

中欧稳健添悦债券型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 23 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	16
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67

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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 本报告期投资基金情况	68
7.13 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	71
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
10.8 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	71
10.9 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧稳健添悦债券型证券投资基金	
基金简称	中欧稳健添悦债券	
基金主代码	024966	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 23 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	789,686,367.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧稳健添悦债券 A	中欧稳健添悦债券 C
下属分级基金的交易代码	024966	024967
报告期末下属分级基金的份额总额	722,273,806.70 份	67,412,560.92 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，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
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 800 指数收益率×12%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×3%+中债综合财富（总值）指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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 23 日-2026 年 6 月 30 日)	
	中欧稳健添悦债券 A	中欧稳健添悦债券 C
本期已实现收益	16,864,915.71	1,477,973.37
本期利润	22,611,596.66	1,850,735.86
加权平均基金份 额本期利润	0.0155	0.0128
本期加权平均净 值利润率	1.55%	1.27%
本期基金份额净 值增长率	1.56%	1.39%
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	10,971,059.23	904,593.10
期末可供分配基 金份额利润	0.0152	0.0134
期末基金资产净 值	733,566,175.29	68,347,188.09

期末基金份额净值	1.0156	1.0139
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	1.56%	1.39%

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

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

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

4、本基金合同自 2026 年 01 月 23 日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧稳健添悦债券 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	2.23%	0.27%	2.36%	0.19%	-0.13%	0.08%
自基金合同生效起至今	1.56%	0.22%	1.66%	0.19%	-0.10%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*12%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。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。

中欧稳健添悦债券 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	2.14%	0.27%	2.36%	0.19%	-0.22%	0.08%
自基金合同生效起至今	1.39%	0.22%	1.66%	0.19%	-0.27%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*12%+中

证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。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

中欧稳健添悦债券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 2026 年 1 月 23 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应当符合基金合同约定。

中欧稳健添悦债券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 2026 年 1 月 23 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

应当符合基金合同约定。

§ 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		
苏佳	基金经理 / 基金经理助理	2026-01-29	-	9 年	历任广发银行股份有限公司总行金融机构部行员，易方达基金管理有限公司投资支持专员，易方达基金管理有限公司投资经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管理有限公司。
陈凯杨	固收投决会委员 / 投资总监 / 基金经理	2026-01-23	-	20 年	历任深圳发展银行股份有限公司债券交易员，博时基金管理有限公司债券交易员，长城基金管理有限公司投资经理，博时基金管理有限公司董事总经理兼固定收益投资一部投资总监、基金经理。2023-09-25 加入中欧基金管理有限公司，历任固定收益投资部行政负责人。
邓欣雨	固收投决会委员 / 混合资产组组长 / 基金经理	2026-04-15	-	17 年	历任博时基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益研究员兼基金经理助理、基金经理、混合资产投资部投资总监助理兼基金经理。2023-10-27 加入中欧基金管理有限公司。

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，其中苏佳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

从上半年国内资本市场表现看，权益市场整体震荡上涨，万得全 A 指数上涨 11.52%，但全 A 等权指数下跌 1.37%，A 股市场内部结构性差异极其显著，呈现出科技成长主导的结构性牛市，而以消费为代表的传统板块表现低迷，“硅基”挤压“碳基”，市场核心主线围绕 AI 算力和半导体展开。转债方面，中证转债指数上涨 2.51%，在高价格和高估值局面下，转债市场呈现高波动震荡行情特征，捕捉股市映射下的结构机会和波段交易更为重要。受益于流动性宽松环境，债市震荡上涨，不过低利率环境对绝对收益空间有所制约。展开看，一季度年初受股票和商品高涨情绪影响，债券市场尤其利率债和高弹性品种出现急跌，随后在宽松的资金面和机构年初配置力量的驱动下走出一波陡峭化的修复行情，短端收益率回落幅度大于长端，品种利差、信用利差、城投利差均出现不同程度的压缩；二季度债市延续牛市态势，季度内收益率震荡下行、直到季末有所回调，资金面充裕是二季度债市走强的核心驱动，同时看到社融和信贷走弱、信用扩张显著放缓，

各期限收益率出现较大幅回落，期限利差、信用利差、品种利差同步压缩。

组合运作方面，基于我们对 2026 年展望中提到的思路，即权益市场从估值驱动转向业绩驱动，波动加大且宽基指数收益预期下降，投资上更注重从业绩方面挖掘机会，因此投资上主要配置景气方面的个券，同时考虑到组合的稳健性目标，持仓有适度分散特征。考虑到转债配置价值较为一般，组合很少参与转债投资。纯债方面，以信用类品种为底仓配置，适度参与利率品种交易，组合久期整体维持中性偏积极水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准收益率为 1.66%；基金 C 类份额净值增长率为 1.39%，同期业绩比较基准收益率为 1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面整体趋于平稳的可能性偏大，外需方面需观察高油价中枢带来的需求影响，预计出口边际转弱的概率在提升，内需难有波动，对增量政策持中性判断。考虑到国内经济处于新旧动能转换的结构调整期，质量重于总量，投资机会更应从高端制造或科技突破领域中寻找，这代表着中国硬实力的提升，特别是“十五五”战略规划中着重提及的方向。在权益市场估值普遍不低的环境下，需秉持从业绩方面寻找优质资产，一方面 beta 视角看，可关注有业绩的强产业趋势领域，如 AI 相关等，另一方面 alpha 视角看，景气思维选股，如可关注全球竞争力强、基本面在右侧的优质企业。在社会总需求波动不大情况下，融资需求偏弱，整体看处于信用收缩环境中，同时我们的分析显示银行负债端成本处于下行中，且银行并未主动收缩资产负债表，债市环境相对偏友好。

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

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧稳健添悦债券型证券投资基金

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
资 产：		

货币资金	6.4.7.1	1,122,897.01
结算备付金		8,490,638.73
存出保证金		193,606.37
交易性金融资产	6.4.7.2	927,865,898.99
其中：股票投资		127,506,684.49
基金投资		—
债券投资		800,359,214.50
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		881,865.34
应收股利		—
应收申购款		4,081,553.94
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		942,636,460.38
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30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		136,048,084.04
应付清算款		1,580,117.02
应付赎回款		1,914,923.27
应付管理人报酬		473,658.47
应付托管费		118,414.60
应付销售服务费		31,032.55
应付投资顾问费		—
应交税费		30,275.38
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.6	526,591.67
负债合计		140,723,097.00
净资产：		

实收基金	6.4.7.7	789,686,367.62
未分配利润	6.4.7.8	12,226,995.76
净资产合计		801,913,363.38
负债和净资产总计		942,636,460.38

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 789,686,367.62 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0156 元，基金份额总额 722,273,806.70 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0139 元，基金份额总额 67,412,560.92 份。

2. 本基金基金合同于 2026 年 01 月 23 日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧稳健添悦债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,370,802.67
1. 利息收入		3,695,436.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,230,595.17
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		2,464,841.20
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,555,066.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,770,270.08
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	6,907,327.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	877,469.82
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）	6.4.7.16	6,119,443.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	855.87
减：二、营业总支出		5,908,470.15
1. 管理人报酬		4,221,105.52
2. 托管费		1,055,276.41

3. 销售服务费		253,980.89
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		277,137.20
其中：卖出回购金融资产支出		277,137.20
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		15,299.85
8. 其他费用	6.4.7.20	85,670.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,462,332.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,462,332.52
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		24,462,332.52

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧稳健添悦债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,160,337,565.43	-	-	2,160,337,565.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,370,651,197.81	-	12,226,995.76	-1,358,424,202.05
（一）、综合收益总额	-	-	24,462,332.52	24,462,332.52
（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）	-1,370,651,197.81	-	-12,235,336.76	-1,382,886,534.57
其中：1. 基金申购款	76,172,390.46	-	1,169,544.36	77,341,934.82
2. 基金赎回款	-1,446,823,588.27	-	-13,404,881.12	-1,460,228,469.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	789,686,367.62	-	12,226,995.76	801,913,363.38

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

基金管理人负责人

王音然

主管会计工作负责人

李宝林

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧稳健添悦债券型证券投资基金(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]1435 号《关于准予中欧稳健添悦债券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《中欧稳健添悦债券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 2,159,697,809.01 元，经向中国证监会备案，《中欧稳健添悦债券型证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,160,337,565.43 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 639,756.42 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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期

间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或

债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层

次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费按照权责发生制原则在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《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》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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	1,122,897.01
等于：本金	1,120,716.17
加：应计利息	2,180.84
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,122,897.01

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	123,291,625.37	-	127,506,684.49	4,215,059.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	159,939,326.30	889,855.78	161,667,755.78	838,573.70
	银行间市场	633,168,189.38	4,457,458.72	638,691,458.72	1,065,810.62
	合计	793,107,515.68	5,347,314.50	800,359,214.50	1,904,384.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		916,399,141.05	5,347,314.50	927,865,898.99	6,119,443.44

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	454,187.37
其中：交易所市场	423,880.58
银行间市场	30,306.79
应付利息	-
预提费用-信息披露费	55,626.15
预提费用-审计费	16,688.64
应付补差费	89.51
合计	526,591.67

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧稳健添悦债券 A

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,965,948,921.62	1,965,948,921.62
本期申购	71,702,521.94	71,702,521.94
本期赎回（以“-”号填列）	-1,315,377,636.86	-1,315,377,636.86
本期末	722,273,806.70	722,273,806.70

中欧稳健添悦债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	194,388,643.81	194,388,643.81
本期申购	4,469,868.52	4,469,868.52
本期赎回（以“-”号填列）	-131,445,951.41	-131,445,951.41
本期末	67,412,560.92	67,412,560.92

