

中欧上证科创板综合指数增强型证券投资
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行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	6
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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
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	49
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	49

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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧上证科创板综合指数增强	
基金主代码	024359	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 7 月 22 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	195,897,594.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧上证科创板综合指数增强 A	中欧上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	024359	024360
报告期末下属分级 基金的份额总额	153,258,317.15 份	42,639,277.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用基金管理人量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合，以争取实现指数增强型基金的目标。 本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。本基金坚持研究创造价值的理念，通过对上市公司深入、持续的研究，依托基金管理人研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合，精选具有较强竞争优势的公司，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

	本基金为股票型指数增强基金，跟踪上证科创板综合指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	方圆
	联系电话	021-68609600	95559
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95559
传真		021-50190017	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		窦玉明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告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)	
	中欧上证科创板综合指数增强 A	中欧上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	50,992,909.13	22,546,840.43
本期利润	86,048,895.52	33,456,146.35
加权平均基金份 额本期利润	0.7885	0.6083

本期加权平均净 值利润率	53.74%	43.12%
本期基金份额净 值增长率	55.36%	55.05%
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	110,725,605.64	30,531,781.76
期末可供分配基 金份额利润	0.7225	0.7160
期末基金资产净 值	293,004,738.49	81,212,102.55
期末基金份额净 值	1.9118	1.9046
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	91.18%	90.46%

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

中欧上证科创板综合指数增强 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	56.17%	2.25%	52.44%	2.24%	3.73%	0.01%
过去六个月	55.36%	2.13%	50.92%	2.11%	4.44%	0.02%
自基金合同生效起 至今	91.18%	1.93%	91.79%	1.91%	-0.61%	0.02%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*95%+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。

中欧上证科创板综合指数增强 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	56.01%	2.25%	52.44%	2.24%	3.57%	0.01%
过去六个月	55.05%	2.13%	50.92%	2.11%	4.13%	0.02%
自基金合同生效起至今	90.46%	1.93%	91.79%	1.91%	-1.33%	0.02%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧上证科创板综合指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 7 月 22 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 7 月 22 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

§ 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		
钱亚婷	基金经理 / 基金经理助理	2025-07-22	—	10 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任分析师、基金经理助理。

赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2025-10-21	-	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。

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，其中钱亚婷担任本基金的基金经理；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。

4.2 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。

本基金是以上证科创板综合指数为基准的指数增强基金，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差力争控制在合理范围内，整体组合持仓较为分散。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，追求穿越周期的稳健超额。

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 55.36%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；基金 C 类份额净值增长率为 55.05%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

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。

我们将坚持稳健克制的原则，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

本报告期内，基金托管人在中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中欧基金管理有限公司在中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关

内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	30,961,031.12	15,670,702.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	349,039,921.60	199,952,605.64
其中：股票投资		349,039,921.60	199,952,605.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,180,803.13	219,655.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		381,181,755.85	215,842,963.03
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		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		6,623,364.88	753,747.28
应付管理人报酬		219,296.91	153,080.88
应付托管费		27,412.09	19,135.14
应付销售服务费		23,298.27	29,778.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	71,542.66	18,000.00
负债合计		6,964,914.81	973,741.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	195,897,594.16	174,732,641.09
未分配利润	6.4.7.8	178,319,246.88	40,136,580.36
净资产合计		374,216,841.04	214,869,221.45
负债和净资产总计		381,181,755.85	215,842,963.03

注： 1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 195,897,594.16 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.9118 元，基金份额总额 153,258,317.15 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.9046 元，基金份额总额 42,639,277.01 份。

2. 本基金基金合同于 2025 年 07 月 22 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		120,788,760.12
1. 利息收入		8,675.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,675.64
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）		74,662,351.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	74,203,849.86
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	-
股利收益	6.4.7.14	458,501.87
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	45,965,292.31
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	152,440.44
减：二、营业总支出		1,283,718.25
1. 管理人报酬		931,421.00
2. 托管费		116,427.61
3. 销售服务费		154,352.05
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	81,517.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		119,505,041.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		119,505,041.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		119,505,041.87

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	174,732,641.09	-	40,136,580.36	214,869,221.45
二、本期期初净资产	174,732,641.09	-	40,136,580.36	214,869,221.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,164,953.07	-	138,182,666.52	159,347,619.59
（一）、综合收益总额	-	-	119,505,041.87	119,505,041.87
（二）、本期基金	21,164,953.07	-	18,677,624.65	39,842,577.72

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	279,803,397.87	-	149,877,630.76	429,681,028.63
2. 基金赎 回款	-258,638,444.8 0	-	-131,200,006.11	-389,838,450.91
(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	195,897,594.16	-	178,319,246.88	374,216,841.04

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

中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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[2025]1002号《关于准予中欧上证科创板综合指数增强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《中欧上证科创板综合指数增强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971,318,460.40元，经向中国证监会备案，《中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年7月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为971,588,762.59份基金份额，其中包含认购资金利息折合270,302.19份基金份额。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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和其他相

关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财税[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》、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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入

增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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. 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，暂不计缴企业所得税。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	5,462,577.49
等于：本金	5,462,561.75
加：应计利息	15.74
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	25,498,453.63
等于：本金	25,497,831.38
加：应计利息	622.25
减：坏账准备	—
合计	30,961,031.12

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		282,440,127.78	—	349,039,921.60	66,599,793.82
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		282,440,127.78	—	349,039,921.60	66,599,793.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
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	8,926.92
其他应付	3,108.37
合计	71,542.66

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧上证科创板综合指数增强 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	106,182,920.61	106,182,920.61
本期申购	221,009,938.60	221,009,938.60
本期赎回（以“-”号填列）	-173,934,542.06	-173,934,542.06
本期末	153,258,317.15	153,258,317.15

