	0.07
360	300602	飞荣达	16,900	865,280.00	0.07
361	603882	金域医学	38,400	863,232.00	0.07
362	603219	富佳股份	55,200	860,016.00	0.07

363	000933	神火股份	40,553	859,723.60	0.07
364	300843	胜蓝股份	5,400	843,750.00	0.07
365	002648	卫星化学	35,900	843,291.00	0.07
366	688653	康希通信	48,345	840,236.10	0.07
367	300855	图南股份	26,800	837,768.00	0.07
368	688772	珠海冠宇	42,409	832,488.67	0.07
369	000027	深圳能源	134,100	831,420.00	0.07
370	300672	国科微	2,800	826,000.00	0.07
371	301039	中集车辆	116,700	822,735.00	0.07
372	002627	三峡旅游	143,200	817,672.00	0.07
373	600216	浙江医药	71,400	813,960.00	0.07
374	603992	松霖科技	25,100	813,240.00	0.07
375	301201	诚达药业	22,300	810,828.00	0.07
376	300975	商络电子	15,600	807,300.00	0.07
377	688500	慧辰股份	17,807	807,191.31	0.07
378	688005	容百科技	26,211	802,056.60	0.07
379	000338	潍柴动力	29,300	798,425.00	0.07
380	603897	长城科技	24,400	792,024.00	0.07
381	002532	天山铝业	73,500	788,655.00	0.07
382	603680	今创集团	80,300	787,743.00	0.07
383	300763	锦浪科技	8,700	786,045.00	0.07
384	300429	强力新材	44,300	784,996.00	0.07
385	600060	海信视像	28,100	783,147.00	0.07
386	601555	东吴证券	98,800	782,496.00	0.07
387	600590	泰豪科技	77,100	778,710.00	0.06
388	688981	中芯国际	4,818	765,194.76	0.06
389	600662	外服控股	187,800	756,834.00	0.06
390	002283	天润工业	78,300	755,595.00	0.06
391	300168	万达信息	164,300	754,137.00	0.06
392	603985	恒润股份	31,300	751,826.00	0.06
393	300679	电连技术	12,500	749,875.00	0.06
394	300792	壹网壹创	28,800	747,072.00	0.06
395	002057	中钢天源	58,700	729,641.00	0.06
396	300619	金银河	23,360	726,729.60	0.06
397	688503	聚和材料	5,463	724,940.10	0.06
398	300617	安靠智电	13,600	720,664.00	0.06
399	002025	航天电器	9,400	716,468.00	0.06
400	600872	中炬高新	41,000	711,760.00	0.06
401	301021	英诺激光	5,800	707,020.00	0.06
402	300885	海昌新材	29,600	703,592.00	0.06
403	300031	宝通科技	24,500	699,965.00	0.06
404	605287	德才股份	16,800	697,032.00	0.06
405	603681	永冠新材	30,200	690,070.00	0.06

406	000830	鲁西化工	57,500	690,000.00	0.06
407	301500	飞南资源	26,400	687,720.00	0.06
408	301220	亚香股份	21,200	683,064.00	0.06
409	600011	华能国际	89,700	680,823.00	0.06
410	300438	鹏辉能源	8,200	679,370.00	0.06
411	300697	电工合金	44,400	672,660.00	0.06
412	002061	浙江交科	203,700	672,210.00	0.06
413	600251	冠农股份	77,400	668,736.00	0.06
414	603279	景津装备	55,600	667,200.00	0.06
415	300790	宇瞳光学	25,500	665,805.00	0.06
416	002399	海普瑞	74,100	665,418.00	0.06
417	688396	华润微	6,785	661,876.75	0.06
418	002034	旺能环境	43,600	660,540.00	0.06
419	601881	中国银河	52,400	658,668.00	0.05
420	000415	渤海租赁	161,500	657,305.00	0.05
421	002966	苏州银行	94,300	656,328.00	0.05
422	688187	时代电气	9,423	646,983.18	0.05
423	002376	新北洋	112,500	646,875.00	0.05
424	601121	宝地矿业	114,500	645,780.00	0.05
425	688148	芳源股份	74,659	640,574.22	0.05
426	601700	风范股份	146,500	638,740.00	0.05
427	603790	雅运股份	29,800	635,932.00	0.05
428	002826	易明医药	42,300	635,769.00	0.05
429	300814	中富电路	3,100	633,950.00	0.05
430	002887	绿茵生态	60,500	633,435.00	0.05
431	002206	海利得	122,200	631,774.00	0.05
432	000807	云铝股份	28,500	630,990.00	0.05
433	300737	科顺股份	95,960	630,457.20	0.05
434	300481	濮阳惠成	33,100	629,562.00	0.05
435	000026	飞亚达	29,200	628,968.00	0.05
436	688339	亿华通	33,456	625,627.20	0.05
437	301536	星辰科技	4,800	617,808.00	0.05
438	688213	思特威	5,737	614,260.59	0.05
439	688389	普门科技	62,678	613,617.62	0.05
440	002152	广电运通	65,200	611,576.00	0.05
441	688173	希荻微	31,229	597,723.06	0.05
442	300454	深信服	6,200	596,440.00	0.05
443	688258	卓易信息	5,021	595,189.34	0.05
444	600452	涪陵电力	63,600	593,388.00	0.05
445	001248	华润新能源	58,648	592,931.28	0.05
446	300022	吉峰科技	76,000	590,520.00	0.05
447	688091	上海谊众	14,657	589,211.40	0.05
448	603083	剑桥科技	2,300	586,201.00	0.05

449	301487	盟固利	30,400	582,160.00	0.05
450	603305	旭升集团	46,900	568,428.00	0.05
451	688472	阿特斯	52,405	567,022.10	0.05
452	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
453	688518	联赢激光	18,217	562,905.30	0.05
454	600674	川投能源	39,000	552,630.00	0.05
455	688556	高测股份	41,514	551,305.92	0.05
456	688049	炬芯科技	11,738	550,629.58	0.05
457	300817	双飞集团	35,200	549,120.00	0.05
458	300270	中威电子	42,000	546,420.00	0.05
459	301631	壹连科技	7,600	546,136.00	0.05
460	601566	九牧王	66,700	542,271.00	0.05
461	301408	华人健康	37,500	539,250.00	0.04
462	300490	华自科技	40,700	538,461.00	0.04
463	002228	合兴包装	183,100	538,314.00	0.04
464	300687	赛意信息	17,200	533,200.00	0.04
465	000582	北部湾港	49,100	526,843.00	0.04
466	600699	均胜电子	24,200	522,962.00	0.04
467	300184	力源信息	29,600	519,480.00	0.04
468	600901	江苏金租	90,260	518,995.00	0.04
469	603038	华立股份	32,600	508,560.00	0.04
470	000607	华媒控股	164,100	503,787.00	0.04
471	603077	和邦生物	216,600	502,512.00	0.04
472	002979	雷赛智能	9,000	502,020.00	0.04
473	600258	首旅酒店	45,400	495,768.00	0.04
474	002497	雅化集团	24,300	494,991.00	0.04
475	002577	雷柏科技	26,900	493,884.00	0.04
476	300593	新雷能	16,400	492,984.00	0.04
477	603067	振华股份	10,600	490,674.00	0.04
478	601328	交通银行	76,200	489,966.00	0.04
479	300450	先导智能	12,000	488,640.00	0.04
480	688627	精智达	680	486,200.00	0.04
481	603383	顶点软件	18,300	486,048.00	0.04
482	688779	五矿新能	59,767	484,710.37	0.04
483	301128	强瑞技术	3,100	483,290.00	0.04
484	600369	西南证券	119,900	481,998.00	0.04
485	300302	同有科技	9,400	480,998.00	0.04
486	688717	艾罗能源	5,743	474,199.51	0.04
487	301326	捷邦科技	3,400	473,858.00	0.04
488	688553	汇宇制药	44,477	472,790.51	0.04
489	300731	科创新源	8,100	472,716.00	0.04
490	000800	一汽解放	78,933	469,651.35	0.04
491	000553	安道麦 A	86,700	463,845.00	0.04