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同于 2026 年 01 月 23 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,160,337,565.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 639,756.42 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧稳健添悦债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	16,864,915.71	5,746,680.95	22,611,596.66
本期基金份额交易产生的变动数	-5,893,856.48	-5,425,371.59	-11,319,228.07
其中：基金申购款	797,433.48	346,433.07	1,143,866.55
基金赎回款	-6,691,289.96	-5,771,804.66	-12,463,094.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,971,059.23	321,309.36	11,292,368.59

中欧稳健添悦债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,477,973.37	372,762.49	1,850,735.86
本期基金份额交易产生的变动数	-573,380.27	-342,728.42	-916,108.69
其中：基金申购款	17,395.53	8,282.28	25,677.81
基金赎回款	-590,775.80	-351,010.70	-941,786.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	904,593.10	30,034.07	934,627.17

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	229,363.42
定期存款利息收入	963,113.87
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	37,957.53
其他	160.35
合计	1,230,595.17

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	546,376,853.93
减：卖出股票成本总额	532,712,132.04
减：交易费用	894,451.81
买卖股票差价收入	12,770,270.08

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,793,389.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,113,937.35
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	6,907,327.09

6.4.7.12.2 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23日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	1,125,092,567.86

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,117,568,904.70
减：应计利息总额	6,389,733.99
减：交易费用	19,991.82
买卖债券差价收入	1,113,937.35

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	877,469.82
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	877,469.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,119,443.44
股票投资	4,215,059.12
债券投资	1,904,384.32
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	6,119,443.44

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	843.62
基金转换费收入	12.25
合计	855.87

6.4.7.18 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	16,688.64
信息披露费	55,626.15
证券出借违约金	-
汇划手续费	12,771.16
开户费	400.00
证券组合费	184.33
合计	85,670.28

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

中国工商银行股份有限公司	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
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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国都证券	57,342,682.43	4.78

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
国都证券	562,319,686.80	52.76

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
国都证券	2,586,054,000.00	10.57

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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23日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期	占当期佣金总量	期末应付佣金余	占期末应付佣金

	佣金	的比例 (%)	额	总额的比例 (%)
国都证券	25,263.62	4.82	-	-

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,221,105.52
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,478,048.65
应支付基金管理人的净管理费	2,743,056.87

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。

本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分，如扣除后 E<0，则 E 取 0。

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,055,276.41

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分，如扣除后 E<0，则 E 取 0。

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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧稳健添悦债券 A	中欧稳健添悦债券 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	251,068.05	251,068.05
中欧财富	-	29.44	29.44
合计	-	251,097.49	251,097.49

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

基金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

本报告期期末，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 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,122,897.01	229,363.42

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110101	宝钛	2026 年 6 月	1 个月内（含）	新债未上	100.00	100.00	700	70,000.00	70,001.07	-

	转债	25 日		市						
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	120	12,000.00	12,000.37	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.07	-
123274	维科转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	9	900.00	900.02	-

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 7 月 13 日	890.99	252	165,186.00	221,641.56	-

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 70,048,084.04 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
102584408	25 中冶 MTN013	2026 年 7 月 1 日	102.63	200,000	20,525,671.23
112515162	25 民生银行 CD162	2026 年 7 月 1 日	99.99	218,000	21,798,758.66
232400018	24 宁波银行二级资本债 01	2026 年 7 月 1 日	102.61	120,000	12,312,904.11
260401	26 农发 01	2026 年 7 月 1 日	100.82	211,000	21,273,713.70
合计				749,000	75,911,047.70

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，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 66,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。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。在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	10,067,654.79
合计	10,067,654.79

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以下未有三方评级的超短期融资债券。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	99,996,681.73
A-1 以下	—
未评级	—
合计	99,996,681.73

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的主体评级。2. 债券投资以全价列示。3. A-1 为 AAA，A-1 以下为 AAA 以下。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	245,278,389.56
AAA 以下	10,311,390.87
未评级	434,705,097.55
合计	690,294,877.98

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的一般公司债、一般中期票据、政策银行债、证券公司债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有长期信用评级的同业存单。

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。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

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	1,122,897.01	-	-	-	1,122,897.01
结算备付金	8,490,638.73	-	-	-	8,490,638.73
存出保证金	193,606.37	-	-	-	193,606.37
交易性金融资产	160,475,980.36	639,796,332.61	86,901.53	127,506,684.49	927,865,898.99
应收申购款	-	-	-	4,081,553.94	4,081,553.94
应收清算款	-	-	-	881,865.34	881,865.34
资产总计	170,283,122.47	639,796,332.61	86,901.53	132,470,103.77	942,636,460.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,914,923.27	1,914,923.27
应付管理人报酬	-	-	-	473,658.47	473,658.47
应付托管费	-	-	-	118,414.60	118,414.60
应付清算款	-	-	-	1,580,117.02	1,580,117.02
卖出回购金融资产款	136,048,084.04	-	-	-	136,048,084.04
应付销售服务费	-	-	-	31,032.55	31,032.55
应交税费	-	-	-	30,275.38	30,275.38
其他负债	-	-	-	526,591.67	526,591.67
负债总计	136,048,084.04	-	-	4,675,012.96	140,723,097.00
利率敏感度缺口	34,235,038.43	639,796,332.61	86,901.53	127,795,090.81	801,913,363.38

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

假设	除市场利率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）
	利率上升 25BP	-3,705,061.45
	利率下降 25BP	3,731,794.91

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

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			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,416,528.28	-	3,416,528.28
资产合计	-	3,416,528.28	-	3,416,528.28
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,416,528.28	-	3,416,528.28

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）
	港币相对人民币贬值 5%	-170,826.41
	港币相对人民币升值 5%	170,826.41

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	127,506,684.49	15.90
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	127,506,684.49	15.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 15.90%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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
第一层次	127,285,042.93
第二层次	800,580,856.06
第三层次	—
合计	927,865,898.99

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	127,506,684.49	13.53
	其中：股票	127,506,684.49	13.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	800,359,214.50	84.91
	其中：债券	800,359,214.50	84.91
	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	9,613,535.74	1.02
8	其他各项资产	5,157,025.65	0.55
9	合计	942,636,460.38	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,416,528.28 元，占基金资产净值比例 0.43%。

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	315,480.00	0.04
B	采矿业	3,409,237.00	0.43
C	制造业	96,885,020.83	12.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	740,737.00	0.09
E	建筑业	255,115.00	0.03
F	批发和零售业	1,205,486.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	569,873.00	0.07
H	住宿和餐饮业	50,960.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,919,260.73	1.86
J	金融业	2,593,732.00	0.32
K	房地产业	728,848.00	0.09
L	租赁和商务服务业	335,516.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,139,363.65	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	483,148.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,887.00	0.01
Q	卫生和社会工作	10,164.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	269,768.00	0.03
S	综合	129,560.00	0.02
	合计	124,090,156.21	15.47

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-

能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	3,416,528.28	0.43
电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	3,416,528.28	0.43

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	688256	寒武纪	3,565	5,688,135.75	0.71
2	300308	中际旭创	4,400	5,588,000.00	0.70
3	600522	中天科技	68,400	4,150,512.00	0.52
4	601138	工业富联	56,400	4,069,260.00	0.51
5	688041	海光信息	10,690	3,958,507.00	0.49
6	688002	睿创微纳	25,298	3,913,347.62	0.49
7	002353	杰瑞股份	24,000	3,660,000.00	0.46
8	00981	中芯国际	44,000	3,416,528.28	0.43
8	688981	中芯国际	1,375	218,377.50	0.03
9	002384	东山精密	12,000	3,148,200.00	0.39
10	002938	鹏鼎控股	27,600	2,908,488.00	0.36
11	002281	光迅科技	7,200	1,849,968.00	0.23
12	688347	华虹宏力	5,178	1,741,361.40	0.22
13	003018	金富科技	21,700	1,654,191.00	0.21
14	605196	华通线缆	51,800	1,351,980.00	0.17
15	603297	永新光学	5,400	793,530.00	0.10
16	301202	朗威股份	19,600	653,268.00	0.08
17	688668	鼎通科技	1,646	614,451.80	0.08
18	688630	芯碁微装	1,077	591,693.03	0.07
19	301608	博实结	11,500	577,990.00	0.07
20	301326	捷邦科技	3,900	543,543.00	0.07
21	688519	南亚新材	1,348	512,293.92	0.06
22	688498	源杰科技	255	480,930.00	0.06
23	002544	普天科技	25,900	471,898.00	0.06
24	300768	迪普科技	33,100	455,787.00	0.06
25	300814	中富电路	2,200	449,900.00	0.06
26	300127	银河磁体	15,900	444,405.00	0.06
27	002371	北方华创	500	442,280.00	0.06
28	688383	新益昌	2,324	437,004.96	0.05