中欧上证科创板综合指数增强 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	68,549,720.48	68,549,720.48
本期申购	58,793,459.27	58,793,459.27
本期赎回（以“-”号填列）	-84,703,902.74	-84,703,902.74
本期末	42,639,277.01	42,639,277.01

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

中欧上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,647,591.08	-6,165,539.40	24,482,051.68
本期期初	30,647,591.08	-6,165,539.40	24,482,051.68
本期利润	50,992,909.13	35,055,986.39	86,048,895.52
本期基金份额交易产生的变动数	29,085,105.43	130,368.71	29,215,474.14
其中：基金申购款	120,205,879.10	4,505,214.86	124,711,093.96
基金赎回款	-91,120,773.67	-4,374,846.15	-95,495,619.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,725,605.64	29,020,815.70	139,746,421.34

中欧上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,626,968.47	-3,972,439.79	15,654,528.68
本期期初	19,626,968.47	-3,972,439.79	15,654,528.68
本期利润	22,546,840.43	10,909,305.92	33,456,146.35
本期基金份额交易产生的变动数	-11,642,027.14	1,104,177.65	-10,537,849.49
其中：基金申购款	26,342,459.50	-1,175,922.70	25,166,536.80
基金赎回款	-37,984,486.64	2,280,100.35	-35,704,386.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,531,781.76	8,041,043.78	38,572,825.54

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	73.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,399.14
结算备付金利息收入	-
其他	203.21
合计	8,675.64

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	849,571,737.37
减：卖出股票成本总额	774,514,779.39
减：交易费用	853,108.12
买卖股票差价收入	74,203,849.86

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	458,501.87
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	458,501.87

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	45,965,292.31
股票投资	45,965,292.31
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—

合计	45,965,292.31
----	---------------

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	140,502.33
基金转换费收入	11,938.11
合计	152,440.44

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	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,081.58
账户维护费	9,000.00
存托服务费	1.72
合计	81,517.59

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
交通银行股份有限公司	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
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**

无。

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

无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	931,421.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	414,457.30
应支付基金管理人的净管理费	516,963.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，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。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	116,427.61

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，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取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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		
	中欧上证科创板综合 指数增强 A	中欧上证科创板综合 指数增强 C	合计
交通银行股份有限公司	—	51,875.63	51,875.63
中欧财富	—	213.64	213.64
中欧基金	—	6,916.26	6,916.26
合计	—	59,005.53	59,005.53

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，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划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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**

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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，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

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

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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	5,462,577.49	73.29

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（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
601112	振石	2026 年 1 月	6 个月	新股流通	11.18	17.59	206	2,303.08	3,623.54	-

	股份	21 日		受限						
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	44	1,666.72	1,534.28	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	35	1,172.15	1,187.55	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	76	1,662.88	1,939.52	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	127	1,760.22	9,329.42	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	87	1,371.12	4,063.77	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	130	2,301.00	10,961.60	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	917	16,065.84	32,938.64	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	381	8,641.08	18,139.41	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	57	5,254.26	26,399.55	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	131	5,837.36	61,395.77	-
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	47	3,848.36	74,463.51	-
688811	有	2026	6 个月	新股	6.41	24.13	602	3,858.82	14,526.26	-

	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	149	3,915.72	25,641.41	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	91	5,091.45	5,196.10	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	660	6,250.20	46,292.40	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	284	5,589.12	40,183.16	-

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	6,024	2,919,368.70	5,298,288.72	-

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 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。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。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。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	30,961,031.12	-	-	-	30,961,031.12
交易性金融资产	-	-	-	-349,039,921.60	349,039,921.60
应收申购款	-	-	-	1,180,803.13	1,180,803.13
资产总计	30,961,031.12	-	-	-350,220,724.73	381,181,755.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,623,364.88	6,623,364.88
应付管理人报酬	-	-	-	219,296.91	219,296.91
应付托管费	-	-	-	27,412.09	27,412.09
应付销售服务费	-	-	-	23,298.27	23,298.27
其他负债	-	-	-	71,542.66	71,542.66
负债总计	-	-	-	6,964,914.81	6,964,914.81
利率敏感度缺口	30,961,031.12	-	-	-343,255,809.92	374,216,841.04
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	15,670,702.26	-	-	-	15,670,702.26
交易性金融资产	-	-	-	-199,952,605.64	199,952,605.64
应收申购款	-	-	-	219,655.13	219,655.13
资产总计	15,670,702.26	-	-	-200,172,260.77	215,842,963.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	753,747.28	753,747.28
应付管理人报酬	-	-	-	153,080.88	153,080.88
应付托管费	-	-	-	19,135.14	19,135.14
应付销售服务费	-	-	-	29,778.28	29,778.28
其他负债	-	-	-	18,000.00	18,000.00
负债总计	-	-	-	973,741.58	973,741.58
利率敏感度缺口	15,670,702.26	-	-	-199,198,519.19	214,869,221.45

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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 0.00%（2025 年

12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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	349,039,921.60	93.27	199,952,605.64	93.06
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	349,039,921.60	93.27	199,952,605.64	93.06

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%	18,799,390.82	10,616,407.81
	业绩比较基准下降 5%	-18,799,390.82	-10,616,407.81

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	343,363,816.99	194,995,606.53
第二层次	5,298,288.72	4,511,784.00
第三层次	377,815.89	445,215.11
合计	349,039,921.60	199,952,605.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	349,039,921.60	91.57
	其中：股票	349,039,921.60	91.57
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	30,961,031.12	8.12
8	其他各项资产	1,180,803.13	0.31
9	合计	381,181,755.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

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	—	—
C	制造业	238,153,473.08	63.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,754,543.96	14.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,086,364.01	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	1,130,831.14	0.30
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	299,125,212.19	79.93

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	357,738.00	0.10
B	采矿业	222,229.00	0.06
C	制造业	38,986,637.41	10.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,132.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,371,075.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,926,844.00	1.05
J	金融业	1,383,276.00	0.37
K	房地产业	161,500.00	0.04
L	租赁和商务服务业	114,636.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	2,229,793.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	154,502.00	0.04
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	4,347.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	49,914,709.41	13.34

