

中欧量化动力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：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	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	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63

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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 盈利投资者数量占比	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化动力混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化动力混合	
基金主代码	015006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	890,841,156.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
下属分级基金的交易代码	015006	015007
报告期末下属分级基金的份额总额	194,993,818.42 份	695,847,337.59 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，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
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	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，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	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	帅芳
	联系电话	021-68609600	021-38677947
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgrxp@tg.gttht.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	021-38917599-5
传真		021-50190017	021-50872603
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 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	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	窦玉明	朱健

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 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
本期已实现收益	27,518,073.64	67,762,987.08
本期利润	33,613,441.77	83,594,432.81
加权平均基金份 额本期利润	0.3843	0.4055
本期加权平均净 值利润率	26.11%	27.65%
本期基金份额净 值增长率	33.93%	33.53%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	106,240,252.39	351,867,781.62
期末可供分配基 金份额利润	0.5448	0.5057
期末基金资产净 值	320,492,594.46	1,114,200,624.16

期末基金份额净值	1. 6436	1. 6012
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	67. 74%	63. 42%

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

中欧量化动力混合 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	30. 97%	1. 49%	9. 20%	1. 13%	21. 77%	0. 36%
过去六个月	33. 93%	1. 47%	7. 80%	1. 10%	26. 13%	0. 37%
过去一年	65. 05%	1. 24%	24. 92%	0. 96%	40. 13%	0. 28%
过去三年	67. 90%	1. 25%	29. 25%	1. 08%	38. 65%	0. 17%
自基金合同生效起至今	67. 74%	1. 16%	15. 66%	1. 06%	52. 08%	0. 10%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+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。

中欧量化动力混合 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	30. 77%	1. 49%	9. 20%	1. 13%	21. 57%	0. 36%
过去六个月	33. 53%	1. 47%	7. 80%	1. 10%	25. 73%	0. 37%

过去一年	64.06%	1.24%	24.92%	0.96%	39.14%	0.28%
过去三年	64.90%	1.25%	29.25%	1.08%	35.65%	0.17%
自基金合同生效起 至今	63.42%	1.16%	15.66%	1.06%	47.76%	0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+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



§ 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 / 权益专户投决会委员 / 量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-03-02	—	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；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遵规守信情况的说明

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。

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 33.93%，同期业绩比较基准收益率为 7.80%；基金 C 类份额净值增长率为 33.53%，同期业绩比较基准收益率为 7.80%。

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；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，《推动中长期资金入市实施方案》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有望持续释放。

本基金将追求坚持稳健的原则，通过基本面因子与量价因子的特征规律挖掘，力争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，追求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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧量化动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害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真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为其真实、准确和完整。

§ 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：中欧量化动力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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	130,359,602.20	5,524,864.11
结算备付金		1,267,535.18	17,872.77
存出保证金		3,916,766.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,326,536,346.70	107,394,793.68
其中：股票投资		1,300,445,277.55	102,367,424.09
基金投资		-	-
债券投资		26,091,069.15	5,027,369.59
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		-	386,011.36
应收股利		-	-
应收申购款		6,558,511.58	18,991.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,468,638,762.06	113,342,533.35
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		20,334,027.00	2,955,570.43
应付清算款		-	-
应付赎回款		11,763,950.69	374,946.11
应付管理人报酬		1,155,611.33	135,955.39
应付托管费		144,451.40	16,994.43
应付销售服务费		435,896.62	38,326.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31,550.21	752.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,056.19	50,158.99

负债合计		33,945,543.44	3,572,704.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	890,841,156.01	90,404,444.17
未分配利润	6.4.7.8	543,852,062.61	19,365,384.94
净资产合计		1,434,693,218.62	109,769,829.11
负债和净资产总计		1,468,638,762.06	113,342,533.35

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 890,841,156.01 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.6436 元，基金份额总额 194,993,818.42 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.6012 元，基金份额总额 695,847,337.59 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化动力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 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		121,049,420.53	17,329,778.14
1. 利息收入		67,488.30	88,704.27
其中：存款利息收入	6.4.7.9	67,488.30	88,704.27
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）		98,719,602.82	13,496,538.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	93,405,162.35	9,363,402.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	88,293.37	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,176,186.95	66,979.33
股利收益	6.4.7.14	4,049,960.15	4,066,156.74
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	21,926,813.86	3,682,296.27

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	335, 515. 55	62, 238. 93
减：二、营业总支出		3, 841, 545. 95	2, 758, 995. 07
1. 管理人报酬		2, 509, 038. 03	1, 922, 484. 58
2. 托管费		313, 629. 77	240, 310. 59
3. 销售服务费		878, 406. 66	499, 317. 37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		47, 778. 11	-
其中：卖出回购金融资产支出		47, 778. 11	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 17	-	-
7. 税金及附加		4, 345. 29	1, 807. 09
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	88, 348. 09	95, 075. 44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117, 207, 874. 58	14, 570, 783. 07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117, 207, 874. 58	14, 570, 783. 07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		117, 207, 874. 58	14, 570, 783. 07

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化动力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	90, 404, 444. 17	-	19, 365, 384. 94	109, 769, 829. 11
二、本期期初净资产	90, 404, 444. 17	-	19, 365, 384. 94	109, 769, 829. 11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	800, 436, 711. 84	-	524, 486, 677. 67	1, 324, 923, 389. 51
（一）、综合收益总额	-	-	117, 207, 874. 58	117, 207, 874. 58
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	800, 436, 711. 84	-	407, 278, 803. 09	1, 207, 715, 514. 93

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1,027,701,873.61	-	503,481,532.09	1,531,183,405.70
2. 基金赎回款	-227,265,161.77	-	-96,202,729.00	-323,467,890.77
(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	890,841,156.01	-	543,852,062.61	1,434,693,218.62
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	251,507,825.97	-	-20,599,693.81	230,908,132.16
二、本期期初净资产	251,507,825.97	-	-20,599,693.81	230,908,132.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	100,698,314.12	-	15,642,784.00	116,341,098.12
(一)、综合收益总额	-	-	14,570,783.07	14,570,783.07
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	100,698,314.12	-	1,072,000.93	101,770,315.05
其中：1. 基金申购款	257,937,571.82	-	-4,766,104.98	253,171,466.84
2. 基金赎回款	-157,239,257.70	-	5,838,105.91	-151,401,151.79
(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	352,206,140.09	-	-4,956,909.81	347,249,230.28
-----------	----------------	---	---------------	----------------

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

中欧量化动力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[2022]77 号文《关于准予中欧量化动力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《中欧量化动力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 324,023,694.26 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_B18 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 324,069,096.67 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 45,402.41 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 115,946,789.67 份，包含认购利息折合 16,331.99 份；C 类基金的基金份额总额为 208,122,307.00 份，包含认购利息折合 29,070.42 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	1,001,675.83
等于：本金	1,000,099.05
加：应计利息	1,576.78
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	129,357,926.37
等于：本金	129,351,338.22
加：应计利息	6,588.15
减：坏账准备	-
合计	130,359,602.20

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		1,273,627,540.19	-	1,300,445,277.55	26,817,737.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,815,391.25	279,929.15	26,091,069.15	-4,251.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,815,391.25	279,929.15	26,091,069.15	-4,251.25
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,299,442,931.44	279,929.15	1,326,536,346.70	26,813,486.11

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		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	31,735,070.00	-	-	-
其中：股指期货投资	31,735,070.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	31,735,070.00	-	-	-

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	4.00	7,142,560.00	201,760.00
IC2609	IC2609	2.00	3,504,560.00	80,600.00
IC2612	IC2612	4.00	6,833,920.00	653,980.00
IF2607	IF2607	2.00	2,953,200.00	-2,070.00
IF2609	IF2609	6.00	8,729,640.00	-36,180.00
IM2607	IM2607	2.00	3,475,840.00	6,560.00
合计				904,650.00
减：可抵销期货暂收款				904,650.00
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	406.24
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
其他应付	104.55
预提费用-审计费	19,835.79
应付转出费	202.24
合计	80,056.19

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化动力混合 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	48,611,276.73	48,611,276.73
本期申购	187,653,199.42	187,653,199.42
本期赎回（以“-”号填列）	-41,270,657.73	-41,270,657.73
本期末	194,993,818.42	194,993,818.42

中欧量化动力混合 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	41,793,167.44	41,793,167.44
本期申购	840,048,674.19	840,048,674.19
本期赎回（以“-”号填列）	-185,994,504.04	-185,994,504.04

本期末	695,847,337.59	695,847,337.59
-----	----------------	----------------

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

中欧量化动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,140,668.39	-95,362.81	11,045,305.58
本期期初	11,140,668.39	-95,362.81	11,045,305.58
本期利润	27,518,073.64	6,095,368.13	33,613,441.77
本期基金份额交易产生的变动数	67,581,510.36	13,258,518.33	80,840,028.69
其中：基金申购款	83,280,468.71	14,547,252.29	97,827,721.00
基金赎回款	-15,698,958.35	-1,288,733.96	-16,987,692.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,240,252.39	19,258,523.65	125,498,776.04