29	601225	陕西煤业	21,000	427,350.00	0.05
30	600071	凤凰光学	24,500	419,685.00	0.05
31	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.05
32	301456	盘古智能	17,700	399,666.00	0.05
33	600183	生益科技	2,300	398,820.00	0.05
34	002912	中新赛克	21,500	396,460.00	0.05
35	300428	立中集团	21,700	394,506.00	0.05
36	688012	中微公司	825	386,512.50	0.05
37	002441	众业达	49,300	384,540.00	0.05
38	002090	金智科技	42,100	372,164.00	0.05
39	301622	英思特	7,900	372,090.00	0.05
40	002533	金杯电工	33,900	361,713.00	0.05
41	002475	立讯精密	5,000	352,000.00	0.04
42	300542	新晨科技	31,700	351,236.00	0.04
43	601628	中国人寿	9,800	346,430.00	0.04
44	002827	高争民爆	14,300	345,202.00	0.04
45	300830	金现代	42,000	333,480.00	0.04
46	002093	国脉科技	52,900	333,270.00	0.04
47	300618	寒锐钴业	9,300	332,010.00	0.04
48	301510	固高科技	10,200	325,686.00	0.04
49	002916	深南电路	700	320,530.00	0.04
50	601899	紫金矿业	12,600	316,764.00	0.04
51	301280	珠城科技	6,200	313,534.00	0.04
52	300933	中辰股份	50,700	308,256.00	0.04
53	002953	日丰股份	34,900	304,328.00	0.04
54	300502	新易盛	500	303,500.00	0.04
55	000729	燕京啤酒	29,900	302,887.00	0.04
56	002148	北纬科技	50,800	295,148.00	0.04
57	301369	联动科技	1,200	294,000.00	0.04
58	688032	禾迈股份	3,436	290,410.72	0.04
59	601088	中国神华	7,400	288,896.00	0.04
60	301200	大族数控	800	288,520.00	0.04
61	601988	中国银行	49,700	284,284.00	0.04
62	605378	野马电池	20,300	281,358.00	0.04
63	601857	中国石油	32,000	277,760.00	0.03
64	300423	昇辉科技	50,400	277,704.00	0.03
65	601288	农业银行	45,700	277,399.00	0.03
66	300750	宁德时代	700	275,107.00	0.03
67	301491	汉桑科技	6,900	270,963.00	0.03
68	301330	熵基科技	10,600	265,636.00	0.03
69	688082	盛美上海	614	265,248.00	0.03
70	600571	信雅达	27,200	265,200.00	0.03
71	603396	金辰股份	9,900	262,350.00	0.03

72	603312	西典新能	7,700	261,646.00	0.03
73	688173	希荻微	13,624	260,763.36	0.03
74	688182	灿勤科技	6,039	260,099.73	0.03
75	002463	沪电股份	1,700	259,760.00	0.03
76	600188	兖矿能源	14,500	257,665.00	0.03
77	300793	佳禾智能	22,900	257,625.00	0.03
78	605099	共创草坪	8,000	257,600.00	0.03
79	301268	铭利达	18,300	255,834.00	0.03
80	300140	节能环境	50,900	252,973.00	0.03
81	300711	广哈通信	14,800	242,720.00	0.03
82	300394	天孚通信	800	242,144.00	0.03
83	300946	恒而达	6,100	240,279.00	0.03
84	601155	新城控股	23,200	238,032.00	0.03
85	300951	博硕科技	4,700	237,350.00	0.03
86	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.03
87	300672	国科微	800	236,000.00	0.03
88	688008	XD 澜起科	753	233,354.70	0.03
89	300466	赛摩智能	32,800	230,912.00	0.03
90	301083	百胜智能	17,500	230,475.00	0.03
91	002043	兔宝宝	20,700	229,356.00	0.03
92	600098	广州发展	38,000	224,580.00	0.03
93	600489	中金黄金	12,400	223,820.00	0.03
94	300950	德固特	13,300	223,041.00	0.03
95	688072	拓荆科技	252	221,641.56	0.03
96	605058	澳弘电子	6,100	220,576.00	0.03
97	300433	蓝思科技	4,100	220,006.00	0.03
98	600176	中国巨石	3,000	218,640.00	0.03
99	603615	茶花股份	13,500	218,025.00	0.03
100	300408	三环集团	1,300	216,970.00	0.03
101	300513	恒实科技	29,600	214,304.00	0.03
102	300213	佳讯飞鸿	35,200	213,312.00	0.03
103	688230	芯导科技	2,674	210,737.94	0.03
104	600456	宝钛股份	7,700	210,595.00	0.03
105	301082	久盛电气	23,400	209,664.00	0.03
106	601118	海南橡胶	42,600	209,592.00	0.03
107	002139	拓邦股份	21,900	208,488.00	0.03
108	301388	欣灵电气	8,900	207,548.00	0.03
109	300447	全信股份	13,900	207,527.00	0.03
110	000725	京东方 A	23,900	207,452.00	0.03
111	600030	中信证券	7,200	206,856.00	0.03
112	000045	深纺织 A	19,600	206,584.00	0.03
113	601318	中国平安	4,300	205,282.00	0.03
114	301159	三维天地	7,000	203,700.00	0.03

115	301283	聚胶股份	8,200	200,736.00	0.03
116	301328	维峰电子	2,800	199,360.00	0.02
117	688766	普冉股份	260	199,316.00	0.02
118	603259	药明康德	1,600	199,216.00	0.02
119	300648	星云股份	4,600	198,812.00	0.02
120	002451	摩恩电气	28,100	197,824.00	0.02
121	300240	飞力达	38,800	193,612.00	0.02
122	300940	南极光	12,800	193,024.00	0.02
123	688486	龙迅股份	3,032	192,774.56	0.02
124	605118	力鼎光电	5,500	191,895.00	0.02
125	002244	滨江集团	25,000	190,000.00	0.02
126	601699	潞安环能	13,300	189,924.00	0.02
127	000333	美的集团	2,500	188,825.00	0.02
128	003002	壶化股份	10,700	186,073.00	0.02
129	688502	茂莱光学	268	185,884.80	0.02
130	002237	恒邦股份	12,600	185,094.00	0.02
131	001388	信通电子	6,700	184,049.00	0.02
132	300822	贝仕达克	15,700	183,690.00	0.02
133	300884	狄耐克	18,400	182,528.00	0.02
134	002189	中光学	8,100	181,116.00	0.02
135	688686	奥普特	1,075	181,019.25	0.02
136	300510	金冠股份	58,000	180,960.00	0.02
137	603993	洛阳钼业	10,300	180,765.00	0.02
138	688620	安凯微	11,130	180,306.00	0.02
139	301380	挖金客	6,500	179,335.00	0.02
140	688311	盟升电子	6,834	178,982.46	0.02
141	300991	创益通	5,000	176,050.00	0.02
142	000810	创维数字	13,100	173,575.00	0.02
143	002564	天沃科技	40,300	173,290.00	0.02
144	300306	远方信息	17,800	172,660.00	0.02
145	601728	中国电信	32,900	170,751.00	0.02
146	001979	招商蛇口	26,400	169,752.00	0.02
147	603530	神马电力	3,300	167,970.00	0.02
148	301378	通达海	7,000	167,860.00	0.02
149	002594	比亚迪	2,100	167,370.00	0.02
150	002913	奥士康	2,600	166,244.00	0.02
151	688141	杰华特	1,073	164,705.50	0.02
152	300288	朗玛信息	18,500	164,650.00	0.02
153	603217	元利科技	7,300	163,739.00	0.02
154	300699	光威复材	5,700	163,305.00	0.02
155	600036	招商银行	4,600	163,300.00	0.02
156	605258	协和电子	4,700	159,236.00	0.02
157	301567	贝隆精密	4,600	159,206.00	0.02

158	001395	亚联机械	6,800	158,440.00	0.02
159	301112	信邦智能	5,200	157,248.00	0.02
160	688293	奥浦迈	3,765	156,962.85	0.02
161	300315	掌趣科技	40,000	156,000.00	0.02
162	300025	华星创业	37,000	155,400.00	0.02
163	300789	唐源电气	8,700	154,599.00	0.02
164	688348	昱能科技	4,439	154,388.42	0.02
165	600642	申能股份	17,600	153,648.00	0.02
166	605288	凯迪股份	1,800	152,730.00	0.02
167	300341	麦克奥迪	11,400	151,050.00	0.02
168	002268	电科网安	11,700	150,930.00	0.02
168	002401	中远海科	13,000	150,930.00	0.02
169	688059	华锐精密	753	150,381.63	0.02
170	603025	大豪科技	11,000	150,040.00	0.02
171	301093	华兰股份	1,100	149,193.00	0.02
172	002006	精工科技	10,100	148,571.00	0.02
173	301169	零点有数	2,100	148,386.00	0.02
174	605588	冠石科技	2,200	147,774.00	0.02
175	300960	通业科技	9,500	147,725.00	0.02
176	300988	津荣天宇	9,300	145,359.00	0.02
177	688522	纳睿雷达	7,245	145,044.90	0.02
178	605289	罗曼股份	1,000	145,000.00	0.02
179	688539	高华科技	4,535	144,575.80	0.02
180	001358	兴欣新材	5,500	142,120.00	0.02
181	601898	中煤能源	11,600	141,288.00	0.02
182	603816	顾家家居	6,300	140,868.00	0.02
183	301606	绿联科技	2,300	140,346.00	0.02
184	600468	百利电气	23,000	139,610.00	0.02
185	301533	威马农机	5,800	137,228.00	0.02
186	002376	新北洋	23,800	136,850.00	0.02
187	601865	福莱特	13,000	136,630.00	0.02
188	300604	长川科技	400	136,568.00	0.02
189	688778	厦钨新能	2,510	136,544.00	0.02
190	301025	读客文化	17,400	135,024.00	0.02
191	002273	水晶光电	3,800	134,824.00	0.02
192	301665	泰禾股份	6,400	134,144.00	0.02
193	688252	天德钰	5,575	133,800.00	0.02
194	300968	格林精密	13,800	133,032.00	0.02
195	300150	世纪瑞尔	33,400	132,598.00	0.02
196	002232	启明信息	9,700	131,532.00	0.02
197	688409	富创精密	425	130,156.25	0.02
198	600620	天宸股份	32,800	129,560.00	0.02
199	301511	德福科技	900	129,465.00	0.02