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	688256	寒武纪	14,878	23,738,592.90	6.34
2	688041	海光信息	55,725	20,634,967.50	5.51
3	688012	中微公司	19,869	9,308,626.50	2.49
4	688981	中芯国际	54,121	8,595,497.22	2.30
5	688008	澜起科技	23,344	7,234,305.60	1.93
6	688498	源杰科技	2,848	5,371,328.00	1.44
7	688525	佰维存储	10,845	5,365,346.85	1.43
8	688072	拓荆科技	6,024	5,298,288.72	1.42
9	688521	芯原股份	12,539	4,653,724.46	1.24
10	688082	盛美上海	9,676	4,180,032.00	1.12
11	688146	中船特气	11,049	3,867,039.51	1.03
12	688396	华润微	38,376	3,743,578.80	1.00
13	688702	盛科通信	9,151	3,568,798.49	0.95
14	688361	中科飞测	8,120	3,491,600.00	0.93
15	688347	华虹宏力	9,621	3,235,542.30	0.86
16	688766	普冉股份	4,170	3,196,722.00	0.85
17	688110	东芯股份	15,652	3,188,312.40	0.85
18	688249	晶合集成	49,997	2,951,322.91	0.79
19	688183	生益电子	22,009	2,913,991.60	0.78
20	688172	燕东微	32,907	2,752,999.62	0.74
21	688126	沪硅产业	62,959	2,511,434.51	0.67
22	688120	华海清科	7,576	2,440,835.68	0.65
23	688220	翱捷科技	19,273	2,396,019.36	0.64
24	688469	芯联集成	219,455	2,328,417.55	0.62
25	688519	南亚新材	5,698	2,165,467.92	0.58
26	688111	金山办公	10,130	2,158,196.50	0.58
27	688409	富创精密	6,992	2,141,300.00	0.57
28	688777	中控技术	18,003	2,115,352.50	0.57

29	688141	杰华特	13,353	2,049,685.50	0.55
30	688506	百利天恒	6,856	2,015,869.68	0.54
31	688387	信科移动	97,459	1,933,586.56	0.52
32	688036	传音控股	32,742	1,930,140.90	0.52
33	688627	精智达	2,677	1,914,055.00	0.51
34	688630	芯碁微装	3,396	1,865,728.44	0.50
35	688578	艾力斯	16,525	1,804,530.00	0.48
36	688048	长光华芯	3,455	1,734,410.00	0.46
37	688257	新锐股份	16,362	1,667,287.80	0.45
38	688037	芯源微	3,787	1,662,682.35	0.44
39	688629	华丰科技	8,791	1,648,400.41	0.44
40	688200	华峰测控	3,111	1,633,586.10	0.44
41	688449	联芸科技	18,893	1,630,654.83	0.44
42	688548	广钢气体	30,181	1,572,430.10	0.42
43	688775	影石创新	11,332	1,571,181.80	0.42
44	688313	仕佳光子	8,405	1,551,983.25	0.41
45	688002	睿创微纳	9,807	1,517,044.83	0.41
46	688678	福立旺	59,888	1,447,492.96	0.39
47	688778	厦钨新能	26,154	1,422,777.60	0.38
48	688180	君实生物	40,652	1,374,850.64	0.37
49	688187	时代电气	19,986	1,372,238.76	0.37
50	688536	思瑞浦	3,739	1,361,332.51	0.36
51	688368	晶丰明源	6,223	1,347,403.96	0.36
52	688375	国博电子	12,842	1,339,420.60	0.36
53	688025	杰普特	2,835	1,332,450.00	0.36
54	688689	银河微电	20,264	1,311,486.08	0.35
55	688255	凯尔达	46,992	1,306,377.60	0.35
56	688668	鼎通科技	3,488	1,302,070.40	0.35
57	688300	联瑞新材	5,288	1,292,387.20	0.35
58	688234	天岳先进	7,443	1,291,434.93	0.35
59	688226	威腾电气	30,022	1,285,842.26	0.34
60	688411	海博思创	4,341	1,264,099.20	0.34
61	688472	阿特斯	114,869	1,242,882.58	0.33
62	688195	腾景科技	6,436	1,239,444.88	0.33
63	688416	恒烁股份	8,667	1,213,380.00	0.32
64	688585	上纬新材	7,240	1,200,392.00	0.32
65	688700	东威科技	13,245	1,184,103.00	0.32
66	688382	益方生物	65,383	1,176,894.00	0.31
67	688202	美迪西	14,407	1,162,788.97	0.31
68	688275	万润新能	9,053	1,154,710.15	0.31
69	688322	奥比中光	8,710	1,137,090.50	0.30
70	688683	莱尔科技	29,902	1,133,883.84	0.30
71	688262	国芯科技	25,575	1,105,607.25	0.30