492	688516	奥特维	8,051	462,046.89	0.04
493	300773	拉卡拉	30,120	460,836.00	0.04
494	002793	罗欣药业	119,900	460,416.00	0.04
495	600416	湘电股份	46,900	459,620.00	0.04
496	002012	凯恩股份	70,600	452,546.00	0.04
497	300735	光弘科技	19,900	452,526.00	0.04
498	600391	航发科技	13,500	451,575.00	0.04
499	300698	万马科技	16,600	451,520.00	0.04
500	688499	利元亨	8,523	447,883.65	0.04
501	603486	科沃斯	8,800	446,600.00	0.04
502	601108	财通证券	51,400	444,610.00	0.04
503	301150	中一科技	7,000	441,770.00	0.04
504	600980	北矿科技	23,400	438,750.00	0.04
505	601608	中信重工	91,200	435,024.00	0.04
506	000425	徐工机械	53,500	432,815.00	0.04
507	000546	金圆股份	89,000	432,540.00	0.04
508	688428	诺诚健华	15,105	430,039.35	0.04
509	301193	家联科技	23,030	426,976.20	0.04
510	301171	易点天下	12,510	424,839.60	0.04
511	000810	创维数字	32,000	424,000.00	0.04
512	000623	吉林敖东	23,700	420,201.00	0.04
513	300233	金城医药	33,500	415,400.00	0.03
514	300691	联合光电	26,100	412,641.00	0.03
515	688620	安凯微	25,168	407,721.60	0.03
516	688112	鼎阳科技	5,526	405,939.96	0.03
517	600141	兴发集团	8,600	403,942.00	0.03
518	301316	慧博云通	10,100	397,738.00	0.03
519	300358	楚天科技	49,700	397,600.00	0.03
520	002961	瑞达期货	20,300	397,474.00	0.03
521	603991	领先股份	2,800	395,220.00	0.03
522	300493	润欣科技	26,400	393,624.00	0.03
523	600348	华阳股份	51,400	393,210.00	0.03
524	002408	齐翔腾达	83,600	392,084.00	0.03
525	000975	山金国际	22,900	389,300.00	0.03
526	301263	泰恩康	18,940	388,080.60	0.03
527	688599	天合光能	27,358	386,294.96	0.03
528	002922	伊戈尔	11,700	383,760.00	0.03
529	002838	道恩股份	12,500	382,750.00	0.03
530	600875	东方电气	13,100	376,887.00	0.03
531	600292	电投水电	31,100	374,444.00	0.03
532	002285	世联行	180,200	369,410.00	0.03
533	000989	九芝堂	47,500	369,075.00	0.03
534	601038	一拖股份	34,600	366,414.00	0.03

535	688488	艾迪药业	28,431	365,338.35	0.03
536	600490	鹏欣资源	62,100	361,422.00	0.03
537	600640	国脉文化	37,200	359,724.00	0.03
538	300990	同飞股份	3,400	357,238.00	0.03
539	688410	山外山	24,836	356,644.96	0.03
540	000686	东北证券	42,400	356,160.00	0.03
541	300745	欣锐科技	8,400	354,648.00	0.03
542	000783	长江证券	36,100	351,975.00	0.03
543	300986	志特新材	20,400	349,860.00	0.03
544	600663	陆家嘴	55,500	348,540.00	0.03
545	002001	新 和 成	12,200	346,724.00	0.03
546	603703	盛洋科技	31,200	346,320.00	0.03
547	601898	中煤能源	28,400	345,912.00	0.03
548	603025	大豪科技	25,300	345,092.00	0.03
549	301507	民生健康	28,500	342,855.00	0.03
550	002558	巨人网络	12,400	341,744.00	0.03
551	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.03
552	688359	三孚新科	1,671	331,593.24	0.03
553	601918	新集能源	38,600	331,574.00	0.03
554	301260	格力博	24,500	330,995.00	0.03
555	002357	富临运业	37,000	329,300.00	0.03
556	600020	中原高速	88,920	328,114.80	0.03
557	002265	建设工业	18,800	327,120.00	0.03
558	300976	达瑞电子	4,100	326,565.00	0.03
559	300933	中辰股份	53,100	322,848.00	0.03
560	688195	腾景科技	1,670	321,608.60	0.03
561	688399	硕世生物	7,082	321,451.98	0.03
562	688609	九联科技	29,048	319,818.48	0.03
563	301607	富特科技	6,100	318,725.00	0.03
564	688090	瑞松科技	2,985	317,753.25	0.03
565	688327	云从科技	25,218	314,216.28	0.03
566	301397	溯联股份	9,700	313,892.00	0.03
567	688328	深科达	3,268	312,747.60	0.03
568	600739	辽宁成大	30,800	311,388.00	0.03
569	000973	佛塑科技	21,500	308,525.00	0.03
570	300271	华宇软件	64,000	308,480.00	0.03
571	688046	药康生物	12,720	307,824.00	0.03
572	600655	豫园股份	74,800	307,428.00	0.03
573	000987	越秀资本	39,300	307,326.00	0.03
574	300981	中红医疗	32,100	307,197.00	0.03
575	002796	世嘉科技	7,500	305,850.00	0.03
576	002382	蓝帆医疗	60,200	305,816.00	0.03
577	601068	中铝国际	70,200	303,264.00	0.03