200	688100	威胜信息	4,198	128,416.82	0.02
201	600295	鄂尔多斯	11,900	127,568.00	0.02
202	688146	中船特气	360	125,996.40	0.02
203	300414	中光防雷	11,400	125,628.00	0.02
204	600999	招商证券	5,900	124,490.00	0.02
205	002660	茂硕电源	19,100	124,150.00	0.02
206	002666	德联集团	31,300	123,635.00	0.02
207	301032	新柴股份	13,200	122,760.00	0.02
208	300284	苏交科	24,400	122,000.00	0.02
209	688049	炬芯科技	2,598	121,872.18	0.02
210	002045	国光电器	15,500	121,675.00	0.02
211	301586	佳力奇	3,600	121,176.00	0.02
212	600866	星湖科技	27,600	121,164.00	0.02
213	600988	赤峰黄金	4,600	121,072.00	0.02
214	002296	辉煌科技	13,600	120,768.00	0.02
215	601211	国泰海通	6,600	120,120.00	0.01
216	300111	向日葵	41,700	120,096.00	0.01
217	001379	腾达科技	7,600	119,320.00	0.01
218	688025	杰普特	253	118,910.00	0.01
219	600737	中粮糖业	9,600	118,368.00	0.01
220	601100	恒立液压	1,100	118,316.00	0.01
221	301590	优优绿能	900	118,305.00	0.01
222	688300	联瑞新材	484	118,289.60	0.01
223	300797	钢研纳克	8,900	118,014.00	0.01
224	603421	鼎信通讯	19,100	117,465.00	0.01
225	603160	汇顶科技	1,900	117,249.00	0.01
226	300413	芒果超媒	8,000	117,040.00	0.01
227	301185	鸥玛软件	7,800	115,908.00	0.01
228	300701	森霸传感	12,100	115,797.00	0.01
229	688153	唯捷创芯	3,599	115,599.88	0.01
230	002017	东信和平	7,900	115,577.00	0.01
231	301121	紫建电子	3,600	115,272.00	0.01
232	600602	云赛智联	7,100	114,168.00	0.01
233	003022	联泓新科	4,400	113,960.00	0.01
233	603273	天元智能	8,800	113,960.00	0.01
234	600547	山东黄金	4,900	113,141.00	0.01
235	605183	确成股份	7,600	112,024.00	0.01
236	688167	炬光科技	316	111,930.36	0.01
237	600435	北方导航	9,900	110,880.00	0.01
238	000988	华工科技	600	110,766.00	0.01
239	688582	芯动联科	1,701	110,565.00	0.01
240	000786	北新建材	6,100	110,349.00	0.01
241	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.01

242	688639	华恒生物	6,823	110,123.22	0.01
243	301575	艾芬达	4,100	109,921.00	0.01
244	301522	上大股份	4,200	109,914.00	0.01
245	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.01
246	688299	长阳科技	6,527	109,066.17	0.01
247	600826	兰生股份	12,400	108,996.00	0.01
248	605376	博迁新材	400	108,520.00	0.01
249	600929	雪天盐业	23,900	108,506.00	0.01
250	300479	神思电子	8,000	108,320.00	0.01
251	603000	人民网	7,300	107,967.00	0.01
252	300787	海能实业	11,800	107,616.00	0.01
253	603444	吉比特	300	107,526.00	0.01
254	688152	麒麟信安	3,911	107,474.28	0.01
255	301190	善水科技	6,700	107,401.00	0.01
256	603379	三美股份	1,400	106,246.00	0.01
257	301122	采纳股份	3,600	105,876.00	0.01
258	001298	好上好	5,100	105,825.00	0.01
259	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.01
260	603173	福斯达	3,100	105,090.00	0.01
261	002908	德生科技	16,600	105,078.00	0.01
262	600871	石化油服	51,500	104,545.00	0.01
263	688120	华海清科	324	104,386.32	0.01
264	688268	华特气体	389	104,057.50	0.01
265	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.01
266	601700	风范股份	23,800	103,768.00	0.01
267	002722	物产金轮	8,800	103,752.00	0.01
268	600584	长电科技	1,000	103,550.00	0.01
269	300579	数字认证	5,000	103,500.00	0.01
270	300963	中洲特材	7,700	103,411.00	0.01
271	688627	精智达	144	102,960.00	0.01
272	002724	海洋王	21,200	102,820.00	0.01
273	300389	艾比森	8,000	102,560.00	0.01
274	605116	奥锐特	5,400	102,168.00	0.01
275	002414	高德红外	7,700	102,102.00	0.01
276	002813	路畅科技	5,400	102,060.00	0.01
277	601166	兴业银行	6,100	101,016.00	0.01
278	603703	盛洋科技	9,100	101,010.00	0.01
279	688259	创耀科技	2,581	100,968.72	0.01
280	688768	容知日新	1,955	100,760.70	0.01
281	603061	金海通	200	100,444.00	0.01
282	601877	正泰电器	4,000	100,280.00	0.01
283	301256	华融化学	7,700	99,792.00	0.01
284	002532	天山铝业	9,300	99,789.00	0.01

285	002369	卓翼科技	18,300	99,369.00	0.01
286	601066	中信建投	3,400	98,838.00	0.01
287	300543	朗科智能	13,600	98,056.00	0.01
288	600129	太极集团	7,200	97,704.00	0.01
289	688361	中科飞测	227	97,610.00	0.01
290	600860	京城股份	11,800	97,232.00	0.01
291	002467	二六三	20,800	97,136.00	0.01
292	002636	金安国纪	800	95,976.00	0.01
293	002415	海康威视	2,800	95,760.00	0.01
294	600160	巨化股份	1,800	95,418.00	0.01
295	688589	力合微	4,137	95,068.26	0.01
296	301559	中集环科	7,700	93,863.00	0.01
297	300355	蒙草生态	34,100	93,775.00	0.01
298	300969	恒帅股份	1,000	93,760.00	0.01
299	300059	东方财富	4,600	93,748.00	0.01
300	300489	光智科技	300	93,585.00	0.01
301	002074	国轩高科	3,400	93,534.00	0.01
302	300904	威力传动	2,300	93,357.00	0.01
303	688390	固德威	857	92,993.07	0.01
304	688521	芯原股份	248	92,042.72	0.01
305	002111	威海广泰	10,200	91,800.00	0.01
306	002052	同洲电子	11,800	91,686.00	0.01
307	000776	广发证券	3,900	91,260.00	0.01
308	000423	东阿阿胶	2,000	90,720.00	0.01
309	300551	古鳌科技	9,000	88,560.00	0.01
310	301165	锐捷网络	1,100	88,495.00	0.01
311	600276	恒瑞医药	1,700	88,468.00	0.01
312	600792	云煤能源	27,900	88,443.00	0.01
313	301285	鸿日达	800	88,264.00	0.01
314	002593	日上集团	22,100	88,179.00	0.01
315	688017	绿的谐波	211	88,168.46	0.01
316	688651	盛邦安全	2,734	88,089.48	0.01
317	300048	合康新能	18,800	87,796.00	0.01
318	688157	松井股份	3,322	87,667.58	0.01
319	601360	三六零	10,000	86,900.00	0.01
320	600312	平高电气	4,900	86,534.00	0.01
321	300257	开山股份	3,000	86,040.00	0.01
322	300541	先进数通	8,900	85,885.00	0.01
323	603382	海阳科技	5,000	85,750.00	0.01
324	002879	长缆科技	6,500	85,345.00	0.01
325	688162	巨一科技	3,607	85,269.48	0.01
326	688279	峰昭科技	379	85,062.76	0.01
327	605117	德业股份	800	84,944.00	0.01

328	688392	骄成超声	373	84,738.14	0.01
329	300724	捷佳伟创	1,200	84,720.00	0.01
330	002537	海联金汇	16,000	84,640.00	0.01
331	688200	华峰测控	161	84,541.10	0.01
332	301186	超达装备	2,060	84,460.00	0.01
333	300484	蓝海华腾	6,500	84,175.00	0.01
334	300032	金龙机电	22,100	83,980.00	0.01
335	603659	璞泰来	2,900	83,897.00	0.01
336	301086	鸿富瀚	400	83,712.00	0.01
337	002462	嘉事堂	7,800	83,694.00	0.01
338	300230	永利股份	19,900	83,580.00	0.01
339	600875	东方电气	2,900	83,433.00	0.01
340	002996	顺博合金	14,100	83,190.00	0.01
341	301217	铜冠铜箔	500	82,535.00	0.01
342	688195	腾景科技	427	82,231.66	0.01
343	000561	烽火电子	11,100	82,140.00	0.01
344	601939	建设银行	8,500	81,855.00	0.01
345	002988	豪美新材	3,700	81,622.00	0.01
346	600426	华鲁恒升	3,400	81,328.00	0.01
347	300903	科翔股份	800	81,048.00	0.01
348	300092	科新机电	7,000	80,780.00	0.01
349	300507	苏奥传感	10,700	80,571.00	0.01
350	301220	亚香股份	2,500	80,550.00	0.01
351	002819	东方中科	3,600	80,460.00	0.01
352	301613	新铝时代	2,200	80,146.00	0.01
353	600971	恒源煤电	11,600	80,040.00	0.01
354	002221	东华能源	15,200	79,952.00	0.01
355	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.01
356	688215	瑞晟智能	1,977	79,396.32	0.01
357	688529	豪森智能	5,041	79,294.93	0.01
358	605088	冠盛股份	2,800	78,904.00	0.01
359	301152	天力锂能	3,300	78,111.00	0.01
360	600846	同济科技	7,800	78,000.00	0.01
361	300457	赢合科技	3,700	77,996.00	0.01
362	688023	安恒信息	2,113	77,589.36	0.01
363	688016	心脉医疗	875	77,560.00	0.01
364	603577	汇金通	8,200	77,244.00	0.01
365	301616	浙江华业	2,300	77,096.00	0.01
366	605080	浙江自然	4,000	77,040.00	0.01
367	000923	河钢资源	6,200	76,942.00	0.01
368	605286	同力天启	3,000	76,470.00	0.01
369	688233	神工股份	356	76,333.52	0.01
370	301518	长华化学	2,900	75,980.00	0.01