72	688062	迈威生物	37,564	1,061,183.00	0.28
73	688167	炬光科技	2,963	1,049,524.23	0.28
74	688605	先锋精科	10,063	1,046,753.26	0.28
75	688166	博瑞医药	29,272	1,024,812.72	0.27
76	688378	奥来德	16,464	1,020,768.00	0.27
77	688047	龙芯中科	6,558	1,014,325.86	0.27
78	688099	晶晨股份	9,857	1,014,285.30	0.27
79	688197	首药控股	30,338	1,013,592.58	0.27
80	688035	德邦科技	10,983	1,008,239.40	0.27
81	688019	安集科技	2,933	995,636.18	0.27
82	688028	沃尔德	6,341	988,371.67	0.26
83	688239	航宇科技	16,456	984,562.48	0.26
84	688385	复旦微电	13,588	968,688.52	0.26
85	688127	蓝特光学	9,834	959,798.40	0.26
86	688795	摩尔线程	1,327	950,782.23	0.25
87	688299	长阳科技	56,810	949,295.10	0.25
88	688503	聚和材料	7,075	938,852.50	0.25
89	688295	中复神鹰	15,460	935,948.40	0.25
90	688676	金盘科技	10,879	920,798.56	0.25
91	688147	微导纳米	5,601	906,689.88	0.24
92	688400	凌云光	13,168	871,721.60	0.23
93	688213	思特威	8,098	867,052.86	0.23
94	688001	华兴源创	10,097	865,312.90	0.23
95	688433	华曙高科	9,938	850,692.80	0.23
96	688561	奇安信	34,102	817,765.96	0.22
97	688221	前沿生物	35,554	796,409.60	0.21
98	688800	瑞可达	8,181	785,130.57	0.21
99	688652	京仪装备	3,921	784,866.57	0.21
100	688005	容百科技	25,528	781,156.80	0.21
101	688343	云天励飞	9,565	781,077.90	0.21
102	688233	神工股份	3,628	777,915.76	0.21
103	688628	优利德	7,801	771,830.94	0.21
104	688205	德科立	3,688	767,804.72	0.21
105	688365	光云科技	47,970	756,486.90	0.20
106	688593	新相微	19,331	752,362.52	0.20
107	688223	晶科能源	157,855	749,811.25	0.20
108	688129	东来技术	28,374	743,115.06	0.20
109	688052	纳芯微	2,563	738,938.53	0.20
110	688720	艾森股份	7,300	737,300.00	0.20
111	688235	百济神州	2,891	736,077.51	0.20
112	688222	成都先导	22,526	723,309.86	0.19
113	688359	三孚新科	3,640	722,321.60	0.19
114	688156	路德科技	23,752	718,498.00	0.19

115	688049	炬芯科技	15,230	714,439.30	0.19
116	688710	益诺思	10,558	709,497.60	0.19
117	688379	华光新材	8,430	708,372.90	0.19
118	688612	威迈斯	23,863	706,106.17	0.19
119	688199	久日新材	20,191	697,195.23	0.19
120	688158	优刻得	18,598	683,662.48	0.18
121	688388	嘉元科技	15,516	682,704.00	0.18
122	688293	奥浦迈	16,370	682,465.30	0.18
123	688258	卓易信息	5,674	672,595.96	0.18
124	688208	道通科技	26,699	672,547.81	0.18
125	688516	奥特维	11,692	671,003.88	0.18
126	688362	甬矽电子	6,910	666,124.00	0.18
127	688625	呈和科技	7,824	660,423.84	0.18
128	688181	八亿时空	10,504	657,550.40	0.18
129	688006	杭可科技	17,974	656,949.70	0.18
130	688372	伟测科技	3,441	640,026.00	0.17
131	688059	华锐精密	3,194	637,873.74	0.17
132	688331	荣昌生物	4,827	628,765.02	0.17
133	688303	大全能源	36,019	627,811.17	0.17
134	688108	赛诺医疗	33,590	622,422.70	0.17
135	688150	莱特光电	9,041	620,393.42	0.17
136	688307	中润光学	7,757	620,172.15	0.17
137	688360	德马科技	34,622	619,733.80	0.17
138	688383	新益昌	3,244	610,001.76	0.16
139	688271	联影医疗	5,980	605,355.40	0.16
140	688097	博众精工	9,590	604,649.50	0.16
141	688603	天承科技	2,814	585,171.30	0.16
142	688102	斯瑞新材	12,293	579,983.74	0.15
143	688107	安路科技	12,610	575,016.00	0.15
144	688090	瑞松科技	5,389	573,659.05	0.15
145	688063	派能科技	10,591	564,182.57	0.15
146	688091	上海谊众	13,763	553,272.60	0.15
147	688112	鼎阳科技	7,511	551,758.06	0.15
148	688248	南网科技	7,922	548,043.96	0.15
149	688545	兴福电子	4,085	543,550.10	0.15
150	688339	亿华通	29,037	542,991.90	0.15
151	688559	海目星	6,392	536,416.64	0.14
152	688291	金橙子	9,142	534,624.16	0.14
153	688690	纳微科技	12,007	529,508.70	0.14
154	688175	高凌信息	21,042	529,206.30	0.14
155	688123	聚辰股份	2,487	528,736.20	0.14
156	688717	艾罗能源	6,388	527,457.16	0.14
157	688165	埃夫特	25,661	523,484.40	0.14

158	688345	博力威	8,936	519,002.88	0.14
159	688328	深科达	5,407	517,449.90	0.14
160	688192	迪哲医药	12,885	514,498.05	0.14
161	688327	云从科技	40,851	509,003.46	0.14
162	688390	固德威	4,647	504,245.97	0.13
163	688403	汇成股份	12,628	501,331.60	0.13
164	688182	灿勤科技	11,481	494,486.67	0.13
165	688653	康希通信	28,294	491,749.72	0.13
166	688553	汇宇制药	45,157	480,018.91	0.13
167	688176	亚虹医药	48,212	478,263.04	0.13
168	688500	慧辰股份	10,525	477,098.25	0.13
169	688428	诺诚健华	16,474	469,014.78	0.13
170	688531	日联科技	2,620	465,940.80	0.12
171	688488	艾迪药业	35,457	455,622.45	0.12
172	688308	欧科亿	2,500	454,525.00	0.12
173	688568	中科星图	10,660	442,070.20	0.12
174	688135	利扬芯片	10,385	437,000.80	0.12
175	688518	联赢激光	14,090	435,381.00	0.12
176	688352	颀中科技	17,586	425,229.48	0.11
177	688418	震有科技	8,536	410,410.88	0.11
178	688351	微电生理	18,006	408,015.96	0.11
179	688758	赛分科技	18,160	399,701.60	0.11
180	688399	硕世生物	8,721	395,846.19	0.11
181	688456	有研粉材	2,668	372,452.80	0.10
182	688478	晶升股份	4,198	371,732.90	0.10
183	688512	慧智微	23,215	370,743.55	0.10
184	688599	天合光能	26,219	370,212.28	0.10
185	688556	高测股份	25,899	343,938.72	0.09
186	688317	之江生物	22,132	336,406.40	0.09
187	688392	骄成超声	1,458	331,228.44	0.09
188	688499	利元亨	6,271	329,541.05	0.09
189	688480	赛恩斯	3,748	328,287.32	0.09
190	688772	珠海冠宇	16,485	323,600.55	0.09
191	688609	九联科技	29,318	322,791.18	0.09
192	688757	胜科纳米	4,821	321,560.70	0.09
193	688020	方邦股份	1,288	321,484.80	0.09
194	688600	皖仪科技	9,608	319,754.24	0.09
195	688301	奕瑞科技	2,554	316,696.00	0.08
196	688371	菲沃泰	8,035	313,284.65	0.08
197	688802	沐曦股份	360	298,188.00	0.08
198	688691	灿芯股份	2,515	291,563.95	0.08
199	688443	智翔金泰	12,453	289,532.25	0.08
200	688281	华秦科技	5,689	285,758.47	0.08