578	688593	新相微	7,777	302,680.84	0.03
579	600380	健康元	32,100	302,382.00	0.03
580	300872	天阳科技	19,100	301,780.00	0.03
581	002988	豪美新材	13,600	300,016.00	0.03
582	600155	华创云信	53,900	297,528.00	0.02
583	688141	杰华特	1,929	296,101.50	0.02
584	688006	杭可科技	8,065	294,775.75	0.02
585	002238	天威视讯	54,400	293,760.00	0.02
586	603658	安图生物	10,100	293,102.00	0.02
587	600546	山煤国际	26,600	290,738.00	0.02
588	000782	恒申新材	35,900	290,072.00	0.02
589	002841	视源股份	8,400	290,052.00	0.02
590	688317	之江生物	19,042	289,438.40	0.02
591	002833	弘亚数控	15,000	289,350.00	0.02
592	301238	瑞泰新材	11,800	287,920.00	0.02
593	300127	银河磁体	10,100	282,295.00	0.02
594	300177	中海达	45,500	282,100.00	0.02
595	002274	华昌化工	60,800	281,504.00	0.02
596	300339	润和软件	7,300	281,123.00	0.02
597	600535	天士力	21,200	280,476.00	0.02
598	002606	大连电瓷	20,900	280,269.00	0.02
599	688567	孚能科技	26,681	280,150.50	0.02
600	600392	盛和资源	9,400	279,838.00	0.02
601	688538	和辉光电	107,595	279,747.00	0.02
602	002899	英派斯	12,800	279,040.00	0.02
603	601009	南京银行	27,700	273,953.00	0.02
604	301055	张小泉	6,400	271,808.00	0.02
605	603611	诺力股份	16,700	270,373.00	0.02
606	002216	三全食品	23,300	268,649.00	0.02
607	300418	昆仑万维	6,600	266,376.00	0.02
608	601375	中原证券	66,700	266,133.00	0.02
609	600282	南钢股份	57,800	265,302.00	0.02
610	600558	大西洋	53,517	264,373.98	0.02
611	300061	旗天科技	37,700	263,523.00	0.02
612	600827	百联股份	35,300	261,573.00	0.02
613	601958	金钼股份	9,300	261,423.00	0.02
614	603315	福鞍股份	17,400	260,652.00	0.02
615	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
616	001337	四川黄金	7,000	256,620.00	0.02
617	601156	东航物流	15,900	256,308.00	0.02
618	300004	南风股份	25,300	255,530.00	0.02
619	000733	振华科技	4,500	254,880.00	0.02
620	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.02

621	600971	恒源煤电	36,700	253,230.00	0.02
622	688017	绿的谐波	602	251,551.72	0.02
623	003029	吉大正元	15,700	251,514.00	0.02
624	600683	京投发展	21,700	249,550.00	0.02
625	600031	三一重工	14,300	247,104.00	0.02
626	688480	赛恩斯	2,778	243,325.02	0.02
627	600637	东方明珠	29,000	240,990.00	0.02
628	301116	益客食品	27,600	236,256.00	0.02
629	000928	中钢国际	47,300	235,554.00	0.02
630	688418	震有科技	4,826	232,034.08	0.02
631	002185	华天科技	10,400	232,024.00	0.02
632	603969	银龙股份	31,600	229,732.00	0.02
633	600429	三元股份	56,500	228,260.00	0.02
634	600267	海正药业	22,500	227,475.00	0.02
635	000863	三湘印象	54,100	227,220.00	0.02
636	600098	广州发展	38,400	226,944.00	0.02
637	603806	福斯特	13,500	226,665.00	0.02
638	600509	天富能源	26,800	226,460.00	0.02
639	688182	灿勤科技	5,254	226,289.78	0.02
640	000629	钒钛股份	66,400	221,776.00	0.02
641	688668	鼎通科技	592	220,993.60	0.02
642	002120	韵达股份	34,500	219,420.00	0.02
643	300005	探路者	9,700	219,220.00	0.02
644	300532	今天国际	35,063	218,442.49	0.02
645	300489	光智科技	700	218,365.00	0.02
646	603381	永臻股份	14,000	215,740.00	0.02
647	688158	优刻得	5,862	215,487.12	0.02
648	300579	数字认证	10,400	215,280.00	0.02
649	000883	湖北能源	49,700	214,704.00	0.02
650	301286	侨源股份	3,700	214,563.00	0.02
651	000069	华侨城 A	130,200	213,528.00	0.02
652	000750	国海证券	57,700	212,336.00	0.02
653	688512	慧智微	13,171	210,340.87	0.02
654	000828	东莞控股	22,300	208,728.00	0.02
655	688176	亚虹医药	21,022	208,538.24	0.02
656	300466	赛摩智能	29,600	208,384.00	0.02
657	002967	广电计量	11,500	207,575.00	0.02
658	300079	数码视讯	49,100	206,220.00	0.02
659	688281	华秦科技	4,074	204,637.02	0.02
660	605289	罗曼股份	1,400	203,000.00	0.02
661	688443	智翔金泰	8,689	202,019.25	0.02
662	300206	理邦仪器	16,500	201,795.00	0.02
663	688375	国博电子	1,933	201,611.90	0.02

664	601001	晋控煤业	11,500	199,985.00	0.02
665	000021	深科技	3,100	199,237.00	0.02
666	600284	浦东建设	40,900	198,774.00	0.02
667	002439	启明星辰	15,700	198,605.00	0.02
668	300700	岱勒新材	9,300	197,904.00	0.02
669	601886	江河集团	24,188	194,229.64	0.02
670	600606	绿地控股	159,700	193,237.00	0.02
671	603699	纽威股份	3,800	191,140.00	0.02
672	002573	清新环境	64,700	190,218.00	0.02
673	600746	江苏索普	36,300	189,849.00	0.02
674	600841	动力新科	30,800	187,880.00	0.02
675	600710	苏美达	19,600	187,376.00	0.02
676	002685	华东重机	28,700	185,402.00	0.02
677	601106	中国一重	56,100	185,130.00	0.02
678	603239	浙江仙通	12,500	185,125.00	0.02
679	603931	格林达	3,100	184,140.00	0.02
680	600773	西藏城投	14,100	181,467.00	0.02
681	600029	南方航空	34,900	180,782.00	0.02
682	300400	劲拓股份	4,800	180,720.00	0.02
683	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
684	688135	利扬芯片	4,269	179,639.52	0.01
685	688630	芯碁微装	325	178,551.75	0.01
686	300299	富春股份	36,400	178,360.00	0.01
687	300118	东方日升	14,300	178,035.00	0.01
688	603233	大参林	11,800	177,354.00	0.01
689	601515	衢州东峰	55,000	176,000.00	0.01
690	001287	中电港	5,600	174,440.00	0.01
691	603901	永创智能	15,925	173,104.75	0.01
692	605222	起帆电缆	7,400	172,568.00	0.01
693	300918	南山智尚	15,900	170,448.00	0.01
694	600523	贵航股份	16,100	169,855.00	0.01
695	000923	河钢资源	13,600	168,776.00	0.01
696	301439	泓淋电力	10,700	168,204.00	0.01
697	002926	华西证券	20,400	166,668.00	0.01
698	603508	思维列控	7,800	166,608.00	0.01
699	601969	海南矿业	21,000	166,110.00	0.01
700	002010	传化智联	37,100	165,837.00	0.01
701	688068	热景生物	1,901	164,626.60	0.01
702	601126	四方股份	2,600	164,320.00	0.01
703	688383	新益昌	857	161,150.28	0.01
704	600061	国投资本	24,500	160,475.00	0.01
705	002099	海翔药业	30,200	159,456.00	0.01
706	601988	中国银行	27,800	159,016.00	0.01