中欧量化动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,432,337.39	-112,258.03	8,320,079.36
本期期初	8,432,337.39	-112,258.03	8,320,079.36
本期利润	67,762,987.08	15,831,445.73	83,594,432.81
本期基金份额交易产生的变动数	275,672,457.15	50,766,317.25	326,438,774.40
其中：基金申购款	346,581,292.37	59,072,518.72	405,653,811.09
基金赎回款	-70,908,835.22	-8,306,201.47	-79,215,036.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	351,867,781.62	66,485,504.95	418,353,286.57

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	5,912.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	33,436.15
结算备付金利息收入	9,902.05
其他	18,237.84
合计	67,488.30

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	4,139,266,146.71
减：卖出股票成本总额	4,039,113,519.17
减：交易费用	6,747,465.19
买卖股票差价收入	93,405,162.35

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	88,647.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-353.75
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	88,293.37

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	6,049,133.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,003,763.75
减：应计利息总额	45,723.03
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-353.75

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	1,176,186.95

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	4,049,960.15
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	4,049,960.15

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	21,022,163.86
股票投资	21,028,625.11
债券投资	-6,461.25
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	904,650.00
权证投资	-
期货投资	904,650.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	21,926,813.86

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	325,768.65
基金转换费收入	9,746.90
合计	335,515.55

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
证券组合费	4.93
合计	88,348.09

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
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金托管人、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 （%）
国泰海通	3,849,571,980.54	41.15	1,935,998,117.36	35.58

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
国泰海通	29,037,940.32	87.78	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
国泰海通	244,610,000.00	96.99	-	-

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（%）
国泰海通	1,678,166.08	41.16	-	-
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（%）
国泰海通	869,339.10	36.26	-	-

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 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管理费	2,509,038.03	1,922,484.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	453,225.51	561,962.48

应支付基金管理人的净管理费	2,055,812.52	1,360,522.10
---------------	--------------	--------------

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	313,629.77	240,310.59

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

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	0.00	67,194.32	67,194.32
中欧财富	0.00	340.44	340.44
中欧基金	0.00	520,756.59	520,756.59
合计	0.00	588,291.35	588,291.35
获得销售服务费的各关联	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		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	0.00	129,772.35	129,772.35
中欧财富	0.00	2.20	2.20
中欧基金	0.00	128,174.30	128,174.30
合计	0.00	257,948.85	257,948.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 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 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

中欧量化动力混合 A

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	1, 075, 169. 82	0. 55%	397, 236. 94	0. 82%

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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
国泰海通证券股份有限公司	51, 635, 748. 45	9, 547. 24	17, 285, 494. 22	23, 923. 46

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰海通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	2026 年 1 月 27	6 个月	新股流通受限	28. 00	27. 78	29	812. 00	805. 62	-

	份	日								
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	91	4,846.66	5,345.34	-
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	28,141	284,505.51	284,505.51	-
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	12,060	121,926.60	121,926.60	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	697	5,450.54	14,455.78	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	84	1,543.92	1,409.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	226	6,144.94	7,076.06	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	157	4,769.66	6,121.43	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	4,730	47,867.60	131,162.90	-
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	249	3,311.70	12,838.44	-
301669	高	2026	6个月	新股	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

	特电子	年 6 月 2 日		流通受限						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	86	4,988.00	9,645.76	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	198	13,792.68	31,691.88	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	37	2,900.06	4,505.49	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	23	871.24	802.01	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	40	1,339.60	1,357.20	-
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	99	1,560.24	4,624.29	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	110	1,947.00	9,275.20	-
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	54	4,421.52	85,553.82	-
688811	有	2026	6 个月	新股	6.41	24.13	604	3,871.64	14,574.52	-

	研 复 材	年 4 月 1 日		流通 受限						
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.09	128	3,363.84	22,027.52	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	55.95	57.10	46	2,573.70	2,626.60	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	19.68	141.49	335	6,592.80	47,399.15	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 20,334,027.00 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。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

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	130,359,602.20	-	-	-	130,359,602.20
结算备付金	1,267,535.18	-	-	-	1,267,535.18
存出保证金	-	-	-	3,916,766.40	3,916,766.40
交易性金融资产	26,091,069.15	-	-	1,300,445,277.55	1,326,536,346.70
应收申购款	-	-	-	6,558,511.58	6,558,511.58
资产总计	157,718,206.53	-	-	1,310,920,555.53	1,468,638,762.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,763,950.69	11,763,950.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,155,611.33	1,155,611.33
应付托管费	-	-	-	144,451.40	144,451.40
卖出回购金融资产款	20,334,027.00	-	-	-	20,334,027.00
应付销售服务费	-	-	-	435,896.62	435,896.62
应交税费	-	-	-	31,550.21	31,550.21
其他负债	-	-	-	80,056.19	80,056.19
负债总计	20,334,027.00	-	-	13,611,516.44	33,945,543.44
利率敏感度缺口	137,384,179.53	-	-	1,297,309,039.09	1,434,693,218.62
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	5,524,864.11	-	-	-	5,524,864.11
结算备付金	17,872.77	-	-	-	17,872.77
交易性金融资产	5,027,369.59	-	-	102,367,424.09	107,394,793.68
应收申购款	-	-	-	18,991.43	18,991.43
应收清算款	-	-	-	386,011.36	386,011.36
资产总计	10,570,106.47	-	-	102,772,426.88	113,342,533.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	374,946.11	374,946.11
应付管理人报酬	-	-	-	135,955.39	135,955.39
应付托管费	-	-	-	16,994.43	16,994.43
卖出回购金融资产款	2,955,570.43	-	-	-	2,955,570.43
应付销售服务费	-	-	-	38,326.25	38,326.25
应交税费	-	-	-	752.64	752.64
其他负债	-	-	-	50,158.99	50,158.99
负债总计	2,955,570.43	-	-	617,133.81	3,572,704.24
利率敏感度缺口	7,614,536.04	-	-	102,155,293.07	109,769,829.11

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 1.82%（2025 年 12 月 31 日：4.58%），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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	874,669.21	-	874,669.21
资产合计	-	874,669.21	-	874,669.21
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	874,669.21	-	874,669.21

6.4.13.4.2.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 5%	-	-43,733.46
	港币相对人民币升值 5%	-	43,733.46

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	1,300,445,277.55	90.64	102,367,424.09	93.26
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	1,300,445,277.55	90.64	102,367,424.09	93.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	88,374,069.07	6,395,040.44
	业绩比较基准下降 5%	-88,374,069.07	-6,395,040.44

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	1,299,495,929.32	102,004,946.38
第二层次	26,497,501.26	5,027,369.59
第三层次	542,916.12	362,477.71
合计	1,326,536,346.70	107,394,793.68

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	1,300,445,277.55	88.55
	其中：股票	1,300,445,277.55	88.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	26,091,069.15	1.78
	其中：债券	26,091,069.15	1.78
	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	131,627,137.38	8.96
8	其他各项资产	10,475,277.98	0.71
9	合计	1,468,638,762.06	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	—	—

B	采矿业	70,615,773.68	4.92
C	制造业	976,095,488.44	68.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,890,945.11	1.25
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	18,941,188.00	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	44,139,428.62	3.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,246,133.05	5.87
J	金融业	51,391,958.00	3.58
K	房地产业	24,265,979.00	1.69
L	租赁和商务服务业	1,453,368.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	9,922,154.77	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	1,482,860.88	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,300,445,277.55	90.64

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	002810	山东赫达	1,201,200	29,669,640.00	2.07
2	300382	斯莱克	1,155,000	26,692,050.00	1.86
3	600988	赤峰黄金	980,600	25,809,392.00	1.80
4	002179	中航光电	558,400	25,798,080.00	1.80
5	688001	华兴源创	300,298	25,735,538.60	1.79
6	603713	密尔克卫	351,200	24,994,904.00	1.74
7	300308	中际旭创	19,500	24,765,000.00	1.73
8	002831	裕同科技	692,682	24,631,771.92	1.72
9	301393	昊帆生物	379,500	24,580,215.00	1.71
10	301310	鑫宏业	437,980	24,194,015.20	1.69
11	000962	东方钨业	264,200	23,936,520.00	1.67
12	002990	盛视科技	257,800	20,366,200.00	1.42
13	002429	兆驰股份	1,871,700	19,446,963.00	1.36
14	002602	世纪华通	1,379,100	19,445,310.00	1.36
15	603697	有友食品	2,009,900	19,274,941.00	1.34