201	688692	达梦数据	1,162	283,864.98	0.08
202	688619	罗普特	17,341	281,444.43	0.08
203	688618	三旺通信	8,829	271,668.33	0.07
204	688333	铂力特	2,571	263,270.40	0.07
205	688017	绿的谐波	619	258,655.34	0.07
206	688661	和林微纳	1,605	255,162.90	0.07
207	688122	西部超导	3,966	249,104.46	0.07
208	688010	福光股份	4,949	240,669.87	0.06
209	688686	奥普特	1,415	238,271.85	0.06
210	688312	燕麦科技	2,822	237,019.78	0.06
211	688779	五矿新能	28,927	234,597.97	0.06
212	688306	均普智能	23,128	233,592.80	0.06
213	688081	兴图新科	5,687	232,484.56	0.06
214	688031	星环科技	2,001	230,475.18	0.06
215	688677	海泰新光	2,272	229,767.36	0.06
216	688719	爱科赛博	2,840	218,680.00	0.06
217	688658	悦康药业	16,533	212,614.38	0.06
218	688279	峰昭科技	933	209,402.52	0.06
219	688079	美迪凯	6,731	206,978.25	0.06
220	688716	中研股份	6,448	202,660.64	0.05
221	688636	智明达	5,555	201,257.65	0.05
222	688733	壹石通	4,782	197,735.70	0.05
223	688539	高华科技	6,116	194,978.08	0.05
224	688219	会通股份	15,051	194,759.94	0.05
225	688337	普源精电	2,591	194,143.63	0.05
226	688523	航天环宇	3,635	190,474.00	0.05
227	688510	航亚科技	6,837	163,267.56	0.04
228	688268	华特气体	600	160,500.00	0.04
229	688682	霍莱沃	3,903	151,826.70	0.04
230	688319	欧林生物	3,450	151,731.00	0.04
231	688046	药康生物	6,216	150,427.20	0.04
232	688011	新光光电	2,128	148,683.36	0.04
233	688549	中巨芯	3,580	131,779.80	0.04
234	688318	财富趋势	1,831	130,568.61	0.03
235	688231	隆达股份	3,535	129,840.55	0.03
236	688065	凯赛生物	2,289	109,528.65	0.03
237	688171	纬德信息	2,478	108,932.88	0.03
238	688552	航天南湖	3,504	98,567.52	0.03
239	688309	恒誉环保	1,593	96,981.84	0.03
240	688210	统联精密	2,192	88,797.92	0.02
241	688584	上海合晶	2,467	88,688.65	0.02
242	688799	华纳药厂	1,918	86,060.66	0.02
243	688246	嘉和美康	4,047	83,165.85	0.02

244	688277	天智航	4,811	82,268.10	0.02
245	688787	海天瑞声	600	80,670.00	0.02
246	688401	路维光电	827	79,375.46	0.02
247	688667	菱电电控	560	74,844.00	0.02
248	688693	锆威特	712	74,012.40	0.02
249	688148	芳源股份	8,604	73,822.32	0.02
250	688726	拉普拉斯	1,333	70,449.05	0.02
251	688633	星球石墨	2,307	68,587.11	0.02
252	688320	禾川科技	1,653	68,516.85	0.02
253	688615	合合信息	600	67,860.00	0.02
254	688131	皓元医药	600	56,760.00	0.02
255	688485	九州一轨	856	54,835.36	0.01
256	688350	富淼科技	1,532	52,899.96	0.01
257	688073	毕得医药	947	50,967.54	0.01
258	688786	悦安新材	1,091	50,273.28	0.01
259	688381	帝奥微	830	44,405.00	0.01
260	688377	迪威尔	1,839	43,363.62	0.01
261	688380	中微半导	600	39,546.00	0.01
262	688128	中国电研	1,632	38,743.68	0.01
263	688179	阿拉丁	1,390	38,516.90	0.01
264	688130	晶华微	1,329	37,371.48	0.01
265	688685	迈信林	600	32,940.00	0.01
266	688698	伟创电气	600	31,470.00	0.01
267	688679	通源环境	694	29,210.46	0.01
268	688586	江航装备	2,453	28,675.57	0.01
269	688266	泽璟制药	236	27,531.76	0.01
270	688117	圣诺生物	978	26,435.34	0.01
271	688077	大地熊	807	21,377.43	0.01
272	688252	天德钰	876	21,024.00	0.01
273	688283	坤恒顺维	600	19,866.00	0.01
274	688728	格科微	642	13,507.68	0.00
275	688722	同益中	600	9,102.00	0.00
276	688709	成都华微	214	8,151.26	0.00
277	688055	龙腾光电	1,004	5,783.04	0.00
278	688538	和辉光电	1,071	2,784.60	0.00
279	688238	和元生物	369	1,999.98	0.00