707	301090	华润材料	25,200	158,004.00	0.01
708	601139	深圳燃气	27,900	157,914.00	0.01
709	000990	诚志股份	19,300	157,874.00	0.01
710	002384	东山精密	600	157,410.00	0.01
711	301665	泰禾股份	7,500	157,200.00	0.01
712	000049	德赛电池	6,700	156,579.00	0.01
713	603889	新澳股份	30,580	156,263.80	0.01
714	688559	海目星	1,858	155,923.36	0.01
715	301237	和顺科技	2,100	155,568.00	0.01
716	002062	宏润建设	21,500	153,940.00	0.01
717	603132	金徽股份	9,700	151,126.00	0.01
718	002380	科远智慧	4,400	150,392.00	0.01
719	002948	青岛银行	29,600	150,368.00	0.01
720	601002	晋亿实业	34,200	147,744.00	0.01
721	600333	长春燃气	29,200	146,584.00	0.01
722	300075	数字政通	14,200	145,124.00	0.01
723	603336	宏辉果蔬	18,200	144,144.00	0.01
724	603569	长久物流	27,100	143,630.00	0.01
725	601216	君正集团	32,200	143,612.00	0.01
726	300900	广联航空	3,700	142,709.00	0.01
727	688618	三旺通信	4,637	142,680.49	0.01
728	300727	润禾材料	3,800	142,196.00	0.01
729	600927	永安期货	11,200	139,440.00	0.01
730	300349	金卡智能	12,700	138,938.00	0.01
731	300671	富满微	1,600	137,856.00	0.01
732	600288	大恒科技	10,300	136,990.00	0.01
733	601339	百隆东方	20,200	136,754.00	0.01
734	605168	三人行	2,700	136,728.00	0.01
735	002065	东华软件	19,000	135,660.00	0.01
736	000534	万泽股份	4,900	134,064.00	0.01
737	301225	恒勃股份	1,700	133,943.00	0.01
738	300154	瑞凌股份	17,800	133,856.00	0.01
739	688690	纳微科技	3,008	132,652.80	0.01
740	002027	分众传媒	27,400	132,616.00	0.01
741	002534	西子洁能	7,100	131,705.00	0.01
742	300050	世纪鼎利	22,200	131,424.00	0.01
743	002365	永安药业	12,900	130,548.00	0.01
744	688758	赛分科技	5,849	128,736.49	0.01
745	600998	九州通	26,900	126,161.00	0.01
746	300078	思创智联	42,200	125,334.00	0.01
747	002079	苏州固锝	8,300	124,749.00	0.01
748	603068	博通集成	3,100	124,713.00	0.01
749	002752	昇兴股份	22,200	122,544.00	0.01

750	605577	龙版传媒	13,900	122,459.00	0.01
751	002557	洽洽食品	6,800	122,128.00	0.01
752	300765	石药创新	4,461	121,473.03	0.01
753	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
754	002475	立讯精密	1,700	119,680.00	0.01
755	688128	中国电研	5,018	119,127.32	0.01
756	600973	宝胜股份	16,700	118,403.00	0.01
757	300369	绿盟科技	21,700	118,048.00	0.01
758	601615	明阳智能	10,200	118,014.00	0.01
759	688600	皖仪科技	3,544	117,944.32	0.01
760	002039	黔源电力	6,200	116,684.00	0.01
761	300219	鸿利智汇	11,100	115,773.00	0.01
762	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
763	300656	民德电子	3,000	114,270.00	0.01
764	603286	日盈电子	2,500	114,075.00	0.01
765	600395	盘江股份	25,000	114,000.00	0.01
766	603719	良品铺子	13,100	113,315.00	0.01
767	600230	沧州大化	8,700	113,274.00	0.01
768	301608	博实结	2,200	110,572.00	0.01
769	002811	郑中设计	9,800	109,662.00	0.01
770	600598	北大荒	10,100	109,484.00	0.01
771	002458	益生股份	13,950	108,391.50	0.01
772	301025	读客文化	13,900	107,864.00	0.01
773	600510	黑牡丹	14,400	107,424.00	0.01
774	301109	军信股份	8,600	107,156.00	0.01
775	603596	伯特利	4,300	106,812.00	0.01
776	600583	海油工程	21,100	106,133.00	0.01
777	688478	晶升股份	1,198	106,082.90	0.01
778	002438	江苏神通	7,100	106,003.00	0.01
779	600816	建元信托	43,000	104,920.00	0.01
780	600642	申能股份	11,900	103,887.00	0.01
781	002810	山东赫达	4,200	103,740.00	0.01
782	601369	陕鼓动力	11,300	102,265.00	0.01
783	002315	焦点科技	4,300	100,104.00	0.01
784	688486	龙迅股份	1,555	98,866.90	0.01
785	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
786	600135	乐凯胶片	12,100	96,679.00	0.01
787	605056	咸亨国际	6,000	96,000.00	0.01
788	002115	三维通信	9,300	95,790.00	0.01
789	000898	鞍钢股份	51,100	95,557.00	0.01
790	601083	锦江航运	9,600	95,424.00	0.01
791	300187	永清环保	18,600	93,930.00	0.01
792	002596	海南瑞泽	32,800	93,808.00	0.01

793	300523	辰安科技	5,100	93,738.00	0.01
794	600963	岳阳林纸	30,700	93,328.00	0.01
795	600483	福能股份	9,100	92,729.00	0.01
796	002483	润邦股份	18,759	92,669.46	0.01
797	600764	中国海防	5,300	92,379.00	0.01
798	300121	阳谷华泰	7,300	91,980.00	0.01
799	301267	华夏眼科	6,300	91,917.00	0.01
800	600469	风神股份	16,500	89,760.00	0.01
801	688733	壹石通	2,169	89,688.15	0.01
802	688301	奕瑞科技	718	89,032.00	0.01
803	600724	宁波富达	17,500	88,725.00	0.01
804	300291	百纳千成	18,300	88,389.00	0.01
805	600686	金龙汽车	7,800	88,062.00	0.01
806	605028	世茂能源	4,100	87,330.00	0.01
807	601995	中金公司	2,400	86,760.00	0.01
808	600183	生益科技	500	86,700.00	0.01
809	600566	济川药业	3,900	86,541.00	0.01
810	600123	兰花科创	16,200	86,508.00	0.01
811	000599	青岛双星	20,400	86,088.00	0.01
812	300016	北陆药业	11,100	85,137.00	0.01
813	601666	平煤股份	11,800	84,370.00	0.01
814	000983	山西焦煤	14,500	84,100.00	0.01
815	002865	钧达股份	1,400	83,552.00	0.01
816	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.01
817	002128	电投能源	3,500	80,920.00	0.01
818	300846	首都在线	3,800	80,598.00	0.01
819	000561	烽火电子	10,800	79,920.00	0.01
820	301396	宏景科技	240	79,584.00	0.01
821	001872	招商港口	4,000	77,720.00	0.01
822	300497	富祥股份	3,500	77,560.00	0.01
823	300388	节能国祯	12,400	76,508.00	0.01
824	688238	和元生物	14,051	76,156.42	0.01
825	301499	维科精密	2,600	75,868.00	0.01
826	603980	吉华集团	11,300	75,032.00	0.01
827	300253	卫宁健康	11,100	74,703.00	0.01
828	002338	奥普光电	1,300	74,360.00	0.01
829	688009	中国通号	15,514	73,846.64	0.01
830	000825	太钢不锈	21,600	73,656.00	0.01
831	600645	中源协和	4,300	73,573.00	0.01
832	300518	新迅达	2,200	72,710.00	0.01
833	300056	中创环保	10,000	72,700.00	0.01
834	603010	万盛股份	4,000	72,480.00	0.01
835	301587	中瑞股份	3,300	72,435.00	0.01