16	688306	均普智能	1,884,220	19,030,622.00	1.33
17	600397	江钨装备	695,600	18,941,188.00	1.32
18	000100	TCL 科技	3,226,300	18,777,066.00	1.31
19	688755	汉邦科技	679,734	18,733,469.04	1.31
20	300776	帝尔激光	85,800	18,443,568.00	1.29
21	600105	永鼎股份	269,000	18,152,120.00	1.27
22	603605	珀莱雅	301,800	18,083,856.00	1.26
23	300285	国瓷材料	174,400	17,994,592.00	1.25
24	300731	科创新源	304,840	17,790,462.40	1.24
25	002290	禾盛新材	193,500	17,776,845.00	1.24
26	002246	北化股份	941,100	17,692,680.00	1.23
27	688981	中芯国际	111,297	17,676,189.54	1.23
28	301095	广立微	149,400	17,636,670.00	1.23
29	300435	中泰股份	645,900	17,484,513.00	1.22
30	600522	中天科技	286,700	17,396,956.00	1.21
31	300957	贝泰妮	552,000	17,393,520.00	1.21
32	000951	中国重汽	890,199	17,367,782.49	1.21
33	600549	厦门钨业	203,600	17,346,720.00	1.21
34	603308	应流股份	286,600	17,310,640.00	1.21
35	300502	新易盛	28,500	17,299,500.00	1.21
36	002594	比亚迪	216,900	17,286,930.00	1.20
37	002409	雅克科技	77,000	17,286,500.00	1.20
38	600926	杭州银行	1,192,600	17,233,070.00	1.20
39	301362	民爆光电	93,600	17,214,912.00	1.20
40	000099	中信海直	1,179,300	17,170,608.00	1.20
41	600919	江苏银行	1,592,100	17,162,838.00	1.20
42	688331	荣昌生物	131,705	17,155,893.30	1.20
43	688256	寒武纪	10,741	17,137,802.55	1.19
44	601088	中国神华	438,200	17,107,328.00	1.19
45	600999	招商证券	805,500	16,996,050.00	1.18
46	002080	中材科技	188,700	16,983,000.00	1.18
47	601233	桐昆股份	781,700	16,923,805.00	1.18
48	601001	晋控煤业	964,200	16,767,438.00	1.17
49	002008	大族激光	111,400	16,722,254.00	1.17
50	002299	圣农发展	1,099,600	16,669,936.00	1.16
51	605376	博迁新材	61,100	16,576,430.00	1.16
52	600208	衢州发展	5,831,300	16,502,579.00	1.15
53	002906	华阳集团	592,300	14,783,808.00	1.03
54	688362	甬矽电子	107,233	10,337,261.20	0.72
55	605288	凯迪股份	115,700	9,817,145.00	0.68
56	605198	安德利	134,500	8,521,920.00	0.59
57	300596	利安隆	159,200	8,354,816.00	0.58
58	002536	飞龙股份	169,100	7,978,138.00	0.56

59	600186	莲花控股	566,600	7,932,400.00	0.55
60	688079	美迪凯	257,197	7,908,807.75	0.55
61	601636	旗滨集团	768,600	7,862,778.00	0.55
62	002645	华宏科技	283,700	7,804,587.00	0.54
63	002965	祥鑫科技	152,500	7,769,875.00	0.54
64	600246	万通发展	408,600	7,763,400.00	0.54
65	300203	聚光科技	558,700	7,726,821.00	0.54
66	601579	会稽山	521,600	7,662,304.00	0.53
67	002517	恺英网络	466,762	7,584,882.50	0.53
68	002674	兴业科技	265,400	7,571,862.00	0.53
69	603773	沃格光电	46,200	7,529,214.00	0.52
70	688428	诺诚健华	263,809	7,510,642.23	0.52
71	601168	西部矿业	276,300	7,498,782.00	0.52
72	600177	雅戈尔	993,076	7,477,862.28	0.52
73	600962	国投中鲁	243,800	7,355,446.00	0.51
74	603288	海天味业	221,404	7,341,756.64	0.51
75	002545	东方铁塔	450,500	7,307,110.00	0.51
76	600352	浙江龙盛	597,000	7,229,670.00	0.50
77	002563	森马服饰	1,406,100	7,086,744.00	0.49
78	000801	四川九洲	526,600	6,814,204.00	0.47
79	300814	中富电路	23,700	4,846,650.00	0.34
80	688010	福光股份	47,710	2,320,137.30	0.16
81	603407	长裕集团	21,182	2,241,254.92	0.16
82	002518	科士达	41,400	2,218,626.00	0.15
83	688332	中科蓝讯	14,015	2,207,362.50	0.15
84	688179	阿拉丁	79,063	2,190,835.73	0.15
85	603011	合锻智能	65,300	2,160,124.00	0.15
86	002558	巨人网络	75,300	2,075,268.00	0.14
87	301080	百普赛斯	42,967	2,062,416.00	0.14
88	688710	益诺思	30,125	2,024,400.00	0.14
89	000799	酒鬼酒	46,300	2,023,310.00	0.14
90	002821	凯莱英	12,200	1,976,400.00	0.14
91	601872	招商轮船	112,300	1,973,111.00	0.14
92	603919	金徽酒	129,900	1,954,995.00	0.14
93	301580	爱迪特	29,480	1,896,448.40	0.13
94	002947	恒铭达	24,900	1,893,645.00	0.13
95	300570	太辰光	7,600	1,874,996.00	0.13
96	688686	奥普特	10,998	1,851,953.22	0.13
97	301365	矩阵股份	48,700	1,846,217.00	0.13
98	688478	晶升股份	20,698	1,832,807.90	0.13
99	603886	元祖股份	143,100	1,828,818.00	0.13
100	603259	药明康德	14,400	1,792,944.00	0.12
101	603800	洪田股份	21,800	1,772,122.00	0.12

102	300857	协创数据	5,200	1,767,480.00	0.12
103	600259	中稀有色	17,100	1,737,531.00	0.12
104	688411	海博思创	5,948	1,732,057.60	0.12
105	603683	晶华新材	55,500	1,710,510.00	0.12
106	300811	铂科新材	17,900	1,698,531.00	0.12
107	600188	兖矿能源	94,300	1,675,711.00	0.12
108	688388	嘉元科技	37,860	1,665,840.00	0.12
109	300146	汤臣倍健	183,400	1,657,936.00	0.12
110	000338	潍柴动力	60,700	1,654,075.00	0.12
111	000700	模塑科技	108,100	1,595,556.00	0.11
112	600500	中化国际	203,700	1,594,971.00	0.11
113	300620	光库科技	4,200	1,588,440.00	0.11
114	688607	康众医疗	30,855	1,573,605.00	0.11
115	603500	祥和实业	134,600	1,564,052.00	0.11
116	002491	通鼎互联	46,800	1,516,320.00	0.11
117	000636	风华高科	20,600	1,488,144.00	0.10
118	688485	九州一轨	23,148	1,482,860.88	0.10
119	600418	江淮汽车	56,800	1,467,144.00	0.10
120	605168	三人行	28,700	1,453,368.00	0.10
121	600409	三友化工	237,400	1,450,514.00	0.10
122	002688	金河生物	284,800	1,315,776.00	0.09
123	001248	华润新能源	40,201	406,432.11	0.03
124	001399	惠科股份	4,730	131,162.90	0.01
125	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
126	688808	联讯仪器	54	85,553.82	0.01
127	301536	星辰科技	481	61,909.51	0.00
128	688820	盛合晶微	335	47,399.15	0.00
129	688472	阿特斯	3,514	38,021.48	0.00
130	301682	宏明电子	198	31,691.88	0.00
131	001359	平安电工	239	29,934.75	0.00
132	688813	泰金新能	128	22,027.52	0.00
133	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
134	688811	有研复材	604	14,574.52	0.00
135	001257	盛龙股份	697	14,455.78	0.00
136	301531	春光集团	249	12,838.44	0.00
137	301680	固德电材	86	9,645.76	0.00
138	603459	红板科技	110	9,275.20	0.00
139	301277	新天地	867	7,586.25	0.00
140	001365	天海电子	226	7,076.06	0.00
141	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
142	001393	维通利	157	6,121.43	0.00
143	001237	惠康科技	91	5,345.34	0.00
144	301601	惠通科技	342	5,342.04	0.00