371	002578	闽发铝业	24,100	75,915.00	0.01
372	300409	道氏技术	3,800	75,734.00	0.01
373	300620	光库科技	200	75,640.00	0.01
374	300937	药易购	3,900	75,231.00	0.01
375	001236	弘业期货	10,800	75,060.00	0.01
376	603097	江苏华辰	2,800	75,012.00	0.01
377	688776	国光电气	1,216	74,589.44	0.01
378	000858	五 粮 液	1,000	74,000.00	0.01
379	002271	东方雨虹	6,200	73,594.00	0.01
380	002422	科伦药业	1,900	73,188.00	0.01
381	300515	三德科技	5,600	73,080.00	0.01
382	002428	云南锗业	600	72,108.00	0.01
383	600483	福能股份	7,000	71,330.00	0.01
384	603018	华设集团	13,800	70,932.00	0.01
385	002339	积成电子	10,200	70,686.00	0.01
386	688080	映翰通	1,633	70,627.25	0.01
387	600884	杉杉股份	5,200	70,460.00	0.01
388	301308	江波龙	100	70,380.00	0.01
389	688368	晶丰明源	325	70,369.00	0.01
390	300134	大富科技	8,200	70,110.00	0.01
391	301018	申菱环境	600	69,366.00	0.01
392	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.01
393	603266	天龙股份	4,100	69,003.00	0.01
394	600499	科达制造	5,000	69,000.00	0.01
395	688244	永信至诚	4,834	68,932.84	0.01
396	300856	科思股份	6,400	68,224.00	0.01
397	300857	协创数据	200	67,980.00	0.01
398	688332	中科蓝讯	431	67,882.50	0.01
399	600938	中国海油	2,500	67,875.00	0.01
400	688123	聚辰股份	319	67,819.40	0.01
401	603186	华正新材	300	67,590.00	0.01
402	002315	焦点科技	2,900	67,512.00	0.01
403	600980	北矿科技	3,600	67,500.00	0.01
404	600808	马钢股份	26,800	67,000.00	0.01
405	301205	联特科技	200	66,820.00	0.01
406	603072	天和磁材	1,700	66,640.00	0.01
407	600438	通威股份	5,500	66,605.00	0.01
408	603988	中电电机	4,100	66,502.00	0.01
409	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.01
410	603556	海兴电力	3,000	66,000.00	0.01
411	605208	永茂泰	4,100	65,395.00	0.01
412	301315	威士顿	1,700	64,906.00	0.01
413	301383	天键股份	2,700	64,530.00	0.01

414	688531	日联科技	362	64,378.08	0.01
415	688127	蓝特光学	657	64,123.20	0.01
416	688382	益方生物	3,542	63,756.00	0.01
417	002835	同为股份	5,500	63,085.00	0.01
418	000975	山金国际	3,700	62,900.00	0.01
419	688503	聚和材料	470	62,369.00	0.01
420	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.01
421	688372	伟测科技	332	61,752.00	0.01
422	301551	无线传媒	3,100	61,163.00	0.01
423	300678	中科信息	2,700	60,480.00	0.01
424	000576	甘化科工	9,200	60,444.00	0.01
425	688439	振华风光	1,308	60,429.60	0.01
426	688557	兰剑智能	1,947	60,415.41	0.01
427	301187	欧圣电气	4,200	60,102.00	0.01
428	000096	广聚能源	8,600	59,942.00	0.01
429	002358	森源电气	10,800	59,940.00	0.01
430	600501	航天晨光	3,800	59,774.00	0.01
431	301263	泰恩康	2,900	59,421.00	0.01
432	000009	中国宝安	9,500	59,185.00	0.01
433	000852	石化机械	11,900	59,024.00	0.01
434	600348	华阳股份	7,700	58,905.00	0.01
435	301062	上海艾录	10,300	58,813.00	0.01
436	600629	华建集团	4,800	58,128.00	0.01
437	688535	华海诚科	309	57,783.00	0.01
438	603885	吉祥航空	5,600	57,624.00	0.01
439	300360	炬华科技	4,900	57,575.00	0.01
440	688223	晶科能源	12,046	57,218.50	0.01
441	688652	京仪装备	285	57,048.45	0.01
442	600746	江苏索普	10,900	57,007.00	0.01
443	300523	辰安科技	3,100	56,978.00	0.01
444	300647	超频三	9,500	56,525.00	0.01
445	603279	景津装备	4,700	56,400.00	0.01
446	688800	瑞可达	587	56,334.39	0.01
447	300050	世纪鼎利	9,500	56,240.00	0.01
448	601872	招商轮船	3,200	56,224.00	0.01
449	300806	斯迪克	500	56,000.00	0.01
450	600900	长江电力	2,100	55,587.00	0.01
451	688003	天准科技	435	55,375.50	0.01
452	300229	拓尔思	4,000	55,280.00	0.01
453	688333	铂力特	537	54,988.80	0.01
454	300107	建新股份	9,800	54,880.00	0.01
455	002859	洁美科技	500	54,755.00	0.01
456	002094	青岛金王	12,500	54,750.00	0.01

457	603369	今世缘	2,300	54,533.00	0.01
458	301129	瑞纳智能	2,600	54,262.00	0.01
459	003031	中瓷电子	300	54,090.00	0.01
460	000655	金岭矿业	8,500	54,060.00	0.01
461	603629	利通电子	300	53,643.00	0.01
462	688601	力芯微	879	53,223.45	0.01
463	600428	中远海特	6,800	53,108.00	0.01
464	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.01
465	301215	中汽股份	10,200	52,938.00	0.01
466	688289	圣湘生物	3,676	52,934.40	0.01
467	603063	禾望电气	1,000	52,890.00	0.01
468	301216	万凯新材	2,300	52,877.00	0.01
469	688001	华兴源创	616	52,791.20	0.01
470	300236	上海新阳	400	52,600.00	0.01
471	688636	智明达	1,449	52,497.27	0.01
472	603301	振德医疗	600	52,296.00	0.01
473	002487	大金重工	900	52,173.00	0.01
474	600032	浙江新能	7,400	52,170.00	0.01
475	600329	达仁堂	1,400	52,108.00	0.01
476	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.01
477	301439	泓淋电力	3,300	51,876.00	0.01
478	603306	华懋科技	500	51,845.00	0.01
479	000701	厦门信达	11,700	51,831.00	0.01
480	000559	万向钱潮	4,000	51,720.00	0.01
481	000049	德赛电池	2,200	51,414.00	0.01
482	688545	兴福电子	386	51,361.16	0.01
483	300012	华测检测	3,700	51,282.00	0.01
484	688700	东威科技	572	51,136.80	0.01
485	300272	开能健康	9,700	51,022.00	0.01
486	301073	君亭酒店	2,800	50,960.00	0.01
487	600259	中稀有色	500	50,805.00	0.01
488	603950	长源东谷	600	50,658.00	0.01
489	300260	新莱应材	500	50,230.00	0.01
490	301558	三态股份	8,100	49,977.00	0.01
491	300223	北京君正	200	49,780.00	0.01
492	688046	药康生物	2,044	49,464.80	0.01
493	600726	华电能源	6,900	49,128.00	0.01
494	002847	盐津铺子	1,100	49,060.00	0.01
495	688400	凌云光	741	49,054.20	0.01
496	603115	海星股份	400	48,988.00	0.01
497	000523	红棉股份	18,900	48,762.00	0.01
498	600751	海航科技	16,700	48,597.00	0.01
499	301109	军信股份	3,900	48,594.00	0.01

500	603283	赛腾股份	600	48,588.00	0.01
501	300036	超图软件	4,300	48,461.00	0.01
502	603663	三祥新材	500	48,150.00	0.01
503	603345	安井食品	600	48,114.00	0.01
504	301266	宇邦新材	2,100	47,964.00	0.01
505	300811	铂科新材	500	47,445.00	0.01
506	301221	光庭信息	1,600	47,216.00	0.01
507	300373	扬杰科技	300	47,169.00	0.01
508	600179	安通控股	10,700	47,080.00	0.01
509	300843	胜蓝股份	300	46,875.00	0.01
510	301556	托普云农	800	46,768.00	0.01
511	301262	海看股份	2,600	46,722.00	0.01
512	688577	浙海德曼	1,019	46,700.77	0.01
513	600206	有研新材	700	46,620.00	0.01
514	688449	联芸科技	538	46,434.78	0.01
515	688097	博众精工	736	46,404.80	0.01
516	301036	双乐股份	2,100	46,053.00	0.01
517	603667	五洲新春	700	45,864.00	0.01
518	688362	甬矽电子	475	45,790.00	0.01
519	301398	星源卓镁	1,300	45,643.00	0.01
520	000962	东方钨业	500	45,300.00	0.01
521	002562	兄弟科技	10,400	45,240.00	0.01
522	002008	大族激光	300	45,033.00	0.01
523	301136	招标股份	4,100	45,018.00	0.01
524	300011	鼎汉技术	7,400	44,992.00	0.01
525	301229	纽泰格	3,700	44,844.00	0.01
526	002476	新叶股份	9,200	44,712.00	0.01
527	688048	长光华芯	89	44,678.00	0.01
528	301052	果麦文化	2,000	44,440.00	0.01
529	002772	众兴菌业	3,900	44,304.00	0.01
530	688380	中微半导	671	44,225.61	0.01
531	002046	国机精工	600	44,190.00	0.01
532	688548	广钢气体	848	44,180.80	0.01
533	301508	中机认检	1,900	43,966.00	0.01
534	002616	长青集团	9,800	43,806.00	0.01
535	300587	天铁科技	11,300	43,505.00	0.01
536	301389	隆扬电子	500	43,395.00	0.01
537	300398	飞凯材料	700	43,225.00	0.01
538	002149	西部材料	800	43,208.00	0.01
539	000883	湖北能源	10,000	43,200.00	0.01
540	300299	富春股份	8,800	43,120.00	0.01
540	300348	长亮科技	4,900	43,120.00	0.01
541	002364	中恒电气	800	43,040.00	0.01