836	300153	科泰电源	3,200	72,384.00	0.01
837	688311	盟升电子	2,718	71,184.42	0.01
838	002132	恒星科技	13,100	70,871.00	0.01
839	600300	维维股份	25,100	70,782.00	0.01
840	002414	高德红外	5,300	70,278.00	0.01
841	688456	有研粉材	500	69,800.00	0.01
842	000519	中兵红箭	3,300	69,531.00	0.01
843	301029	怡合达	2,500	67,525.00	0.01
844	300230	永利股份	15,900	66,780.00	0.01
845	300769	德方纳米	1,000	66,500.00	0.01
845	600808	马钢股份	26,600	66,500.00	0.01
846	002653	海思科	1,000	66,340.00	0.01
847	603027	千禾味业	9,500	66,215.00	0.01
848	002536	飞龙股份	1,400	66,052.00	0.01
849	601975	招商南油	17,600	65,648.00	0.01
850	300298	三诺生物	4,700	65,565.00	0.01
851	300368	汇金股份	7,800	65,130.00	0.01
852	600064	南京高科	9,100	64,883.00	0.01
853	300695	兆丰股份	1,300	64,727.00	0.01
854	603057	紫燕食品	2,900	64,670.00	0.01
855	605007	五洲特纸	4,800	64,272.00	0.01
856	002668	TCL 智家	5,800	64,264.00	0.01
857	002403	爱仕达	7,200	64,224.00	0.01
858	300511	雪榕生物	12,700	63,881.00	0.01
859	002153	石基信息	8,800	63,624.00	0.01
860	600628	新世界	11,300	63,619.00	0.01
861	002284	亚太股份	6,700	63,583.00	0.01
862	688331	荣昌生物	487	63,436.62	0.01
863	688368	晶丰明源	288	62,357.76	0.01
864	300315	掌趣科技	15,900	62,010.00	0.01
865	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.01
866	601398	工商银行	8,600	60,802.00	0.01
867	688093	世华科技	1,645	60,700.50	0.01
868	300540	蜀道装备	1,600	60,640.00	0.01
869	688165	埃夫特	2,969	60,567.60	0.01
870	688728	格科微	2,806	59,038.24	0.00
871	301571	国科天成	900	58,662.00	0.00
872	300171	东富龙	5,300	58,618.00	0.00
873	688233	神工股份	273	58,536.66	0.00
874	601872	招商轮船	3,320	58,332.40	0.00
875	002042	华孚时尚	17,100	58,311.00	0.00
876	688603	天承科技	279	58,018.05	0.00
877	003816	中国广核	14,700	57,477.00	0.00

878	002020	京新药业	4,600	57,454.00	0.00
879	002885	京泉华	1,400	57,204.00	0.00
880	000822	山东海化	14,200	57,084.00	0.00
881	002092	中泰化学	14,800	56,684.00	0.00
882	002166	莱茵生物	9,000	56,520.00	0.00
883	300428	立中集团	3,100	56,358.00	0.00
884	600770	综艺股份	8,000	56,000.00	0.00
885	000402	金 融 街	23,100	55,671.00	0.00
886	000156	华数传媒	8,800	55,528.00	0.00
887	301153	中科江南	3,395	55,304.55	0.00
888	002666	德联集团	13,800	54,510.00	0.00
889	300410	正业科技	4,900	54,243.00	0.00
890	603600	永艺股份	6,100	54,107.00	0.00
891	300563	神宇股份	1,900	53,941.00	0.00
892	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
893	688510	航亚科技	2,255	53,849.40	0.00
894	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
895	300227	光韵达	4,500	53,550.00	0.00
896	000739	普洛药业	3,200	53,312.00	0.00
897	300001	特锐德	1,400	52,962.00	0.00
898	688505	复旦张江	7,081	52,257.78	0.00
899	603933	睿能科技	2,300	51,865.00	0.00
900	002383	合众思壮	7,500	50,925.00	0.00
901	300628	亿联网络	1,500	50,730.00	0.00
902	300260	新莱应材	500	50,230.00	0.00
903	603061	金海通	100	50,222.00	0.00
904	688351	微电生理	2,215	50,191.90	0.00
905	002482	广田集团	42,400	50,032.00	0.00
906	002563	森马服饰	9,900	49,896.00	0.00
907	600100	同方股份	7,200	49,320.00	0.00
908	000690	宝新能源	10,400	48,880.00	0.00
909	000166	申万宏源	11,100	48,840.00	0.00
910	300317	珈伟新能	12,100	48,642.00	0.00
911	301529	福赛科技	500	48,180.00	0.00
912	600185	珠免集团	10,600	47,700.00	0.00
913	603209	兴通股份	3,800	47,614.00	0.00
914	600751	海航科技	16,100	46,851.00	0.00
915	688127	蓝特光学	479	46,750.40	0.00
916	600388	龙净环保	3,200	46,560.00	0.00
917	600218	全柴动力	6,300	45,486.00	0.00
918	300451	创业慧康	14,200	45,440.00	0.00
919	000755	山西高速	10,700	45,368.00	0.00
920	002182	宝武镁业	2,880	44,841.60	0.00