145	001280	中国铀业	77	5,135.90	0.00
146	603435	嘉德利	99	4,624.29	0.00
147	301683	慧谷新材	37	4,505.49	0.00
148	301667	纳百川	51	3,688.32	0.00
149	688816	易思维	46	2,626.60	0.00
150	001312	福恩股份	84	1,409.52	0.00
151	603293	埃泰克	40	1,357.20	0.00
152	001220	世盟股份	29	805.62	0.00
153	603284	林平发展	23	802.01	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	002602	世纪华通	67,321,613.00	61.33
2	603938	三孚股份	58,230,337.00	53.05
3	002080	中材科技	52,054,493.00	47.42
4	300308	中际旭创	49,305,052.32	44.92
5	000893	亚钾国际	45,812,521.00	41.74
6	002831	裕同科技	42,636,538.99	38.84
7	301362	民爆光电	42,020,912.60	38.28
8	301095	广立微	40,853,050.00	37.22
9	300776	帝尔激光	40,620,303.00	37.00
10	603259	药明康德	40,531,833.00	36.92
11	688331	荣昌生物	37,664,556.97	34.31
12	300285	国瓷材料	37,306,995.01	33.99
13	600208	衢州发展	37,077,537.00	33.78
14	000099	中信海直	36,760,375.00	33.49
15	603179	新泉股份	36,481,170.60	33.23
16	000962	东方钽业	36,384,103.00	33.15
17	002810	山东赫达	34,443,767.38	31.38
18	688031	星环科技	34,158,659.34	31.12
19	000951	中国重汽	33,567,951.59	30.58
20	600926	杭州银行	32,643,724.00	29.74
21	301281	科源制药	32,620,344.16	29.72
22	300502	新易盛	31,666,338.00	28.85
23	600988	赤峰黄金	31,235,773.48	28.46
24	688456	有研粉材	30,565,599.54	27.85
25	600105	永鼎股份	30,309,740.96	27.61
26	603605	珀莱雅	30,174,913.00	27.49
27	688256	寒武纪	29,664,869.06	27.02
28	000630	铜陵有色	29,613,870.51	26.98
29	600418	江淮汽车	29,469,092.01	26.85
30	300811	铂科新材	29,422,920.40	26.80

31	600378	昊华科技	29,340,827.00	26.73
32	603697	有友食品	29,198,790.00	26.60
33	002906	华阳集团	28,851,072.50	26.28
34	002179	中航光电	28,712,215.06	26.16
35	688001	华兴源创	27,983,190.32	25.49
36	300731	科创新源	27,362,573.80	24.93
37	600309	万华化学	27,174,865.50	24.76
38	603713	密尔克卫	27,025,238.00	24.62
39	601001	晋控煤业	27,011,389.84	24.61
40	600397	江钨装备	26,763,310.00	24.38
41	603308	应流股份	26,742,615.94	24.36
42	000426	兴业银锡	26,182,849.70	23.85
43	002488	金固股份	26,119,205.00	23.79
44	688755	汉邦科技	25,907,029.83	23.60
45	300382	斯莱克	25,514,753.00	23.24
46	688306	均普智能	25,376,607.84	23.12
47	002409	雅克科技	25,299,315.17	23.05
48	002246	北化股份	25,204,757.30	22.96
49	601138	工业富联	25,165,864.00	22.93
50	688012	中微公司	25,001,746.95	22.78
51	002008	大族激光	24,988,700.00	22.76
52	002213	大为股份	24,945,448.98	22.73
53	688332	中科蓝讯	24,884,561.18	22.67
54	301393	昊帆生物	24,789,376.00	22.58
55	301310	鑫宏业	24,414,217.80	22.24
56	300957	贝泰妮	24,377,522.00	22.21
57	688717	艾罗能源	24,373,510.27	22.20
58	002594	比亚迪	24,341,185.00	22.17
59	688710	益诺思	24,204,087.63	22.05
60	600141	兴发集团	23,920,978.00	21.79
61	002290	禾盛新材	23,787,449.00	21.67
62	002429	兆驰股份	23,776,751.00	21.66
63	605376	博迁新材	23,662,492.00	21.56
64	300570	太辰光	23,537,031.20	21.44
65	600458	时代新材	23,448,805.00	21.36
66	600841	动力新科	23,321,678.00	21.25
67	002990	盛视科技	23,316,400.00	21.24
68	600999	招商证券	23,259,314.00	21.19
69	301468	博盈特焊	23,224,861.32	21.16
70	002785	万里石	23,113,326.88	21.06
71	300814	中富电路	23,051,610.00	21.00
72	000403	派林生物	22,710,146.90	20.69
73	601088	中国神华	22,707,342.00	20.69

74	002299	圣农发展	22,487,015.00	20.49
75	301231	荣信文化	22,225,175.78	20.25
76	601872	招商轮船	21,965,530.00	20.01
77	000688	国城矿业	21,908,178.00	19.96
78	600031	三一重工	21,784,272.00	19.85
79	688300	联瑞新材	21,746,746.41	19.81
80	688146	中船特气	21,715,070.74	19.78
81	600258	首旅酒店	21,703,016.00	19.77
82	601233	桐昆股份	21,370,960.34	19.47
83	600549	厦门钨业	21,317,903.00	19.42
84	600483	福能股份	21,305,679.00	19.41
85	002865	钧达股份	21,205,668.44	19.32
86	688258	卓易信息	21,142,994.29	19.26
87	603112	华翔股份	21,127,380.00	19.25
88	600331	宏达股份	21,073,018.75	19.20
89	600522	中天科技	20,938,854.00	19.08
90	300785	值得买	20,766,686.00	18.92
91	600487	亨通光电	20,731,651.00	18.89
92	688981	中芯国际	20,602,339.75	18.77
93	002938	鹏鼎控股	20,457,436.00	18.64
94	603678	火炬电子	20,403,489.61	18.59
95	688091	上海谊众	20,370,333.52	18.56
96	301526	国际复材	20,091,643.41	18.30
97	605599	菜百股份	19,861,654.00	18.09
98	002847	盐津铺子	19,749,167.41	17.99
99	002001	新 和 成	19,711,003.12	17.96
100	002384	东山精密	19,498,788.20	17.76
101	300863	卡倍亿	19,470,317.20	17.74
102	688266	泽璟制药	19,441,394.22	17.71
103	300972	万辰集团	19,268,719.60	17.55
104	603011	合锻智能	18,753,688.00	17.08
105	301246	宏源药业	18,457,667.00	16.81
106	600919	江苏银行	18,414,411.00	16.78
107	300435	中泰股份	18,391,263.00	16.75
108	600601	方正科技	18,386,799.00	16.75
109	603195	公牛集团	18,237,144.32	16.61
110	000100	TCL 科技	17,800,218.00	16.22
111	603103	横店影视	17,780,836.68	16.20
112	600301	华锡有色	17,356,395.00	15.81
113	000977	浪潮信息	16,971,622.00	15.46
114	300398	飞凯材料	16,905,835.00	15.40
115	688392	骄成超声	16,847,606.19	15.35
116	300161	华中数控	16,770,178.00	15.28

117	300201	海伦哲	16,604,521.00	15.13
118	300390	天华新能	16,082,693.40	14.65
119	603823	百合花	15,974,352.60	14.55
120	002552	宝鼎科技	15,869,188.00	14.46
121	300222	科大智能	15,850,550.00	14.44
122	002371	北方华创	15,706,738.00	14.31
123	688690	纳微科技	15,435,780.80	14.06
124	300750	宁德时代	15,413,346.00	14.04
125	601689	拓普集团	15,312,988.00	13.95
126	600060	海信视像	15,220,516.00	13.87
127	605288	凯迪股份	15,217,224.20	13.86
128	600754	锦江酒店	15,165,652.00	13.82
129	002536	飞龙股份	15,155,277.00	13.81
130	300133	华策影视	14,999,141.00	13.66
131	000729	燕京啤酒	14,798,564.00	13.48
132	002568	百润股份	14,516,034.20	13.22
133	600499	科达制造	14,255,397.00	12.99
134	688379	华光新材	14,163,659.06	12.90
135	603087	甘李药业	14,043,527.00	12.79
136	002555	三七互娱	14,019,052.00	12.77
137	300408	三环集团	14,003,274.00	12.76
138	605589	圣泉集团	13,593,111.00	12.38
139	688785	恒运昌	13,547,862.70	12.34
140	603269	海鸥股份	13,486,963.00	12.29
141	603876	鼎胜新材	13,479,861.00	12.28
142	600519	贵州茅台	13,050,617.00	11.89
143	688133	泰坦科技	12,926,479.82	11.78
144	002558	巨人网络	12,821,262.00	11.68
145	002645	华宏科技	12,763,877.23	11.63
146	600352	浙江龙盛	12,697,873.97	11.57
147	001376	百通能源	12,650,472.00	11.52
148	600186	莲花控股	12,632,392.00	11.51
149	002465	海格通信	12,413,147.00	11.31
150	605499	东鹏饮料	12,361,075.79	11.26
151	688006	杭可科技	12,280,990.36	11.19
152	603919	金徽酒	12,200,025.00	11.11
153	301285	鸿日达	12,162,817.34	11.08
154	000801	四川九洲	12,073,189.00	11.00
155	688362	甬矽电子	11,761,279.20	10.71
156	003036	泰坦股份	11,686,133.00	10.65
157	688361	中科飞测	11,631,395.52	10.60
158	603061	金海通	11,555,829.00	10.53
159	688759	必贝特	11,534,139.51	10.51