7.3.2 期末积极投资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	300999	金龙鱼	72,000	1,674,720.00	0.45
2	301391	卡莱特	20,000	1,142,000.00	0.31
3	300408	三环集团	6,500	1,084,850.00	0.29
4	000938	紫光股份	31,800	917,748.00	0.25

5	300124	汇川技术	13,800	915,354.00	0.24
6	301626	苏州天脉	2,200	844,712.00	0.23
7	301393	昊帆生物	12,600	816,102.00	0.22
8	301285	鸿日达	7,300	805,409.00	0.22
9	300661	圣邦股份	5,600	803,488.00	0.21
10	300322	硕贝德	30,500	768,600.00	0.21
11	300323	华灿光电	35,000	714,000.00	0.19
12	300424	航新科技	44,900	706,726.00	0.19
13	300623	捷捷微电	15,700	706,343.00	0.19
14	300480	光力科技	16,300	695,684.00	0.19
15	301321	翰博高新	15,400	679,910.00	0.18
16	300797	钢研纳克	49,000	649,740.00	0.17
17	300223	北京君正	2,600	647,140.00	0.17
18	301389	隆扬电子	7,400	642,246.00	0.17
19	600482	中国动力	19,300	633,040.00	0.17
20	300373	扬杰科技	3,900	613,197.00	0.16
21	300277	汽轮科技	40,300	606,112.00	0.16
22	300475	香农芯创	2,000	600,000.00	0.16
23	600999	招商证券	27,900	588,690.00	0.16
24	301085	亚康股份	9,600	581,856.00	0.16
25	300748	金力永磁	17,900	552,215.00	0.15
26	301246	宏源药业	20,300	546,070.00	0.15
27	300404	博济医药	61,600	539,616.00	0.14
28	300236	上海新阳	4,100	539,150.00	0.14
29	301096	百诚医药	9,400	537,586.00	0.14
30	300672	国科微	1,800	531,000.00	0.14
31	300049	福瑞医科	13,400	520,992.00	0.14
32	300547	川环科技	15,500	517,545.00	0.14
33	301369	联动科技	2,100	514,500.00	0.14
34	301191	菲菱科思	4,400	499,620.00	0.13
35	301002	崧盛股份	12,500	482,500.00	0.13
36	300755	华致酒行	37,100	422,569.00	0.11
37	300382	斯莱克	17,800	411,358.00	0.11
38	300857	协创数据	1,200	407,880.00	0.11
39	300398	飞凯材料	6,600	407,550.00	0.11
40	300843	胜蓝股份	2,600	406,250.00	0.11
41	300975	商络电子	7,800	403,650.00	0.11
42	300073	当升科技	8,400	403,536.00	0.11
43	300871	回盛生物	17,500	386,050.00	0.10
44	300602	飞荣达	7,400	378,880.00	0.10
45	300450	先导智能	9,300	378,696.00	0.10
46	002602	世纪华通	26,100	368,010.00	0.10
47	301026	浩通科技	18,200	368,004.00	0.10

48	002290	禾盛新材	4,000	367,480.00	0.10
49	300059	东方财富	17,600	358,688.00	0.10
50	300761	立华股份	21,800	357,738.00	0.10
51	002645	华宏科技	12,900	354,879.00	0.09
52	300817	双飞集团	22,400	349,440.00	0.09
53	300814	中富电路	1,700	347,650.00	0.09
54	300715	凯伦股份	21,000	345,660.00	0.09
55	300629	新劲刚	16,100	345,506.00	0.09
56	300765	石药创新	12,500	340,375.00	0.09
57	300955	嘉亨家化	9,300	335,637.00	0.09
58	300331	苏大维格	4,600	327,106.00	0.09
59	301172	君逸数码	12,500	324,375.00	0.09
60	300840	酷特智能	15,700	323,891.00	0.09
61	300201	海伦哲	15,200	320,264.00	0.09
62	300539	横河精密	15,700	319,809.00	0.09
63	300249	依米康	19,900	306,460.00	0.08
64	300418	昆仑万维	7,500	302,700.00	0.08
65	300263	隆华科技	18,300	298,290.00	0.08
66	300128	锦富技术	50,100	296,592.00	0.08
67	301021	英诺激光	2,400	292,560.00	0.08
68	603228	景旺电子	4,000	289,640.00	0.08
69	601688	华泰证券	13,900	286,618.00	0.08
70	301326	捷邦科技	2,000	278,740.00	0.07
71	300457	赢合科技	13,200	278,256.00	0.07
72	300184	力源信息	15,100	265,005.00	0.07
73	300363	博腾股份	16,000	259,840.00	0.07
74	301297	富乐德	4,200	257,208.00	0.07
75	301263	泰恩康	12,500	256,125.00	0.07
76	301012	扬电科技	10,900	256,041.00	0.07
77	300270	中威电子	19,500	253,695.00	0.07
78	605088	冠盛股份	9,000	253,620.00	0.07
79	300432	富临精工	12,500	251,125.00	0.07
80	603127	昭衍新药	6,200	236,964.00	0.06
81	301165	锐捷网络	2,900	233,305.00	0.06
82	300698	万马科技	8,500	231,200.00	0.06
83	300473	德尔股份	7,500	228,000.00	0.06
84	300792	壹网壹创	8,600	223,084.00	0.06
85	301128	强瑞技术	1,400	218,260.00	0.06
86	300855	图南股份	6,900	215,694.00	0.06
87	300593	新雷能	7,100	213,426.00	0.06
88	300302	同有科技	4,100	209,797.00	0.06
89	300885	海昌新材	8,800	209,176.00	0.06
90	301500	飞南资源	8,000	208,400.00	0.06