921	300333	兆日科技	5,300	44,838.00	0.00
922	601212	白银有色	8,800	44,704.00	0.00
923	000050	深天马 A	4,500	44,595.00	0.00
924	002396	星网锐捷	2,300	44,091.00	0.00
925	603978	深圳新星	1,400	44,002.00	0.00
926	002678	珠江钢琴	10,400	43,992.00	0.00
927	000589	贵州轮胎	10,500	42,630.00	0.00
928	688475	萤石网络	1,531	41,872.85	0.00
929	300999	金龙鱼	1,800	41,868.00	0.00
930	600072	中船科技	4,900	41,601.00	0.00
931	601801	皖新传媒	8,300	40,919.00	0.00
932	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
933	002919	名臣健康	2,100	39,879.00	0.00
934	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.00
935	601033	永兴股份	2,900	38,860.00	0.00
936	601000	唐山港	9,300	38,595.00	0.00
937	002615	哈尔斯	5,500	37,950.00	0.00
938	001212	中旗新材	800	37,904.00	0.00
939	002415	海康威视	1,100	37,620.00	0.00
940	002401	中远海科	3,200	37,152.00	0.00
941	688682	霍莱沃	955	37,149.50	0.00
942	000708	中信特钢	2,900	36,598.00	0.00
943	688045	必易微	452	36,512.56	0.00
944	301123	奕东电子	300	36,216.00	0.00
945	002041	登海种业	4,600	36,202.00	0.00
946	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
947	600008	首创环保	13,100	35,632.00	0.00
948	600339	中油工程	11,600	35,612.00	0.00
949	002840	华统股份	4,700	34,263.00	0.00
950	300818	耐普矿机	1,800	34,020.00	0.00
951	600271	航天信息	5,100	33,558.00	0.00
952	002134	天津普林	1,100	33,462.00	0.00
953	000935	四川双马	1,281	33,421.29	0.00
954	000581	威孚高科	1,900	32,338.00	0.00
955	688429	时创能源	3,106	31,650.14	0.00
956	600754	锦江酒店	1,700	30,583.00	0.00
957	002677	浙江美大	5,500	30,415.00	0.00
958	301662	宏工科技	300	30,396.00	0.00
959	600210	紫江企业	4,900	30,380.00	0.00
960	001359	平安电工	239	29,934.75	0.00
961	688252	天德钰	1,239	29,736.00	0.00
962	002516	旷达科技	5,300	29,574.00	0.00
963	300130	新国都	1,400	29,456.00	0.00

964	000868	安凯客车	9,000	29,340.00	0.00
965	002895	川恒股份	1,000	29,200.00	0.00
966	688007	光峰科技	2,169	28,847.70	0.00
967	603317	天味食品	2,200	28,622.00	0.00
968	002624	完美世界	2,300	28,566.00	0.00
969	600018	上港集团	6,000	28,320.00	0.00
970	300077	国民技术	900	28,215.00	0.00
971	603158	腾龙股份	2,300	28,129.00	0.00
972	300071	福石控股	8,000	28,000.00	0.00
973	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
974	301550	斯菱智驱	304	27,794.72	0.00
975	300458	全志科技	700	27,622.00	0.00
976	301373	凌玮科技	176	27,368.00	0.00
977	000886	海南高速	6,700	27,336.00	0.00
978	301176	逸豪新材	400	27,200.00	0.00
979	600928	西安银行	8,200	26,814.00	0.00
980	001339	智微智能	260	26,592.80	0.00
981	002708	光洋股份	2,000	26,380.00	0.00
982	600742	富维股份	3,600	26,064.00	0.00
983	600882	妙可蓝多	1,600	25,584.00	0.00
984	600468	百利电气	4,200	25,494.00	0.00
985	600547	山东黄金	1,100	25,399.00	0.00
986	601360	三六零	2,900	25,201.00	0.00
987	600517	国网英大	5,300	24,804.00	0.00
988	300133	华策影视	3,500	24,780.00	0.00
989	300587	天铁科技	6,400	24,640.00	0.00
990	603085	天成自控	2,200	23,914.00	0.00
991	601828	美凯龙	11,700	23,868.00	0.00
992	600515	海南机场	8,600	23,564.00	0.00
993	300002	神州泰岳	3,000	23,430.00	0.00
994	300911	亿田智能	1,100	23,375.00	0.00
995	603108	润达医疗	2,600	23,140.00	0.00
996	000862	银星能源	4,800	23,136.00	0.00
997	300042	朗科科技	300	22,851.00	0.00
998	002150	正泰电源	900	22,761.00	0.00
999	300952	恒辉安防	1,300	22,620.00	0.00
1,000	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
1,001	601519	大智慧	2,600	22,438.00	0.00
1,002	600815	厦工股份	8,700	22,359.00	0.00
1,003	002925	盈趣科技	900	22,194.00	0.00
1,004	002043	兔宝宝	2,000	22,160.00	0.00
1,005	601939	建设银行	2,300	22,149.00	0.00
1,006	002531	天顺风能	2,600	21,918.00	0.00

1,007	000905	厦门港务	2,800	21,728.00	0.00
1,008	601138	工业富联	300	21,645.00	0.00
1,009	002387	维信诺	2,400	21,600.00	0.00
1,009	300407	凯发电气	2,000	21,600.00	0.00
1,010	001267	汇绿生态	400	21,400.00	0.00
1,011	300970	华绿生物	1,170	21,387.60	0.00
1,012	688081	兴图新科	523	21,380.24	0.00
1,013	000630	铜陵有色	3,300	20,988.00	0.00
1,014	301522	上大股份	800	20,936.00	0.00
1,015	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.00
1,016	000902	新洋丰	1,800	20,808.00	0.00
1,017	000408	藏格矿业	300	20,796.00	0.00
1,018	300682	朗新科技	2,100	20,790.00	0.00
1,019	688208	道通科技	821	20,680.99	0.00
1,020	688625	呈和科技	245	20,680.45	0.00
1,021	002772	众兴菌业	1,800	20,448.00	0.00
1,022	002468	申通快递	1,400	20,384.00	0.00
1,023	600259	中稀有色	200	20,322.00	0.00
1,024	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
1,025	002407	多氟多	400	20,092.00	0.00
1,026	002161	远望谷	3,700	19,906.00	0.00
1,027	603119	浙江荣泰	300	19,902.00	0.00
1,028	300183	东软载波	1,900	19,855.00	0.00
1,029	601117	中国化学	2,700	19,845.00	0.00
1,030	300908	仲景食品	900	19,836.00	0.00
1,031	001316	润贝航科	600	19,788.00	0.00
1,032	600219	南山铝业	4,900	19,551.00	0.00
1,033	688530	欧莱新材	200	19,380.00	0.00
1,034	002519	银河电子	3,300	19,305.00	0.00
1,035	301099	雅创电子	200	19,100.00	0.00
1,036	001288	运机集团	800	19,032.00	0.00
1,037	601198	东兴证券	1,400	19,026.00	0.00
1,038	300146	汤臣倍健	2,100	18,984.00	0.00
1,039	000628	高新发展	400	18,960.00	0.00
1,040	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
1,041	603124	江南新材	100	18,698.00	0.00
1,042	002054	德美化工	2,800	18,620.00	0.00
1,043	301071	力量钻石	200	18,500.00	0.00
1,044	000603	盛达资源	800	18,480.00	0.00
1,045	301362	民爆光电	100	18,392.00	0.00
1,046	002390	信邦制药	7,000	18,270.00	0.00
1,047	000792	盐湖股份	600	18,114.00	0.00
1,048	000709	河钢股份	9,200	17,848.00	0.00