160	300033	同花顺	11, 519, 703. 60	10. 49
161	001203	大中矿业	11, 481, 519. 00	10. 46
162	300818	耐普矿机	11, 404, 982. 00	10. 39
163	000636	风华高科	11, 263, 922. 73	10. 26
164	000338	潍柴动力	11, 259, 986. 00	10. 26
165	300223	北京君正	11, 259, 305. 53	10. 26
166	002859	洁美科技	11, 217, 708. 00	10. 22
167	300774	倍杰特	11, 097, 037. 00	10. 11
168	002138	顺络电子	11, 071, 500. 00	10. 09
169	600183	生益科技	11, 065, 232. 00	10. 08
170	002796	世嘉科技	10, 967, 727. 00	9. 99
171	688388	嘉元科技	10, 909, 463. 54	9. 94
172	002317	众生药业	10, 763, 749. 00	9. 81
173	603926	铁流股份	10, 541, 720. 00	9. 60
174	688268	华特气体	10, 467, 966. 29	9. 54
175	300274	阳光电源	10, 367, 972. 00	9. 45
176	300816	艾可蓝	10, 321, 506. 00	9. 40
177	301319	唯特偶	10, 228, 798. 00	9. 32
178	603725	天安新材	10, 227, 676. 52	9. 32
179	600160	巨化股份	10, 195, 700. 00	9. 29
180	300567	精测电子	10, 182, 465. 00	9. 28
181	603132	金徽股份	10, 164, 340. 00	9. 26
182	002149	西部材料	10, 129, 224. 00	9. 23
183	002985	北摩高科	9, 990, 791. 00	9. 10
184	002203	海亮股份	9, 961, 661. 00	9. 08
185	300835	龙磁科技	9, 893, 273. 00	9. 01
186	600246	万通发展	9, 810, 240. 51	8. 94
187	002142	宁波银行	9, 758, 473. 50	8. 89
188	300149	睿智医药	9, 625, 481. 50	8. 77
189	002206	海 利 得	9, 594, 593. 00	8. 74
190	688426	康为世纪	9, 512, 768. 79	8. 67
191	600690	海尔智家	9, 113, 267. 00	8. 30
192	300842	帝科股份	9, 023, 708. 76	8. 22
193	688206	概伦电子	8, 897, 547. 70	8. 11
194	603059	倍加洁	8, 877, 290. 00	8. 09
195	300683	海特生物	8, 853, 021. 00	8. 07
196	601579	会稽山	8, 672, 385. 00	7. 90
197	002493	荣盛石化	8, 650, 094. 00	7. 88
198	001206	依依股份	8, 637, 906. 09	7. 87
199	002812	恩捷股份	8, 585, 139. 00	7. 82
200	605198	安德利	8, 546, 362. 00	7. 79
201	688123	聚辰股份	8, 487, 345. 67	7. 73
202	002563	森马服饰	8, 476, 913. 00	7. 72

203	000833	粤桂股份	8,365,118.00	7.62
204	601619	嘉泽新能	8,364,827.34	7.62
205	600962	国投中鲁	8,329,168.00	7.59
206	600176	中国巨石	8,178,527.00	7.45
207	600722	金牛化工	8,166,246.00	7.44
208	688545	兴福电子	8,136,514.62	7.41
209	603773	沃格光电	8,063,751.00	7.35
210	600603	广汇物流	8,055,287.00	7.34
211	688079	美迪凯	7,973,800.21	7.26
212	300203	聚光科技	7,971,094.00	7.26
213	300263	隆华科技	7,841,774.00	7.14
214	601318	中国平安	7,792,392.00	7.10
215	601636	旗滨集团	7,748,387.00	7.06
216	603288	海天味业	7,730,798.72	7.04
217	300596	利安隆	7,707,579.00	7.02
218	002965	祥鑫科技	7,695,931.08	7.01
219	688428	诺诚健华	7,690,553.90	7.01
220	600036	招商银行	7,647,818.00	6.97
221	300475	香农芯创	7,643,380.00	6.96
222	000596	古井贡酒	7,620,530.84	6.94
223	600590	泰豪科技	7,573,442.00	6.90
224	002674	兴业科技	7,572,763.00	6.90
225	002545	东方铁塔	7,471,984.00	6.81
226	002517	恺英网络	7,460,143.08	6.80
227	002159	三特索道	7,452,867.00	6.79
228	600177	雅戈尔	7,362,655.12	6.71
229	300938	信测标准	7,361,917.00	6.71
230	002487	大金重工	7,350,076.00	6.70
231	601168	西部矿业	7,337,486.90	6.68
232	688519	南亚新材	7,270,964.03	6.62
233	600980	北矿科技	7,215,928.00	6.57
234	301248	杰创智能	7,124,407.14	6.49
235	301308	江波龙	7,023,092.00	6.40
236	688382	益方生物	6,989,132.05	6.37
237	688396	华润微	6,979,161.38	6.36
238	301580	爱迪特	6,957,788.12	6.34
239	002867	周大生	6,813,285.00	6.21
240	688020	方邦股份	6,705,050.13	6.11
241	601231	环旭电子	6,606,821.00	6.02
242	603045	福达合金	6,534,233.00	5.95
243	688809	强一股份	6,485,956.75	5.91
244	002444	巨星科技	6,469,285.00	5.89
245	300943	春晖智控	6,432,015.00	5.86

246	600188	兖矿能源	6,349,000.00	5.78
247	000534	万泽股份	6,281,155.70	5.72
248	002688	金河生物	6,241,886.00	5.69
249	603407	长裕集团	6,230,499.68	5.68
250	603186	华正新材	6,214,197.00	5.66
251	300146	汤臣倍健	6,212,145.00	5.66
252	603156	养元饮品	6,202,185.00	5.65
253	603031	安孚科技	6,168,832.00	5.62
254	603683	晶华新材	6,153,526.07	5.61
255	300113	顺网科技	6,146,204.00	5.60
256	300857	协创数据	6,125,447.00	5.58
257	001389	广合科技	6,084,697.00	5.54
258	688686	奥普特	6,057,023.68	5.52
259	688127	蓝特光学	6,011,328.29	5.48
260	688478	晶升股份	6,009,431.95	5.47
261	688179	阿拉丁	5,950,886.77	5.42
262	300003	乐普医疗	5,919,873.00	5.39
263	688010	福光股份	5,918,960.99	5.39
264	688037	芯源微	5,913,387.83	5.39
265	603500	祥和实业	5,912,478.00	5.39
266	000799	酒鬼酒	5,884,394.00	5.36
267	600259	中稀有色	5,855,008.00	5.33
268	002357	富临运业	5,832,601.00	5.31
269	688503	聚和材料	5,822,876.51	5.30
270	688257	新锐股份	5,812,992.85	5.30
271	301626	苏州天脉	5,778,667.00	5.26
272	600276	恒瑞医药	5,741,626.00	5.23
273	688008	澜起科技	5,723,314.92	5.21
274	601975	招商南油	5,651,878.00	5.15
275	002624	完美世界	5,629,794.00	5.13
276	002637	赞宇科技	5,611,786.00	5.11
277	300059	东方财富	5,589,272.00	5.09
278	301080	百普赛斯	5,564,205.45	5.07
279	000768	中航西飞	5,547,029.00	5.05
280	002491	通鼎互联	5,508,428.00	5.02
281	605016	百龙创园	5,501,408.00	5.01
282	002957	科瑞技术	5,492,870.00	5.00
283	688208	道通科技	5,462,267.30	4.98
284	601857	中国石油	5,435,316.00	4.95
285	002821	凯莱英	5,428,036.00	4.94
286	688365	光云科技	5,395,934.17	4.92
287	300438	鹏辉能源	5,385,987.00	4.91
288	603886	元祖股份	5,362,127.00	4.88

289	002870	香山股份	5,322,157.00	4.85
290	603400	华之杰	5,317,167.00	4.84
291	002947	恒铭达	5,294,488.00	4.82
292	688498	源杰科技	5,256,052.30	4.79
293	603757	大元泵业	5,248,440.62	4.78
294	300131	英唐智控	5,217,092.00	4.75
295	605117	德业股份	5,136,731.00	4.68
296	300246	宝莱特	5,129,009.00	4.67
297	605133	嵘泰股份	5,124,545.00	4.67
298	002092	中泰化学	5,089,032.79	4.64
299	002027	分众传媒	5,075,269.00	4.62
300	301529	福赛科技	5,072,121.00	4.62
301	605196	华通线缆	5,052,311.00	4.60
302	603345	安井食品	5,051,069.00	4.60
303	000957	中通客车	5,038,599.00	4.59
304	600233	圆通速递	5,007,253.38	4.56
305	600406	国电南瑞	4,985,562.00	4.54
306	603228	景旺电子	4,850,404.00	4.42
307	600500	中化国际	4,806,934.00	4.38
308	601377	兴业证券	4,752,065.00	4.33
309	603600	永艺股份	4,740,693.00	4.32
310	300620	光库科技	4,702,121.00	4.28
311	002468	申通快递	4,576,348.00	4.17
312	600429	三元股份	4,568,065.00	4.16
313	002970	锐明技术	4,521,310.00	4.12
314	002150	正泰电源	4,512,036.00	4.11
315	688818	电科蓝天	4,442,629.55	4.05
316	300461	田中精机	4,376,847.00	3.99
317	603057	紫燕食品	4,346,526.00	3.96
318	688807	优迅股份	4,306,962.11	3.92
319	002176	江特电机	4,213,633.00	3.84
320	688621	阳光诺和	4,144,914.90	3.78
321	600773	西藏城投	4,118,212.00	3.75
322	000807	云铝股份	4,115,605.00	3.75
323	301171	易点天下	4,087,083.00	3.72
324	002852	道道全	4,085,963.00	3.72
325	601133	柏诚股份	4,064,129.00	3.70
326	605060	联德股份	4,020,789.00	3.66
327	002518	科士达	4,009,327.00	3.65
328	002738	中矿资源	3,998,102.00	3.64
329	002283	天润工业	3,928,514.00	3.58
330	002025	航天电器	3,928,005.41	3.58
331	603279	景津装备	3,921,635.00	3.57