542	603938	三孚股份	600	42,990.00	0.01
543	002682	龙洲股份	10,100	42,824.00	0.01
544	002552	宝鼎科技	700	42,700.00	0.01
545	300926	博俊科技	2,400	42,600.00	0.01
546	688777	中控技术	362	42,535.00	0.01
547	688388	嘉元科技	966	42,504.00	0.01
548	300747	锐科激光	800	42,472.00	0.01
549	300474	景嘉微	700	42,336.00	0.01
550	603219	富佳股份	2,700	42,066.00	0.01
551	603738	泰晶科技	700	42,035.00	0.01
552	002484	江海股份	400	42,000.00	0.01
553	600104	上汽集团	4,300	41,968.00	0.01
554	301141	中科磁业	1,000	41,860.00	0.01
555	300035	中科电气	2,900	41,818.00	0.01
556	603979	金诚信	700	41,321.00	0.01
557	300285	国瓷材料	400	41,272.00	0.01
558	002961	瑞达期货	2,100	41,118.00	0.01
559	688190	云路股份	453	41,091.63	0.01
560	003005	竞业达	3,100	41,044.00	0.01
561	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.01
562	002155	湖南黄金	1,700	40,579.00	0.01
563	001367	海森药业	2,200	40,546.00	0.01
564	600218	全柴动力	5,600	40,432.00	0.01
565	300953	震裕科技	300	40,110.00	0.01
566	688007	光峰科技	3,003	39,939.90	0.00
567	603618	杭电股份	800	39,904.00	0.00
568	300075	数字政通	3,900	39,858.00	0.00
569	300941	创识科技	2,900	39,817.00	0.00
570	688150	莱特光电	580	39,799.60	0.00
571	688234	天岳先进	227	39,386.77	0.00
572	300919	中伟新材	900	39,375.00	0.00
573	000811	冰轮环境	700	39,354.00	0.00
574	603489	八方股份	1,400	39,144.00	0.00
575	301153	中科江南	2,400	39,096.00	0.00
576	002337	赛象科技	8,800	38,984.00	0.00
577	000983	山西焦煤	6,700	38,860.00	0.00
578	600361	创新新材	10,700	38,520.00	0.00
579	600273	嘉化能源	5,900	38,468.00	0.00
580	603203	快克智能	500	38,390.00	0.00
581	688403	汇成股份	967	38,389.90	0.00
582	002957	科瑞技术	700	38,388.00	0.00
583	000065	北方国际	3,900	38,337.00	0.00
584	300456	赛微电子	900	38,223.00	0.00

585	300987	川网传媒	3,100	38,130.00	0.00
586	300698	万马科技	1,400	38,080.00	0.00
587	601126	四方股份	600	37,920.00	0.00
588	600114	东睦股份	1,000	37,760.00	0.00
589	002536	飞龙股份	800	37,744.00	0.00
590	001267	汇绿生态	700	37,450.00	0.00
590	301003	江苏博云	700	37,450.00	0.00
591	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.00
592	600498	烽火通信	500	36,800.00	0.00
593	688308	欧科亿	202	36,725.62	0.00
594	600354	敦煌种业	7,700	36,652.00	0.00
595	300762	上海瀚讯	800	36,520.00	0.00
596	600353	旭光电子	800	36,480.00	0.00
597	601969	海南矿业	4,600	36,386.00	0.00
598	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.00
599	000636	风华高科	500	36,120.00	0.00
600	603933	睿能科技	1,600	36,080.00	0.00
601	002983	芯瑞达	1,300	35,984.00	0.00
602	301631	壹连科技	500	35,930.00	0.00
603	002166	莱茵生物	5,700	35,796.00	0.00
604	300136	信维通信	300	35,775.00	0.00
605	688432	有研硅	883	35,293.51	0.00
606	000565	渝三峡 A	6,200	35,216.00	0.00
607	000570	苏常柴 A	7,500	35,025.00	0.00
608	300085	银之杰	1,000	34,970.00	0.00
609	601595	上海电影	2,100	34,860.00	0.00
610	301318	维海德	1,700	34,680.00	0.00
611	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.00
612	600989	宝丰能源	1,700	34,561.00	0.00
613	002123	梦网科技	4,800	34,512.00	0.00
614	603127	昭衍新药	900	34,398.00	0.00
615	600490	鹏欣资源	5,900	34,338.00	0.00
616	000797	中国武夷	15,500	33,945.00	0.00
617	600559	老白干酒	3,000	33,600.00	0.00
618	688091	上海谊众	833	33,486.60	0.00
619	600869	远东股份	1,000	33,470.00	0.00
620	000526	学大教育	1,300	32,994.00	0.00
621	601688	华泰证券	1,600	32,992.00	0.00
622	001203	大中矿业	1,100	32,945.00	0.00
623	688301	奕瑞科技	264	32,736.00	0.00
624	300319	麦捷科技	1,100	32,593.00	0.00
625	600552	凯盛科技	1,000	32,580.00	0.00
626	000822	山东海化	8,100	32,562.00	0.00

627	002491	通鼎互联	1,000	32,400.00	0.00
628	600961	株冶集团	1,000	32,390.00	0.00
629	300712	永福股份	1,500	32,115.00	0.00
630	000969	安泰科技	1,300	31,902.00	0.00
631	301258	富士莱	1,400	31,878.00	0.00
632	300976	达瑞电子	400	31,860.00	0.00
633	300697	电工合金	2,100	31,815.00	0.00
634	002245	蔚蓝锂芯	1,700	31,807.00	0.00
635	300054	鼎龙股份	300	31,791.00	0.00
636	603002	宏昌电子	1,300	31,421.00	0.00
637	002984	森麒麟	2,400	31,368.00	0.00
638	601963	重庆银行	3,100	31,248.00	0.00
639	603876	鼎胜新材	1,200	31,212.00	0.00
640	002182	宝武镁业	2,000	31,140.00	0.00
641	002103	广博股份	5,300	31,111.00	0.00
642	300049	福瑞医科	800	31,104.00	0.00
643	001328	登康口腔	1,200	31,092.00	0.00
644	600330	天通股份	1,000	30,840.00	0.00
645	688077	大地熊	1,160	30,728.40	0.00
646	002212	天融信	5,100	30,498.00	0.00
647	300805	电声股份	4,200	30,450.00	0.00
648	001277	速达股份	1,100	30,349.00	0.00
649	301026	浩通科技	1,500	30,330.00	0.00
650	300337	银邦股份	2,600	30,316.00	0.00
651	002882	金龙羽	1,600	30,224.00	0.00
652	688220	翱捷科技	242	30,085.44	0.00
653	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.00
654	600728	佳都科技	7,000	29,820.00	0.00
655	688567	孚能科技	2,807	29,473.50	0.00
656	688269	凯立新材	918	29,109.78	0.00
657	603075	热威股份	1,300	29,068.00	0.00
658	001311	多利科技	1,800	29,034.00	0.00
659	300079	数码视讯	6,900	28,980.00	0.00
660	301327	华宝新能	600	28,842.00	0.00
661	603588	高能环境	1,500	28,800.00	0.00
662	300821	东岳硅材	1,400	28,784.00	0.00
663	002557	洽洽食品	1,600	28,736.00	0.00
664	300775	三角防务	1,300	28,652.00	0.00
665	300323	华灿光电	1,400	28,560.00	0.00
666	600477	杭萧钢构	12,300	28,413.00	0.00
667	002117	东港股份	3,600	28,368.00	0.00
668	301279	金道科技	1,300	28,249.00	0.00
669	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.00

670	000400	许继电气	1,300	28,210.00	0.00
671	603062	麦加芯彩	700	28,105.00	0.00
672	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.00
673	300827	上能电气	900	27,711.00	0.00
674	688088	虹软科技	779	27,693.45	0.00
675	002991	甘源食品	700	27,657.00	0.00
676	300824	北鼎股份	3,800	27,284.00	0.00
677	605319	无锡振华	1,200	27,228.00	0.00
678	688266	泽璟制药	233	27,181.78	0.00
679	688172	燕东微	324	27,105.84	0.00
680	300231	银信科技	3,400	27,030.00	0.00
681	600657	信达地产	11,700	27,027.00	0.00
682	600888	新疆众和	1,700	27,013.00	0.00
683	600186	莲花控股	1,900	26,600.00	0.00
684	001896	豫能控股	1,600	26,576.00	0.00
685	300124	汇川技术	400	26,532.00	0.00
686	600037	歌华有线	4,200	26,334.00	0.00
687	600621	华鑫股份	2,000	25,840.00	0.00
688	002161	远望谷	4,800	25,824.00	0.00
689	002978	安宁股份	1,000	25,630.00	0.00
690	600596	新安股份	1,600	25,536.00	0.00
691	600724	宁波富达	5,000	25,350.00	0.00
692	603325	博隆技术	500	25,310.00	0.00
693	301295	美硕科技	600	25,308.00	0.00
694	603040	新坐标	400	25,228.00	0.00
695	000766	通化金马	1,300	25,220.00	0.00
696	300832	新产业	600	25,200.00	0.00
697	002614	奥佳华	5,700	25,194.00	0.00
698	300817	双飞集团	1,600	24,960.00	0.00
699	600598	北大荒	2,300	24,932.00	0.00
700	003038	鑫铂股份	2,200	24,882.00	0.00
701	600919	江苏银行	2,300	24,794.00	0.00
702	603730	岱美股份	2,200	24,574.00	0.00
703	002649	博彦科技	3,000	24,420.00	0.00
704	301199	迈赫股份	1,400	24,416.00	0.00
705	002292	奥飞娱乐	3,700	24,272.00	0.00
706	600638	新黄浦	5,500	24,035.00	0.00
707	003020	立方制药	1,600	23,696.00	0.00
708	301371	敷尔佳	900	23,400.00	0.00
709	301345	涛涛车业	100	23,100.00	0.00
710	600226	亨通股份	2,400	23,016.00	0.00
711	300180	华峰超纤	5,800	22,852.00	0.00
712	301535	浙江华远	1,700	22,814.00	0.00