1,049	002831	裕同科技	500	17,780.00	0.00
1,050	300047	天源迪科	2,000	17,760.00	0.00
1,051	301189	奥尼电子	300	17,679.00	0.00
1,052	300213	佳讯飞鸿	2,900	17,574.00	0.00
1,053	688722	同益中	1,117	16,944.89	0.00
1,054	603266	天龙股份	1,000	16,830.00	0.00
1,055	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
1,056	600970	中材国际	2,300	16,399.00	0.00
1,057	688192	迪哲医药	410	16,371.30	0.00
1,058	600805	悦达投资	4,000	16,120.00	0.00
1,059	002169	智光电气	1,100	16,104.00	0.00
1,060	605099	共创草坪	500	16,100.00	0.00
1,061	301076	新瀚新材	600	15,708.00	0.00
1,062	300057	万顺新材	1,800	15,624.00	0.00
1,063	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
1,064	002422	科伦药业	400	15,408.00	0.00
1,065	002463	沪电股份	100	15,280.00	0.00
1,066	002947	恒铭达	200	15,210.00	0.00
1,066	600486	扬农化工	300	15,210.00	0.00
1,067	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
1,068	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
1,069	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
1,070	600562	国睿科技	700	14,854.00	0.00
1,070	603296	华勤技术	200	14,854.00	0.00
1,071	300816	艾可蓝	200	14,640.00	0.00
1,072	600602	云赛智联	900	14,472.00	0.00
1,073	301511	德福科技	100	14,385.00	0.00
1,074	301603	乔锋智能	100	14,380.00	0.00
1,075	002993	奥海科技	200	14,322.00	0.00
1,076	301328	维峰电子	200	14,240.00	0.00
1,077	002706	良信股份	1,300	14,183.00	0.00
1,078	600312	平高电气	800	14,128.00	0.00
1,079	002170	芭田股份	1,300	14,118.00	0.00
1,080	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
1,081	600163	中闽能源	2,700	13,905.00	0.00
1,082	300997	欢乐家	1,000	13,550.00	0.00
1,083	002130	沃尔核材	700	13,272.00	0.00
1,084	002555	三七互娱	700	13,209.00	0.00
1,085	002695	煌上煌	1,300	13,195.00	0.00
1,086	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
1,087	603165	荣晟环保	1,000	13,030.00	0.00
1,088	601857	中国石油	1,500	13,020.00	0.00
1,089	601112	振石股份	731	12,858.29	0.00

1,090	600556	天下秀	2,900	12,818.00	0.00
1,091	002544	普天科技	700	12,754.00	0.00
1,092	603259	药明康德	100	12,451.00	0.00
1,093	600330	天通股份	400	12,336.00	0.00
1,094	603966	法兰泰克	1,500	12,225.00	0.00
1,095	688209	英集芯	407	11,835.56	0.00
1,096	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
1,097	002556	辉隆股份	2,600	11,648.00	0.00
1,098	300389	艾比森	900	11,538.00	0.00
1,099	605598	上海港湾	300	11,529.00	0.00
1,100	301277	新天地	1,289	11,278.75	0.00
1,101	300806	斯迪克	100	11,200.00	0.00
1,102	688548	广钢气体	214	11,149.40	0.00
1,103	002881	美格智能	300	10,932.00	0.00
1,104	001979	招商蛇口	1,700	10,931.00	0.00
1,105	301215	中汽股份	2,100	10,899.00	0.00
1,106	600028	中国石化	2,400	10,704.00	0.00
1,107	002970	锐明技术	200	10,686.00	0.00
1,108	600570	恒生电子	500	10,595.00	0.00
1,109	000688	国城矿业	300	10,269.00	0.00
1,110	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
1,111	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
1,112	688171	纬德信息	227	9,978.92	0.00
1,113	000997	新大陆	600	9,780.00	0.00
1,114	300811	铂科新材	100	9,489.00	0.00
1,115	300803	指南针	100	9,167.00	0.00
1,116	601021	春秋航空	200	9,116.00	0.00
1,117	300113	顺网科技	500	9,105.00	0.00
1,118	600026	中远海能	500	8,970.00	0.00
1,119	002472	双环传动	200	8,302.00	0.00
1,120	002111	威海广泰	900	8,100.00	0.00
1,121	000819	岳阳兴长	700	7,931.00	0.00
1,122	300946	恒而达	200	7,878.00	0.00
1,123	605077	华康股份	700	7,567.00	0.00
1,124	601101	昊华能源	700	7,392.00	0.00
1,125	300566	激智科技	200	7,390.00	0.00
1,126	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
1,127	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
1,128	300736	百邦科技	200	6,200.00	0.00
1,129	300684	中石科技	100	6,100.00	0.00
1,130	001280	中国铀业	88	5,869.60	0.00
1,131	300257	开山股份	200	5,736.00	0.00
1,132	301219	腾远钴业	100	5,480.00	0.00

1, 133	300197	节能铁汉	2, 800	5, 348. 00	0. 00
1, 134	301601	惠通科技	342	5, 342. 04	0. 00
1, 135	600025	华能水电	600	5, 334. 00	0. 00
1, 136	600276	恒瑞医药	100	5, 204. 00	0. 00
1, 137	300151	昌红科技	200	4, 990. 00	0. 00
1, 138	603435	嘉德利	104	4, 857. 84	0. 00
1, 139	300607	拓斯达	100	4, 123. 00	0. 00
1, 140	002448	中原内配	300	3, 690. 00	0. 00
1, 141	301282	金禄电子	100	2, 949. 00	0. 00
1, 142	603352	至信股份	112	2, 858. 24	0. 00
1, 143	301449	天溯计量	65	2, 515. 50	0. 00
1, 144	603293	埃泰克	72	2, 442. 96	0. 00
1, 145	002392	北京利尔	300	2, 421. 00	0. 00
1, 146	001312	福恩股份	134	2, 248. 52	0. 00
1, 147	600383	金地集团	1, 000	2, 110. 00	0. 00
1, 148	300634	彩讯股份	100	1, 957. 00	0. 00
1, 149	603248	锡华科技	92	1, 940. 28	0. 00
1, 150	603284	林平发展	46	1, 604. 02	0. 00
1, 151	001220	世盟股份	57	1, 583. 46	0. 00
1, 152	300140	节能环境	300	1, 491. 00	0. 00
1, 153	000725	京东方 A	100	868. 00	0. 00
1, 154	301376	致欧科技	26	460. 72	0. 00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002281	光迅科技	25, 504, 639. 00	3. 36
2	600487	亨通光电	25, 364, 205. 00	3. 34
3	600999	招商证券	24, 207, 596. 00	3. 19
4	000800	一汽解放	23, 619, 538. 05	3. 11
5	001286	陕西能源	22, 475, 605. 00	2. 96
6	002558	巨人网络	22, 047, 422. 80	2. 90
7	002138	顺络电子	21, 989, 759. 00	2. 90
8	000933	神火股份	21, 960, 771. 97	2. 89
9	002746	仙坛股份	21, 901, 961. 00	2. 89
10	000060	中金岭南	21, 687, 652. 63	2. 86
11	600352	浙江龙盛	21, 674, 026. 00	2. 86
12	600189	泉阳泉	21, 076, 659. 00	2. 78
13	600863	华能蒙电	20, 876, 482. 00	2. 75
14	002736	国信证券	20, 673, 897. 00	2. 72
15	688219	会通股份	20, 415, 819. 82	2. 69
16	300857	协创数据	20, 101, 075. 00	2. 65
17	600499	科达制造	20, 034, 744. 00	2. 64