332	600409	三友化工	3,907,786.00	3.56
333	601126	四方股份	3,870,162.00	3.53
334	000933	神火股份	3,851,823.00	3.51
335	300548	长芯博创	3,833,436.00	3.49
336	688583	思看科技	3,830,799.21	3.49
337	002329	皇氏集团	3,790,267.00	3.45
338	603727	博迈科	3,779,304.00	3.44
339	300014	亿纬锂能	3,762,311.00	3.43
340	688419	耐科装备	3,746,236.49	3.41
341	000960	锡业股份	3,734,804.00	3.40
342	600298	安琪酵母	3,649,424.00	3.32
343	300482	万孚生物	3,612,084.67	3.29
344	600746	江苏索普	3,610,955.00	3.29
345	000719	中原传媒	3,584,960.00	3.27
346	688578	艾力斯	3,537,648.00	3.22
347	002929	润建股份	3,536,182.00	3.22
348	300085	银之杰	3,483,384.00	3.17
349	688607	康众医疗	3,463,072.78	3.15
350	001896	豫能控股	3,418,311.00	3.11
351	600516	方大炭素	3,413,858.00	3.11
352	301257	普蕊斯	3,394,594.00	3.09
353	301365	矩阵股份	3,374,214.00	3.07
354	000700	模塑科技	3,368,695.00	3.07
355	603800	洪田股份	3,311,547.00	3.02
356	001309	德明利	3,274,853.00	2.98
357	300454	深信服	3,272,104.00	2.98
358	688221	前沿生物	3,231,487.30	2.94
359	301196	唯科科技	3,209,770.00	2.92
360	688141	杰华特	3,173,179.42	2.89
361	603093	南华期货	3,161,981.00	2.88
362	688150	莱特光电	3,132,051.81	2.85
363	688411	海博思创	3,129,871.77	2.85
364	000581	威孚高科	3,102,550.00	2.83
365	601137	博威合金	3,065,627.00	2.79
366	605168	三人行	3,052,285.00	2.78
367	000039	中集集团	3,005,022.00	2.74
368	688485	九州一轨	2,853,883.56	2.60
369	002345	潮宏基	2,842,991.00	2.59
370	600236	桂冠电力	2,787,121.72	2.54
371	600961	株冶集团	2,784,842.00	2.54
372	603256	宏和科技	2,752,035.00	2.51
373	002832	比音勒芬	2,629,431.00	2.40
374	301396	宏景科技	2,627,890.80	2.39

375	601208	东材科技	2,565,361.00	2.34
376	688630	芯碁微装	2,525,080.70	2.30
377	301087	可孚医疗	2,257,347.40	2.06

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	603938	三孚股份	57,526,096.91	52.41
2	002602	世纪华通	46,521,696.00	42.38
3	000893	亚钾国际	44,604,901.00	40.63
4	603259	药明康德	42,749,298.00	38.94
5	002080	中材科技	37,527,579.78	34.19
6	688456	有研粉材	37,101,312.94	33.80
7	300776	帝尔激光	33,783,743.20	30.78
8	301526	国际复材	33,485,923.00	30.51
9	603179	新泉股份	33,452,360.20	30.48
10	301281	科源制药	33,160,553.56	30.21
11	300308	中际旭创	32,999,931.00	30.06
12	688146	中船特气	29,974,909.66	27.31
13	688031	星环科技	29,884,489.89	27.22
14	300811	铂科新材	29,442,608.68	26.82
15	000630	铜陵有色	29,188,876.78	26.59
16	600378	昊华科技	28,872,010.00	26.30
17	301362	民爆光电	27,767,341.20	25.30
18	600418	江淮汽车	26,169,077.00	23.84
19	600309	万华化学	25,604,759.00	23.33
20	601138	工业富联	25,577,933.00	23.30
21	688258	卓易信息	25,575,343.95	23.30
22	002213	大为股份	25,556,855.00	23.28
23	002384	东山精密	25,417,796.64	23.16
24	002488	金固股份	25,259,032.50	23.01
25	688710	益诺思	25,206,529.98	22.96
26	688332	中科蓝讯	25,077,057.79	22.85
27	688717	艾罗能源	25,073,648.24	22.84
28	688012	中微公司	24,894,145.11	22.68
29	600487	亨通光电	24,842,535.00	22.63
30	603678	火炬电子	24,574,509.81	22.39
31	301468	博盈特焊	24,520,374.01	22.34
32	600458	时代新材	23,768,655.00	21.65
33	000426	兴业银锡	23,428,255.00	21.34
34	300814	中富电路	23,414,103.64	21.33
35	301095	广立微	23,391,693.00	21.31
36	688300	联瑞新材	23,135,479.20	21.08

37	300863	卡倍亿	23,121,073.40	21.06
38	688331	荣昌生物	22,840,711.39	20.81
39	600141	兴发集团	22,453,035.92	20.45
40	603823	百合花	22,182,840.80	20.21
41	300570	太辰光	22,173,186.26	20.20
42	002938	鹏鼎控股	21,401,976.00	19.50
43	002865	钧达股份	21,198,335.12	19.31
44	000688	国城矿业	21,085,481.04	19.21
45	002847	盐津铺子	21,068,677.00	19.19
46	600841	动力新科	20,895,149.00	19.04
47	002001	新 和 成	20,866,417.00	19.01
48	300502	新易盛	20,280,814.80	18.48
49	002831	裕同科技	20,038,990.16	18.26
50	000403	派林生物	20,021,512.63	18.24
51	301231	荣信文化	20,020,040.61	18.24
52	600031	三一重工	20,010,360.00	18.23
53	603112	华翔股份	19,976,884.99	18.20
54	002785	万里石	19,786,664.00	18.03
55	300398	飞凯材料	19,517,583.00	17.78
56	600331	宏达股份	19,447,120.79	17.72
57	688266	泽璟制药	19,439,169.65	17.71
58	600483	福能股份	19,401,013.00	17.67
59	300408	三环集团	19,373,779.89	17.65
60	600258	首旅酒店	19,362,282.00	17.64
61	002552	宝鼎科技	19,253,345.00	17.54
62	601872	招商轮船	19,184,590.08	17.48
63	000099	中信海直	19,045,453.00	17.35
64	300785	值得买	18,724,477.00	17.06
65	300285	国瓷材料	18,346,672.44	16.71
66	600208	衢州发展	18,341,565.00	16.71
67	688091	上海谊众	18,319,252.44	16.69
68	300972	万辰集团	18,302,364.00	16.67
69	600601	方正科技	18,086,968.00	16.48
70	301246	宏源药业	17,922,914.00	16.33
71	605599	莱百股份	17,421,196.04	15.87
72	603195	公牛集团	17,188,844.78	15.66
73	001376	百通能源	17,111,669.00	15.59
74	603011	合锻智能	17,087,531.00	15.57
75	603103	横店影视	16,641,836.00	15.16
76	688392	骄成超声	16,634,151.70	15.15
77	300201	海伦哲	16,231,927.00	14.79
78	301285	鸿日达	16,091,175.28	14.66
79	300390	天华新能	16,068,497.00	14.64