91	301382	蜂助手	4,500	207,000.00	0.06
92	300493	润欣科技	13,800	205,758.00	0.05
93	300552	万集科技	8,700	198,795.00	0.05
94	300390	天华新能	2,100	196,371.00	0.05
95	301171	易点天下	5,700	193,572.00	0.05
96	301526	国际复材	4,100	191,347.00	0.05
97	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.05
98	301201	诚达药业	5,000	181,800.00	0.05
99	300481	濮阳惠成	9,100	173,082.00	0.05
100	300976	达瑞电子	2,100	167,265.00	0.04
101	601231	环旭电子	5,100	165,240.00	0.04
102	300617	安靠智电	3,100	164,269.00	0.04
103	301216	万凯新材	7,100	163,229.00	0.04
104	301286	侨源股份	2,800	162,372.00	0.04
105	600246	万通发展	8,500	161,500.00	0.04
106	002273	水晶光电	4,500	159,660.00	0.04
107	300568	星源材质	8,100	151,632.00	0.04
108	300790	宇瞳光学	5,700	148,827.00	0.04
109	300033	同花顺	600	144,600.00	0.04
110	300842	帝科股份	1,600	142,672.00	0.04
111	300731	科创新源	2,400	140,064.00	0.04
112	300681	英搏尔	4,600	131,652.00	0.04
113	300687	赛意信息	4,200	130,200.00	0.03
114	300022	吉峰科技	16,400	127,428.00	0.03
115	002484	江海股份	1,200	126,000.00	0.03
116	300523	辰安科技	6,500	119,470.00	0.03
117	601168	西部矿业	4,400	119,416.00	0.03
118	300737	科顺股份	18,100	118,917.00	0.03
119	300034	钢研高纳	6,900	118,266.00	0.03
120	300697	电工合金	7,800	118,170.00	0.03
121	603588	高能环境	6,100	117,120.00	0.03
122	300990	同飞股份	1,100	115,577.00	0.03
123	300061	旗天科技	16,400	114,636.00	0.03
124	301611	珂玛科技	600	108,042.00	0.03
125	603090	宏盛股份	2,100	107,226.00	0.03
126	301193	家联科技	5,500	101,970.00	0.03
127	300590	移为通信	7,000	100,450.00	0.03
128	301358	湖南裕能	1,300	98,631.00	0.03
129	301150	中一科技	1,500	94,665.00	0.03
130	301225	恒勃股份	1,200	94,548.00	0.03
131	300017	网宿科技	7,200	93,672.00	0.03
132	300489	光智科技	300	93,585.00	0.03
133	301189	奥尼电子	1,500	88,395.00	0.02

134	300004	南风股份	8,600	86,860.00	0.02
135	300134	大富科技	10,100	86,355.00	0.02
136	301316	慧博云通	2,100	82,698.00	0.02
137	300671	富满微	900	77,544.00	0.02
138	300483	首华燃气	4,300	75,594.00	0.02
139	688808	联讯仪器	47	74,463.51	0.02
140	000967	盈峰环境	6,700	70,551.00	0.02
141	300806	斯迪克	600	67,200.00	0.02
142	300115	长盈精密	2,400	67,056.00	0.02
143	002064	华峰化学	7,000	66,430.00	0.02
144	301220	亚香股份	2,000	64,440.00	0.02
145	301055	张小泉	1,500	63,705.00	0.02
146	000100	TCL 科技	10,800	62,856.00	0.02
147	688797	臻宝科技	131	61,395.77	0.02
148	300005	探路者	2,700	61,020.00	0.02
149	301149	隆华新材	4,900	51,842.00	0.01
150	301408	华人健康	3,600	51,768.00	0.01
151	688818	电科蓝天	660	46,292.40	0.01
152	603826	坤彩科技	1,800	46,008.00	0.01
153	301237	和顺科技	600	44,448.00	0.01
154	688820	盛合晶微	284	40,183.16	0.01
155	300953	震裕科技	300	40,110.00	0.01
156	601061	中信金属	3,600	38,772.00	0.01
157	301123	奕东电子	300	36,216.00	0.01
158	600150	中国船舶	1,000	33,790.00	0.01
159	300619	金银河	1,080	33,598.80	0.01
160	688712	北芯生命	917	32,938.64	0.01
161	301607	富特科技	600	31,350.00	0.01
162	300986	志特新材	1,800	30,870.00	0.01
163	300818	耐普矿机	1,600	30,240.00	0.01
164	301529	福赛科技	300	28,908.00	0.01
165	300333	兆日科技	3,200	27,072.00	0.01
166	600188	兖矿能源	1,500	26,655.00	0.01
167	688785	恒运昌	57	26,399.55	0.01
168	688813	泰金新能	149	25,641.41	0.01
169	300442	润泽科技	300	24,921.00	0.01
170	300946	恒而达	600	23,634.00	0.01
171	300816	艾可蓝	300	21,960.00	0.01
172	301631	壹连科技	300	21,558.00	0.01
173	300400	劲拓股份	500	18,825.00	0.01
174	600989	宝丰能源	900	18,297.00	0.00
175	688781	视涯科技	381	18,139.41	0.00
176	300031	宝通科技	600	17,142.00	0.00