18	600380	健康元	19,742,799.00	2.60
19	603225	新凤鸣	19,336,035.62	2.55
20	300223	北京君正	19,129,780.00	2.52
21	002008	大族激光	19,093,013.00	2.52
22	002064	华峰化学	19,058,635.00	2.51
23	601918	新集能源	18,679,435.00	2.46
24	300041	回天新材	18,579,525.50	2.45
25	300136	信维通信	18,573,112.00	2.45
26	300634	彩讯股份	18,349,561.52	2.42
27	300073	当升科技	18,348,661.00	2.42
28	000415	渤海租赁	18,322,927.00	2.41
29	688410	山外山	18,137,322.67	2.39
30	301487	盟固利	17,953,065.00	2.37
31	603588	高能环境	17,926,309.00	2.36
32	002556	辉隆股份	17,909,940.00	2.36
33	300037	新宙邦	17,800,177.00	2.35
34	000951	中国重汽	17,733,747.63	2.34
35	000783	长江证券	17,705,498.00	2.33
36	301039	中集车辆	17,171,371.00	2.26
37	300604	长川科技	16,960,095.00	2.23
38	600717	天津港	16,726,728.00	2.20
39	002299	圣农发展	16,470,154.00	2.17
40	000683	博源化工	16,457,795.00	2.17
41	300532	今天国际	16,257,770.70	2.14
42	688498	源杰科技	16,221,575.61	2.14
43	601168	西部矿业	16,062,885.00	2.12
44	301238	瑞泰新材	15,793,800.00	2.08
45	601688	华泰证券	15,749,307.00	2.08
46	000949	新乡化纤	15,629,175.00	2.06
47	002057	中钢天源	15,337,991.00	2.02
48	688347	华虹宏力	15,321,446.33	2.02
49	600428	中远海特	15,307,513.00	2.02
50	000581	威孚高科	15,289,603.00	2.01
51	002197	证通电子	15,220,591.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600487	亨通光电	34,574,898.00	4.56
2	002281	光迅科技	25,319,758.86	3.34
3	300041	回天新材	23,980,270.00	3.16
4	600549	厦门钨业	23,919,856.80	3.15
5	601918	新集能源	23,591,810.00	3.11

6	002736	国信证券	23,426,104.00	3.09
7	600999	招商证券	23,157,560.41	3.05
8	603588	高能环境	22,974,237.21	3.03
9	000800	一汽解放	22,587,742.00	2.98
10	688512	慧智微	22,532,187.84	2.97
11	688700	东威科技	22,452,644.10	2.96
12	002138	顺络电子	22,102,027.00	2.91
13	600499	科达制造	22,077,522.07	2.91
14	688410	山外山	21,640,782.19	2.85
15	000060	中金岭南	21,573,067.00	2.84
16	000783	长江证券	20,803,830.00	2.74
17	600189	泉阳泉	19,992,252.00	2.63
18	688219	会通股份	19,961,465.65	2.63
19	000933	神火股份	19,915,336.00	2.62
20	600863	华能蒙电	19,299,714.00	2.54
21	002558	巨人网络	18,925,666.00	2.49
22	002746	仙坛股份	18,880,858.53	2.49
23	001286	陕西能源	18,826,077.00	2.48
24	600380	健康元	18,554,325.00	2.44
25	688525	佰维存储	18,549,464.72	2.44
26	000415	渤海租赁	18,514,253.00	2.44
27	300037	新宙邦	18,399,278.00	2.42
28	600352	浙江龙盛	18,011,277.32	2.37
29	300634	彩讯股份	17,499,870.00	2.31
30	600742	富维股份	17,389,292.00	2.29
31	000951	中国重汽	17,263,124.00	2.27
32	002091	江苏国泰	17,193,526.00	2.27
33	603225	新凤鸣	17,092,983.18	2.25
34	300032	金龙机电	16,949,485.00	2.23
35	002556	辉隆股份	16,856,377.00	2.22
36	300532	今天国际	16,850,021.00	2.22
37	301238	瑞泰新材	16,712,067.58	2.20
38	600011	华能国际	16,664,710.00	2.20
39	301487	盟固利	16,587,949.00	2.19
40	688378	奥来德	16,576,927.15	2.18
41	002436	兴森科技	16,448,530.00	2.17
42	601168	西部矿业	16,193,168.00	2.13
43	300857	协创数据	16,053,465.64	2.12
44	300223	北京君正	15,848,928.00	2.09
45	002057	中钢天源	15,827,767.00	2.09
46	000683	博源化工	15,813,990.17	2.08
47	601108	财通证券	15,720,023.00	2.07
48	688327	云从科技	15,618,414.90	2.06

49	300134	大富科技	15,603,022.00	2.06
50	300136	信维通信	15,450,737.00	2.04
51	300219	鸿利智汇	15,319,565.87	2.02
52	688207	格灵深瞳	15,181,930.51	2.00
53	688556	高测股份	15,180,432.51	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,251,723,261.21
卖出股票收入（成交）总额	5,972,960,263.82

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	56,247,581.31	4.69
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	56,247,581.31	4.69

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	301,000	30,480,026.93	2.54
2	019792	25 国债 19	255,000	25,767,554.38	2.15

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,928,491.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,042,806.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,971,298.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧金安 量化混合 A	4,654	122,929.21	191,946,592.65	33.55%	380,165,966.67	66.45%
中欧金安 量化混合 C	5,732	36,143.03	116,233,196.92	56.10%	90,938,638.08	43.90%
合计	10,386	75,032.20	308,179,789.57	39.55%	471,104,604.75	60.45%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	91.70

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	中欧金安量化混合 A	186,109.74	0.03%
	中欧金安量化混合 C	48,087.88	0.02%
	合计	234,197.62	0.03%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责人 持有本开放式 基金	中欧金安量化混合 A	0
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有	中欧金安量化混合 A	10~50

本开放式基金	中欧金安量化混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 20 日)	893,269,013.78	139,571,239.72
基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	446,952,432.80	125,289,524.88
本报告期基金总申购 份额	636,312,267.79	632,336,185.42
减：本报告期基金总 赎回份额	511,152,141.27	550,453,875.30
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	572,112,559.32	207,171,835.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 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。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中国中金财富证券	3	12, 221, 428, 492. 69	100. 00	1, 860, 003. 03	100. 00	-
国金证券	-	1, 340. 28	0. 00	0. 58	0. 00	本报告期退租 3 个
中泰证券	3	-	-	-	-	本报告期新增 3 个

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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中国中金财富证券	124,359,645.03	100.00	885,136,000.00	100.00	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2025年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧金安量化混合型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“赤峰黄金”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-21
4	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（2025年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2025年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧金安量化混合型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
7	中欧金安量化混合型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2026年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22

9	中欧金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
10	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 01 月 04 日	115,402,797.57	20,385,929.90	1,132,304.98	134,656,422.49	17.28%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日