80	688256	寒武纪	16,040,094.91	14.61
81	300161	华中数控	16,034,314.00	14.61
82	300750	宁德时代	15,795,593.00	14.39
83	600301	华锡有色	15,570,511.00	14.18
84	002371	北方华创	15,508,301.00	14.13
85	000729	燕京啤酒	15,409,192.00	14.04
86	601689	拓普集团	15,266,496.00	13.91
87	000977	浪潮信息	15,240,736.00	13.88
88	600060	海信视像	15,149,439.00	13.80
89	600499	科达制造	14,489,647.00	13.20
90	688379	华光新材	14,427,928.88	13.14
91	688690	纳微科技	14,409,099.88	13.13
92	002568	百润股份	14,336,122.95	13.06
93	603087	甘李药业	14,293,096.00	13.02
94	600183	生益科技	14,157,332.00	12.90
95	002906	华阳集团	14,079,530.00	12.83
96	603269	海鸥股份	13,836,277.00	12.60
97	000962	东方钽业	13,809,529.00	12.58
98	300818	耐普矿机	13,572,828.00	12.36
99	600926	杭州银行	13,568,189.00	12.36
100	600754	锦江酒店	13,489,415.00	12.29
101	300222	科大智能	13,487,908.00	12.29
102	003036	泰坦股份	13,444,922.00	12.25
103	002008	大族激光	13,416,221.00	12.22
104	300835	龙磁科技	13,401,889.00	12.21
105	688785	恒运昌	13,315,540.36	12.13
106	603876	鼎胜新材	13,235,171.00	12.06
107	688006	杭可科技	13,192,619.90	12.02
108	002555	三七互娱	13,113,613.00	11.95
109	688268	华特气体	13,067,652.64	11.90
110	300133	华策影视	12,990,104.94	11.83
111	605589	圣泉集团	12,978,858.39	11.82
112	300223	北京君正	12,975,279.71	11.82
113	600519	贵州茅台	12,971,817.00	11.82
114	000951	中国重汽	12,405,378.00	11.30
115	002796	世嘉科技	12,396,847.50	11.29
116	603308	应流股份	12,333,962.00	11.24
117	002317	众生药业	12,329,148.00	11.23
118	605499	东鹏饮料	12,251,005.00	11.16
119	002812	恩捷股份	12,194,044.00	11.11
120	300774	倍杰特	12,162,668.00	11.08
121	688759	必贝特	12,093,360.38	11.02
122	603061	金海通	12,023,044.20	10.95

123	300033	同花顺	12,002,053.00	10.93
124	002985	北摩高科	11,876,728.00	10.82
125	688388	嘉元科技	11,800,167.23	10.75
126	002149	西部材料	11,752,779.00	10.71
127	002138	顺络电子	11,680,417.00	10.64
128	688361	中科飞测	11,625,836.09	10.59
129	002465	海格通信	11,485,993.00	10.46
130	688133	泰坦科技	11,468,680.29	10.45
131	002859	洁美科技	11,462,449.00	10.44
132	600105	永鼎股份	11,426,941.92	10.41
133	301319	唯特偶	11,324,192.00	10.32
134	603605	珀莱雅	11,291,382.00	10.29
135	601619	嘉泽新能	11,235,116.74	10.24
136	300567	精测电子	11,091,322.00	10.10
137	001203	大中矿业	10,839,475.00	9.87
138	000636	风华高科	10,802,675.00	9.84
139	002558	巨人网络	10,783,796.00	9.82
140	002990	盛视科技	10,717,805.00	9.76
141	002409	雅克科技	10,613,355.00	9.67
142	600397	江钨装备	10,587,874.00	9.65
143	603725	天安新材	10,263,934.20	9.35
144	001206	依依股份	10,139,055.40	9.24
145	600160	巨化股份	9,974,385.00	9.09
146	601001	晋控煤业	9,935,305.00	9.05
147	002142	宁波银行	9,876,980.00	9.00
148	603926	铁流股份	9,863,867.00	8.99
149	002203	海亮股份	9,861,504.00	8.98
150	002493	荣盛石化	9,844,505.00	8.97
151	300816	艾可蓝	9,821,434.00	8.95
152	002444	巨星科技	9,810,863.00	8.94
153	002536	飞龙股份	9,808,412.00	8.94
154	300274	阳光电源	9,671,218.00	8.81
155	300731	科创新源	9,665,595.00	8.81
156	002206	海利得	9,465,332.00	8.62
157	603132	金徽股份	9,437,257.00	8.60
158	000338	潍柴动力	9,389,009.00	8.55
159	688426	康为世纪	9,363,917.19	8.53
160	688519	南亚新材	9,269,460.64	8.44
161	688123	聚辰股份	9,267,449.61	8.44
162	603059	倍加洁	9,226,408.00	8.41
163	600176	中国巨石	9,206,503.00	8.39
164	603031	安孚科技	9,201,705.00	8.38
165	603919	金徽酒	9,187,244.00	8.37

166	300938	信测标准	9,126,579.08	8.31
167	600690	海尔智家	9,121,688.00	8.31
168	603045	福达合金	9,112,807.00	8.30
169	688396	华润微	8,842,838.91	8.06
170	688545	兴福电子	8,751,761.55	7.97
171	300149	睿智医药	8,693,220.00	7.92
172	000768	中航西飞	8,441,591.00	7.69
173	300263	隆华科技	8,440,310.00	7.69
174	600722	金牛化工	8,438,400.00	7.69
175	300683	海特生物	8,281,492.00	7.54
176	300842	帝科股份	8,246,509.18	7.51
177	688206	概伦电子	8,241,987.94	7.51
178	600590	泰豪科技	7,952,811.00	7.24
179	301248	杰创智能	7,927,510.00	7.22
180	601318	中国平安	7,916,042.00	7.21
181	301529	福赛科技	7,901,113.00	7.20
182	688008	澜起科技	7,715,582.16	7.03
183	601231	环旭电子	7,712,791.00	7.03
184	000833	粤桂股份	7,705,440.00	7.02
185	002487	大金重工	7,592,050.00	6.92
186	600036	招商银行	7,591,278.00	6.92
187	688020	方邦股份	7,481,826.71	6.82
188	000596	古井贡酒	7,466,433.52	6.80
189	002159	三特索道	7,445,114.00	6.78
190	300475	香农芯创	7,375,587.00	6.72
191	600603	广汇物流	7,348,942.00	6.69
192	600980	北矿科技	7,281,805.00	6.63
193	301308	江波龙	7,261,215.00	6.61
194	600522	中天科技	6,987,423.00	6.37
195	603697	有友食品	6,836,821.00	6.23
196	688127	蓝特光学	6,807,580.86	6.20
197	688809	强一股份	6,756,725.85	6.16
198	688503	聚和材料	6,725,733.23	6.13
199	603186	华正新材	6,708,887.00	6.11
200	300113	顺网科技	6,605,111.00	6.02
201	688382	益方生物	6,537,356.94	5.96
202	605376	博迁新材	6,518,683.00	5.94
203	001389	广合科技	6,480,830.00	5.90
204	688755	汉邦科技	6,453,825.66	5.88
205	002867	周大生	6,431,687.00	5.86
206	002179	中航光电	6,385,673.06	5.82
207	603156	养元饮品	6,380,820.00	5.81
208	002290	禾盛新材	6,372,986.00	5.81

209	300131	英唐智控	6,311,181.00	5.75
210	688037	芯源微	6,293,269.45	5.73
211	300943	春晖智控	6,208,598.00	5.66
212	301087	可孚医疗	6,118,941.60	5.57
213	000534	万泽股份	6,041,082.45	5.50
214	001309	德明利	5,977,424.00	5.45
215	301626	苏州天脉	5,974,113.00	5.44
216	000801	四川九洲	5,973,435.00	5.44
217	600999	招商证券	5,961,035.00	5.43
218	600988	赤峰黄金	5,929,816.00	5.40
219	002957	科瑞技术	5,835,679.00	5.32
220	603400	华之杰	5,758,536.00	5.25
221	688257	新锐股份	5,752,522.90	5.24
222	300246	宝莱特	5,741,311.00	5.23
223	603757	大元泵业	5,740,991.00	5.23
224	688981	中芯国际	5,722,643.83	5.21
225	002357	富临运业	5,711,210.00	5.20
226	000039	中集集团	5,703,603.00	5.20
227	600236	桂冠电力	5,687,751.10	5.18
228	002645	华宏科技	5,672,001.00	5.17
229	605117	德业股份	5,667,069.00	5.16
230	002870	香山股份	5,650,754.00	5.15
231	300438	鹏辉能源	5,649,764.00	5.15
232	688208	道通科技	5,626,418.42	5.13
233	601233	桐昆股份	5,590,816.00	5.09
234	600276	恒瑞医药	5,583,834.00	5.09
235	002637	赞宇科技	5,563,638.00	5.07
236	601975	招商南油	5,544,877.00	5.05
237	600549	厦门钨业	5,530,727.00	5.04
238	300461	田中精机	5,519,043.00	5.03
239	600406	国电南瑞	5,516,154.00	5.03
240	300059	东方财富	5,508,962.00	5.02
241	605288	凯迪股份	5,502,779.00	5.01
242	002810	山东赫达	5,494,231.00	5.01
243	688019	安集科技	5,436,609.02	4.95
244	605016	百龙创园	5,421,980.00	4.94
245	601857	中国石油	5,351,700.00	4.88
246	300003	乐普医疗	5,340,250.00	4.86
247	002624	完美世界	5,313,540.00	4.84
248	688498	源杰科技	5,303,920.18	4.83
249	603345	安井食品	5,254,549.00	4.79
250	002468	申通快递	5,238,568.00	4.77
251	688306	均普智能	5,217,814.18	4.75