713	002498	汉缆股份	3,300	22,506.00	0.00
714	001207	联科科技	1,500	22,380.00	0.00
715	300402	宝色股份	1,500	22,215.00	0.00
716	002801	微光股份	800	22,080.00	0.00
717	600756	浪潮软件	1,800	22,032.00	0.00
718	600864	哈投股份	4,200	21,798.00	0.00
719	600399	抚顺特钢	5,300	21,783.00	0.00
720	603258	电魂网络	1,800	21,582.00	0.00
721	688257	新锐股份	211	21,500.90	0.00
722	300962	中金辐照	1,700	21,250.00	0.00
723	002276	万马股份	2,100	21,231.00	0.00
724	300689	澄天伟业	300	21,054.00	0.00
725	002343	慈文传媒	4,800	20,928.00	0.00
726	300238	冠昊生物	1,800	20,880.00	0.00
727	600885	宏发股份	600	20,694.00	0.00
728	002864	盘龙药业	800	20,640.00	0.00
729	600449	宁夏建材	1,800	20,124.00	0.00
730	001390	古麒绒材	1,000	20,110.00	0.00
731	603787	新日股份	2,200	19,998.00	0.00
732	601919	中远海控	1,500	19,890.00	0.00
733	002797	第一创业	3,000	19,710.00	0.00
734	603366	日出东方	2,700	19,629.00	0.00
735	002692	远程股份	5,200	19,604.00	0.00
736	300677	英科医疗	500	19,585.00	0.00
737	600577	精达股份	2,000	19,560.00	0.00
738	002783	凯龙股份	2,700	19,197.00	0.00
739	601121	宝地矿业	3,400	19,176.00	0.00
740	600215	派斯林	3,300	19,140.00	0.00
741	000058	深赛格	3,100	19,034.00	0.00
742	603999	读者传媒	3,800	19,000.00	0.00
743	000672	上峰材料	800	18,944.00	0.00
744	002373	千方科技	2,600	18,668.00	0.00
745	300350	华鹏飞	4,700	18,659.00	0.00
746	600508	上海能源	2,500	18,425.00	0.00
747	001337	四川黄金	500	18,330.00	0.00
748	000935	四川双马	700	18,263.00	0.00
749	688255	凯尔达	649	18,042.20	0.00
750	688093	世华科技	482	17,785.80	0.00
751	000758	中色股份	2,700	17,739.00	0.00
752	600208	衢州发展	6,200	17,546.00	0.00
753	300250	初灵信息	1,200	17,496.00	0.00
754	301015	百洋医药	900	17,154.00	0.00
755	300215	电科院	2,500	16,475.00	0.00

756	002065	东华软件	2,300	16,422.00	0.00
757	300357	我武生物	700	16,324.00	0.00
758	300062	中能电气	2,900	16,269.00	0.00
759	002468	申通快递	1,100	16,016.00	0.00
760	600135	乐凯胶片	2,000	15,980.00	0.00
761	601908	京运通	5,100	15,963.00	0.00
762	600661	昂立教育	2,300	15,893.00	0.00
763	300601	康泰生物	1,400	15,876.00	0.00
764	301589	诺瓦星云	100	14,898.00	0.00
765	688319	欧林生物	320	14,073.60	0.00
766	002540	亚太科技	3,000	14,010.00	0.00
767	301502	华阳智能	200	13,904.00	0.00
768	600708	光明地产	4,200	13,482.00	0.00
769	300722	新余国科	600	13,380.00	0.00
770	301226	祥明智能	400	13,276.00	0.00
771	603918	金桥信息	1,400	13,272.00	0.00
772	002825	纳尔股份	1,600	13,152.00	0.00
773	301311	昆船智能	1,000	12,990.00	0.00
774	002274	华昌化工	2,800	12,964.00	0.00
775	300847	中船汉光	1,000	12,940.00	0.00
776	603917	合力科技	1,100	12,914.00	0.00
777	300643	万通智控	700	12,523.00	0.00
778	301157	华塑科技	200	12,496.00	0.00
779	605166	聚合顺	1,300	12,467.00	0.00
780	300365	恒华科技	2,700	12,366.00	0.00
781	300956	英力股份	1,100	12,364.00	0.00
782	603528	多伦科技	2,100	12,306.00	0.00
783	301119	正强股份	500	12,270.00	0.00
784	600643	爱建集团	3,300	12,243.00	0.00
785	300188	国投智能	1,300	12,155.00	0.00
786	603305	旭升集团	1,000	12,120.00	0.00
787	000812	陕西金叶	3,900	12,090.00	0.00
788	600392	盛和资源	400	11,908.00	0.00
789	300746	汉嘉数智	1,100	11,891.00	0.00
790	001326	联域股份	200	11,858.00	0.00
791	001225	和泰机电	300	11,853.00	0.00
792	000554	泰山石油	2,100	11,781.00	0.00
793	002097	山河智能	1,600	11,568.00	0.00
794	300723	一品红	300	11,184.00	0.00
795	301446	福事特	300	11,010.00	0.00
796	601995	中金公司	300	10,845.00	0.00
797	605136	丽人丽妆	1,500	10,695.00	0.00
798	605298	必得科技	200	10,390.00	0.00

799	600763	通策医疗	300	10,164.00	0.00
800	603486	科沃斯	200	10,150.00	0.00
801	002398	垒知集团	2,700	10,125.00	0.00
802	605068	明新旭腾	600	10,068.00	0.00
803	301333	诺思格	200	10,018.00	0.00
804	601985	中国核电	1,100	9,933.00	0.00
805	601991	大唐发电	1,400	9,912.00	0.00
806	002925	盈趣科技	400	9,864.00	0.00
807	688188	柏楚电子	91	9,709.70	0.00
808	600109	国金证券	1,100	9,658.00	0.00
809	603920	世运电路	200	9,608.00	0.00
810	688114	华大智造	188	9,603.04	0.00
811	600475	华光环能	600	9,150.00	0.00
812	301257	普蕊斯	200	9,076.00	0.00
813	688283	坤恒顺维	274	9,072.14	0.00
814	603117	万林物流	2,700	9,045.00	0.00
815	603833	欧派家居	300	9,033.00	0.00
816	600773	西藏城投	700	9,009.00	0.00
817	601328	交通银行	1,400	9,002.00	0.00
818	688568	中科星图	216	8,957.52	0.00
819	301299	卓创资讯	200	8,812.00	0.00
820	002905	金逸影视	1,300	8,775.00	0.00
821	688013	天臣医疗	355	8,757.85	0.00
822	300875	捷强装备	300	8,571.00	0.00
823	000779	甘咨询	1,100	8,569.00	0.00
824	688588	凌志软件	941	8,553.69	0.00
825	300930	屹通新材	300	8,550.00	0.00
826	603322	超讯科技	300	8,514.00	0.00
827	002224	三力士	2,600	8,502.00	0.00
828	301255	通力科技	400	8,476.00	0.00
829	600613	神奇制药	1,900	8,436.00	0.00
830	301016	雷尔伟	600	8,382.00	0.00
831	301503	智迪科技	300	8,253.00	0.00
832	603172	万丰股份	500	8,215.00	0.00
833	605388	均瑶健康	1,700	8,211.00	0.00
834	603585	苏利股份	600	8,202.00	0.00
835	600469	风神股份	1,500	8,160.00	0.00
836	002454	松芝股份	1,700	8,126.00	0.00
837	603181	皇马科技	500	8,110.00	0.00
838	002248	华东数控	900	8,100.00	0.00
839	300532	今天国际	1,300	8,099.00	0.00
839	603052	可川科技	100	8,099.00	0.00
840	300253	卫宁健康	1,200	8,076.00	0.00