177	600346	恒力石化	900	15,939.00	0.00
178	300118	东方日升	1,200	14,940.00	0.00
179	300695	兆丰股份	300	14,937.00	0.00
180	000803	山高环能	2,200	14,916.00	0.00
181	688811	有研复材	602	14,526.26	0.00
182	301275	汉朔科技	300	13,470.00	0.00
183	300456	赛微电子	300	12,741.00	0.00
184	300745	欣锐科技	300	12,666.00	0.00
185	300677	英科医疗	300	11,751.00	0.00
186	603459	红板科技	130	10,961.60	0.00
187	300113	顺网科技	600	10,926.00	0.00
188	300518	新迅达	300	9,915.00	0.00
189	301439	泓淋电力	600	9,432.00	0.00
190	603407	长裕集团	127	9,329.42	0.00
191	300759	康龙化成	300	8,679.00	0.00
192	300257	开山股份	300	8,604.00	0.00
193	300127	银河磁体	300	8,385.00	0.00
194	301260	格力博	600	8,106.00	0.00
195	301029	怡合达	300	8,103.00	0.00
196	301076	新瀚新材	300	7,854.00	0.00
197	300735	光弘科技	300	6,822.00	0.00
198	300153	科泰电源	300	6,786.00	0.00
199	301056	森赫股份	600	6,720.00	0.00
200	301587	中瑞股份	300	6,585.00	0.00
201	300984	金沃股份	100	5,373.00	0.00
202	300952	恒辉安防	300	5,220.00	0.00
203	688816	易思维	91	5,196.10	0.00
204	002545	东方铁塔	300	4,866.00	0.00
205	300872	天阳科技	300	4,740.00	0.00
206	000776	广发证券	200	4,680.00	0.00
207	000060	中金岭南	600	4,542.00	0.00
208	300291	百纳千成	900	4,347.00	0.00
209	300997	欢乐家	300	4,065.00	0.00
210	603435	嘉德利	87	4,063.77	0.00
211	601112	振石股份	206	3,623.54	0.00
212	300349	金卡智能	300	3,282.00	0.00
213	002493	荣盛石化	300	3,225.00	0.00
214	002197	证通电子	400	2,296.00	0.00
215	603248	锡华科技	108	2,277.72	0.00
216	603352	至信股份	76	1,939.52	0.00
217	600336	澳柯玛	300	1,869.00	0.00
218	603284	林平发展	44	1,534.28	0.00
219	002299	圣农发展	100	1,516.00	0.00

220	603915	国茂股份	100	1,419.00	0.00
221	601700	风范股份	300	1,308.00	0.00
222	603293	埃泰克	35	1,187.55	0.00
223	600167	联美控股	200	1,118.00	0.00
224	001286	陕西能源	100	1,014.00	0.00
225	002488	金固股份	100	891.00	0.00
226	600232	金鹰股份	100	630.00	0.00
227	601121	宝地矿业	100	564.00	0.00
228	002266	浙富控股	100	506.00	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	688256	寒武纪	21,964,161.17	10.22
2	688041	海光信息	19,209,256.89	8.94
3	688146	中船特气	8,399,052.24	3.91
4	688008	澜起科技	8,354,669.40	3.89
5	688981	中芯国际	7,887,189.32	3.67
6	688525	佰维存储	6,827,607.19	3.18
7	688183	生益电子	6,823,092.64	3.18
8	688012	中微公司	6,492,890.56	3.02
9	688126	沪硅产业	5,839,857.06	2.72
10	688737	中自科技	4,911,400.89	2.29
11	688506	百利天恒	4,629,675.74	2.15
12	688255	凯尔达	4,497,002.86	2.09
13	688521	芯原股份	4,449,673.67	2.07
14	688082	盛美上海	4,350,805.57	2.02
15	688249	晶合集成	4,285,962.02	1.99
16	688347	华虹宏力	4,279,936.48	1.99
17	688110	东芯股份	4,238,233.03	1.97
18	688777	中控技术	4,235,832.29	1.97
19	688702	盛科通信	4,229,930.90	1.97
20	688072	拓荆科技	4,089,109.03	1.90

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	688256	寒武纪	21,004,173.38	9.78
2	688041	海光信息	18,593,622.53	8.65
3	688008	澜起科技	8,790,445.18	4.09
4	688146	中船特气	7,662,135.63	3.57
5	688012	中微公司	7,355,055.71	3.42

6	688981	中芯国际	7,238,746.62	3.37
7	688183	生益电子	6,740,115.61	3.14
8	688126	沪硅产业	5,992,725.47	2.79
9	688303	大全能源	4,608,643.83	2.14
10	688525	佰维存储	4,588,401.71	2.14
11	688737	中自科技	4,585,812.18	2.13
12	688521	芯原股份	4,371,360.26	2.03
13	688017	绿的谐波	4,200,936.72	1.96
14	688072	拓荆科技	4,172,337.71	1.94
15	688082	盛美上海	4,074,546.58	1.90
16	688047	龙芯中科	3,907,719.18	1.82
17	688432	有研硅	3,817,662.82	1.78
18	688629	华丰科技	3,726,126.55	1.73
19	688396	华润微	3,467,772.56	1.61
20	688172	燕东微	3,465,277.28	1.61

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	877,636,803.04
卖出股票收入（成交）总额	849,571,737.37

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货交易。

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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,180,803.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,180,803.13

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	5,298,288.72	1.42	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
中欧上证科创板综合指数增强 A	1,258	121,826.96	1,976,820.48	1.29%	151,281,496.67	98.71%
中欧上证科创板综合指数增强 C	3,445	12,377.15	113,952.35	0.27%	42,525,324.66	99.73%
合计	4,703	41,653.75	2,090,772.83	1.07%	193,806,821.33	98.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧上证科创板综合指数增强 A	0.00	0.00%
	中欧上证科创板综合指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧上证科创板综合指数增强 A	0
	中欧上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧上证科创板综合指数增强 A	0
	中欧上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧上证科创板综合指数增强 A	中欧上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 7 月 22 日) 基金份额总额	626,795,430.13	344,793,332.46
本报告期期初基金份额总额	106,182,920.61	68,549,720.48
本报告期基金总申购份额	221,009,938.60	58,793,459.27
减：本报告期基金总赎回份额	173,934,542.06	84,703,902.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	153,258,317.15	42,639,277.01

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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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(%)	
财通证券	6	1,132,128,855.98	65.57	207,076.06	65.20	-
金融街证券	3	594,488,013.64	34.43	110,524.06	34.80	-

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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
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
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	中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	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
8	中欧上证科创板综合指数增强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
9	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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

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