252	605133	嵘泰股份	5,211,177.00	4.75
253	002027	分众传媒	5,138,632.00	4.68
254	600352	浙江龙盛	5,121,741.00	4.67
255	600233	圆通速递	5,039,504.34	4.59
256	002092	中泰化学	5,030,747.54	4.58
257	688365	光云科技	5,018,809.78	4.57
258	600760	中航沈飞	4,970,655.00	4.53
259	000957	中通客车	4,954,070.00	4.51
260	605196	华通线缆	4,953,606.00	4.51
261	601377	兴业证券	4,924,133.00	4.49
262	002176	江特电机	4,896,964.00	4.46
263	300857	协创数据	4,858,874.00	4.43
264	603228	景旺电子	4,815,527.00	4.39
265	603600	永艺股份	4,809,085.00	4.38
266	002025	航天电器	4,725,116.00	4.30
267	000973	佛塑科技	4,721,665.00	4.30
268	600773	西藏城投	4,652,305.00	4.24
269	601133	柏诚股份	4,625,926.42	4.21
270	600429	三元股份	4,616,753.00	4.21
271	601088	中国神华	4,613,936.00	4.20
272	002594	比亚迪	4,606,358.00	4.20
273	603407	长裕集团	4,604,108.08	4.19
274	002246	北化股份	4,599,970.00	4.19
275	688686	奥普特	4,594,634.17	4.19
276	002821	凯莱英	4,590,263.00	4.18
277	300548	长芯博创	4,557,416.00	4.15
278	002688	金河生物	4,510,363.00	4.11
279	600186	莲花控股	4,502,740.00	4.10
280	300791	仙乐健康	4,476,655.00	4.08
281	301080	百普赛斯	4,324,753.00	3.94
282	688818	电科蓝天	4,314,697.82	3.93
283	605060	联德股份	4,259,840.00	3.88
284	002283	天润工业	4,255,846.00	3.88
285	688807	优迅股份	4,216,707.87	3.84
286	600188	兖矿能源	4,212,220.00	3.84
287	603057	紫燕食品	4,144,823.00	3.78
288	603683	晶华新材	4,108,207.00	3.74
289	688478	晶升股份	4,104,186.70	3.74
290	000799	酒鬼酒	4,089,229.00	3.73
291	002970	锐明技术	4,088,732.00	3.72
292	603500	祥和实业	4,076,019.00	3.71
293	000807	云铝股份	4,038,291.00	3.68
294	002738	中矿资源	4,034,315.00	3.68

295	688419	耐科装备	4,016,766.35	3.66
296	688583	思看科技	3,986,828.39	3.63
297	301580	爱迪特	3,970,437.60	3.62
298	300146	汤臣倍健	3,930,333.00	3.58
299	688141	杰华特	3,927,450.04	3.58
300	600259	中稀有色	3,917,632.89	3.57
301	301396	宏景科技	3,915,236.00	3.57
302	002150	正泰电源	3,851,029.00	3.51
303	002491	通鼎互联	3,845,778.00	3.50
304	000933	神火股份	3,811,270.00	3.47
305	300014	亿纬锂能	3,808,333.00	3.47
306	688621	阳光诺和	3,806,521.66	3.47
307	300085	银之杰	3,795,454.00	3.46
308	688179	阿拉丁	3,791,337.60	3.45
309	301171	易点天下	3,782,357.00	3.45
310	300482	万孚生物	3,774,888.08	3.44
311	002329	皇氏集团	3,773,993.00	3.44
312	300957	贝泰妮	3,751,369.00	3.42
313	000960	锡业股份	3,707,877.36	3.38
314	603727	博迈科	3,694,022.00	3.37
315	601126	四方股份	3,692,223.00	3.36
316	600298	安琪酵母	3,673,413.00	3.35
317	688010	福光股份	3,636,933.58	3.31
318	688578	艾力斯	3,626,545.76	3.30
319	301393	昊帆生物	3,589,042.00	3.27
320	002852	道道全	3,573,760.00	3.26
321	002299	圣农发展	3,543,024.00	3.23
322	600516	方大炭素	3,518,946.96	3.21
323	603256	宏和科技	3,508,571.00	3.20
324	600746	江苏索普	3,508,080.00	3.20
325	301257	普蕊斯	3,493,608.00	3.18
326	000719	中原传媒	3,488,759.00	3.18
327	001896	豫能控股	3,464,943.00	3.16
328	002929	润建股份	3,455,831.00	3.15
329	300454	深信服	3,434,885.00	3.13
330	603093	南华期货	3,433,436.00	3.13
331	603279	景津装备	3,359,295.00	3.06
332	600500	中化国际	3,340,360.00	3.04
333	688630	芯碁微装	3,340,222.43	3.04
334	603886	元祖股份	3,260,147.00	2.97
335	600961	株冶集团	3,221,687.00	2.93
336	601137	博威合金	3,203,357.00	2.92
337	300435	中泰股份	3,189,214.00	2.91

338	002709	天赐材料	3,146,961.00	2.87
339	688270	ST 臻镭	3,057,573.85	2.79
340	300620	光库科技	3,039,604.00	2.77
341	000581	威孚高科	3,033,181.00	2.76
342	688150	莱特光电	3,026,559.41	2.76
343	601208	东材科技	3,021,723.00	2.75
344	301196	唯科科技	2,997,990.00	2.73
345	688278	特宝生物	2,985,595.19	2.72
346	688221	前沿生物	2,974,391.89	2.71
347	000408	藏格矿业	2,973,117.00	2.71
348	688651	盛邦安全	2,900,360.34	2.64
349	300049	福瑞医科	2,830,504.00	2.58
350	300395	菲利华	2,804,014.00	2.55
351	603596	伯特利	2,774,625.00	2.53
352	000100	TCL 科技	2,772,606.00	2.53
353	002947	恒铭达	2,765,675.00	2.52
354	300747	锐科激光	2,682,894.12	2.44
355	002832	比音勒芬	2,676,238.00	2.44
356	688200	华峰测控	2,641,583.25	2.41
357	002345	潮宏基	2,628,618.00	2.39
358	600246	万通发展	2,576,427.00	2.35
359	688766	普冉股份	2,447,955.21	2.23
360	603713	密尔克卫	2,430,743.00	2.21
361	600409	三友化工	2,254,424.00	2.05
362	002897	意华股份	2,197,445.00	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	5,216,162,747.52
卖出股票收入（成交）总额	4,139,266,146.71

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	26,091,069.15	1.82
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	26,091,069.15	1.82

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	150,000	15,189,382.19	1.06
2	019792	25 国债 19	79,000	7,982,889.40	0.56
3	019827	26 国债 01	29,000	2,918,797.56	0.20

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

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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中，密尔克卫智能供应链服务集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国上海吴淞海关的处罚。

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

余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	3,916,766.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,558,511.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,475,277.98

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
中欧量化动力混合A	3,651	53,408.33	137,649,793.67	70.59%	57,344,024.75	29.41%
中欧量化动力混合	16,138	43,118.56	618,188,067.15	88.84%	77,659,270.44	11.16%

C						
合计	19,789	45,016.99	755,837,860.82	84.85%	135,003,295.19	15.15%

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（%）	97.33

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	中欧量化动力混合 A	3,276,956.32	1.68%
	中欧量化动力混合 C	105.82	0.00%
	合计	3,277,062.14	0.37%

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	中欧量化动力混合 A	>100
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	10~50
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
基金合同生效日 （2022 年 3 月 2 日） 基金份额总额	115,946,789.67	208,122,307.00
本报告期期初基金份额总额	48,611,276.73	41,793,167.44
本报告期基金总申购份额	187,653,199.42	840,048,674.19
减：本报告期基金总赎回份额	41,270,657.73	185,994,504.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	194,993,818.42	695,847,337.59

额总额		
-----	--	--

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

本报告期内，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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无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 (%)	
国泰海通	3	3,849,571,980.54	41.15	1,678,166.08	41.16	-
东北证券	3	3,546,396,786.32	37.91	1,545,880.29	37.91	-
方正证券	3	1,958,176,869.11	20.93	853,603.28	20.93	-

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 (%)
国泰海通	29,037,940.32	87.78	244,610,000.00	96.99	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	4,041,672.34	12.22	7,581,000.00	3.01	-	-

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	中欧量化动力混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-07
2	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
3	中欧量化动力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
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	中欧量化动力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	中欧量化动力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	中欧量化动力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 12 日至 2026 年 03 月 01 日	0.00	87,320,740.91	87,320,740.91	0.00	0.00%
	2	2026 年 03 月 27 日至 2026 年 05 月 06 日	0.00	89,812,070.65	0.00	89,812,070.65	10.08%
	3	2026 年 05 月 26 日至 2026 年 05 月 28 日	0.00	109,301,065.96	0.00	109,301,065.96	12.27%
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