841	000505	京粮控股	1,600	8,048.00	0.00
842	002523	天桥起重	2,700	8,046.00	0.00
843	300432	富临精工	400	8,036.00	0.00
844	603168	莎普爱思	1,700	8,024.00	0.00
845	002551	尚荣医疗	3,000	8,010.00	0.00
845	003029	吉大正元	500	8,010.00	0.00
845	600249	两面针	1,800	8,010.00	0.00
846	000607	华媒控股	2,600	7,982.00	0.00
847	300384	三联虹普	700	7,980.00	0.00
847	600216	浙江医药	700	7,980.00	0.00
848	688196	卓越新能	222	7,969.80	0.00
849	300886	华业香料	400	7,960.00	0.00
850	002330	得利斯	2,300	7,958.00	0.00
851	002340	格林美	1,200	7,932.00	0.00
852	601009	南京银行	800	7,912.00	0.00
853	301356	天振股份	300	7,881.00	0.00
854	301335	天元宠物	400	7,852.00	0.00
855	600116	三峡水利	1,400	7,840.00	0.00
856	300534	陇神戎发	1,100	7,788.00	0.00
857	603086	先达股份	1,500	7,785.00	0.00
858	600000	浦发银行	900	7,749.00	0.00
859	300171	东富龙	700	7,742.00	0.00
860	603300	海南华铁	1,700	7,735.00	0.00
861	600495	晋西车轴	2,200	7,722.00	0.00
862	603051	鹿山新材	400	7,712.00	0.00
863	603381	永臻股份	500	7,705.00	0.00
864	603151	邦基科技	700	7,693.00	0.00
865	600197	伊力特	800	7,680.00	0.00
866	001296	长江材料	400	7,668.00	0.00
866	603630	拉芳家化	600	7,668.00	0.00
867	002599	盛通股份	1,500	7,650.00	0.00
868	000707	双环科技	1,800	7,596.00	0.00
868	300207	欣旺达	400	7,596.00	0.00
869	000816	智慧农业	3,300	7,590.00	0.00
870	003035	南网能源	1,300	7,566.00	0.00
871	300818	耐普矿机	400	7,560.00	0.00
872	600100	同方股份	1,100	7,535.00	0.00
873	603919	金徽酒	500	7,525.00	0.00
874	688608	恒玄科技	45	7,523.55	0.00
875	300512	中亚股份	1,100	7,502.00	0.00
875	601616	广电电气	2,200	7,502.00	0.00
876	002037	保利联合	1,200	7,488.00	0.00
877	600637	东方明珠	900	7,479.00	0.00

878	300493	润欣科技	500	7,455.00	0.00
879	603596	伯特利	300	7,452.00	0.00
880	003040	楚天龙	700	7,434.00	0.00
881	601956	东贝集团	1,600	7,392.00	0.00
882	002363	隆基机械	1,200	7,224.00	0.00
883	601020	华钰矿业	300	7,197.00	0.00
884	002416	爱施德	800	7,168.00	0.00
885	688339	亿华通	382	7,143.40	0.00
886	603926	铁流股份	400	7,076.00	0.00
887	301011	华立科技	500	7,070.00	0.00
888	300374	中铁装配	700	7,049.00	0.00
889	002829	星网宇达	400	7,024.00	0.00
890	301181	标榜股份	300	6,942.00	0.00
891	002841	视源股份	200	6,906.00	0.00
892	000688	国城矿业	200	6,846.00	0.00
893	603190	亚通精工	300	6,786.00	0.00
894	300788	中信出版	300	6,741.00	0.00
895	002945	华林证券	500	6,715.00	0.00
896	000807	云铝股份	300	6,642.00	0.00
897	001336	楚环科技	300	6,606.00	0.00
898	300612	宣亚国际	600	6,558.00	0.00
899	300363	博腾股份	400	6,496.00	0.00
900	301287	康力源	200	6,458.00	0.00
901	301170	锡南科技	300	6,453.00	0.00
902	300947	德必集团	500	6,375.00	0.00
903	600081	东风科技	700	6,356.00	0.00
904	300879	大叶股份	400	6,272.00	0.00
905	301459	丰茂股份	200	6,188.00	0.00
906	300553	集智股份	100	6,139.00	0.00
907	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.00
907	603308	应流股份	100	6,040.00	0.00
908	600684	珠江股份	2,000	6,020.00	0.00
909	301361	众智科技	200	6,006.00	0.00
910	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.00
911	002683	广东宏大	200	5,858.00	0.00
912	301499	维科精密	200	5,836.00	0.00
913	301391	卡莱特	100	5,710.00	0.00
914	001333	光华股份	300	5,481.00	0.00
915	301219	腾远钴业	100	5,480.00	0.00
916	603280	南方路机	200	4,960.00	0.00
917	301329	信音电子	200	4,858.00	0.00
918	603004	鼎龙科技	200	4,818.00	0.00
919	600299	安迪苏	600	4,710.00	0.00

920	301168	通灵股份	100	4,491.00	0.00
921	603928	兴业股份	300	4,440.00	0.00
922	001218	丽臣实业	200	4,412.00	0.00
923	301055	张小泉	100	4,247.00	0.00
924	301636	泽润新能	100	4,211.00	0.00
925	000551	创元科技	200	4,126.00	0.00
926	301386	未来电器	200	4,122.00	0.00
927	603223	恒通股份	300	3,915.00	0.00
928	301192	泰祥股份	200	3,780.00	0.00
929	301167	建研设计	300	3,717.00	0.00
930	600236	桂冠电力	400	3,512.00	0.00
931	000685	中山公用	300	3,348.00	0.00
932	301353	普莱得	200	3,322.00	0.00
933	002033	丽江股份	400	3,304.00	0.00
934	603125	常青科技	100	3,274.00	0.00
935	603038	华立股份	200	3,120.00	0.00
936	603132	金徽股份	200	3,116.00	0.00
937	002440	闰土股份	300	3,075.00	0.00
938	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.00
939	001286	陕西能源	300	3,042.00	0.00
940	000567	海德股份	500	2,985.00	0.00
941	603073	彩蝶实业	200	2,982.00	0.00
942	603066	音飞储存	300	2,928.00	0.00
943	002064	华峰化学	300	2,847.00	0.00
944	002946	新乳业	200	2,816.00	0.00
945	600323	瀚蓝环境	100	2,746.00	0.00
946	001256	炜冈科技	100	2,729.00	0.00
947	603162	海通发展	300	2,691.00	0.00
948	002606	大连电瓷	200	2,682.00	0.00
949	002128	电投能源	100	2,312.00	0.00
950	600356	恒丰纸业	300	2,223.00	0.00
951	000612	焦作万方	200	2,118.00	0.00
952	002956	西麦食品	100	2,076.00	0.00
953	001368	通达创智	100	2,057.00	0.00
954	600233	圆通速递	100	1,575.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	11,735,835.00	1.46
2	600426	华鲁恒升	6,776,700.00	0.85
3	02628	中国人寿	6,115,077.91	0.76
3	601628	中国人寿	459,554.00	0.06

4	605196	华通线缆	6,483,472.00	0.81
5	601138	工业富联	6,291,516.00	0.78
6	600549	厦门钨业	6,024,836.00	0.75
7	688002	睿创微纳	5,502,501.06	0.69
8	300476	胜宏科技	5,272,293.00	0.66
9	603067	振华股份	5,169,098.00	0.64
10	301358	湖南裕能	5,141,907.59	0.64
11	601899	紫金矿业	5,056,268.00	0.63
12	688256	寒武纪	4,888,713.63	0.61
13	600075	新疆天业	4,869,613.00	0.61
14	600309	万华化学	4,764,404.94	0.59
15	601872	招商轮船	4,754,958.00	0.59
16	600160	巨化股份	4,563,528.00	0.57
17	300502	新易盛	4,328,924.00	0.54
18	301338	凯格精机	4,327,211.68	0.54
19	002126	银轮股份	4,230,136.00	0.53
20	605117	德业股份	4,224,744.00	0.53

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	7,194,244.00	0.90
2	02628	中国人寿	6,701,646.54	0.84
2	601628	中国人寿	113,289.00	0.01
3	600426	华鲁恒升	6,595,594.00	0.82
4	000811	冰轮环境	6,165,299.00	0.77
5	600549	厦门钨业	5,691,862.00	0.71
6	300476	胜宏科技	5,663,288.00	0.71
7	600075	新疆天业	5,419,870.00	0.68
8	002126	银轮股份	5,046,838.91	0.63
9	603067	振华股份	5,035,108.00	0.63
10	301358	湖南裕能	5,030,166.00	0.63
11	002008	大族激光	4,970,068.00	0.62
12	600309	万华化学	4,920,147.00	0.61
13	000338	潍柴动力	4,913,205.00	0.61
14	300502	新易盛	4,817,588.00	0.60
15	601872	招商轮船	4,801,732.00	0.60
16	601899	紫金矿业	4,638,864.00	0.58
17	300835	龙磁科技	4,277,661.00	0.53
18	002371	北方华创	4,106,762.00	0.51
19	300137	先河环保	4,025,917.00	0.50
20	301338	凯格精机	3,934,545.40	0.49

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	656,003,757.41
卖出股票收入（成交）总额	546,376,853.93

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,530,372.61	15.28
	其中：政策性金融债	50,411,643.84	6.29
4	企业债券	161,580,854.25	20.15
5	企业短期融资券	10,067,654.79	1.26
6	中期票据	406,096,749.59	50.64
7	可转债（可交换债）	86,901.53	0.01
8	同业存单	99,996,681.73	12.47
9	其他	-	-
10	合计	800,359,214.50	99.81

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	112606076	26 交通银行 CD076	700,000	69,998,390.00	8.73
2	260401	26 农发 01	500,000	50,411,643.84	6.29
3	102680921	26 经开国控 MTN001	400,000	40,373,766.58	5.03
4	232400018	24 宁波银行二级资本债 01	300,000	30,782,260.27	3.84
5	102582768	25 日照港 MTN001	300,000	30,698,005.48	3.83

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

股指期货不属于本基金的投资范围, 故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 参与国债期货的交易。国债期货作为利率衍生品的一种, 有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定, 结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金按照基金合同约定开展基金投资。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中, 交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行(国家外汇管理局宁波市分局)的处罚。中泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行山东省分行(国家外汇管理局山东省分局、中国人民银行山东省分行营业管理部)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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	193,606.37
2	应收清算款	881,865.34
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,081,553.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,157,025.65

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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
中欧稳健添悦债券 A	1,368	527,977.93	9,943.08	0.00%	722,263,863.62	100.00%
中欧稳健添悦债券 C	464	145,285.69	0.00	0.00%	67,412,560.92	100.00%
合计	1,832	431,051.51	9,943.08	0.00%	789,676,424.54	100.00%

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	中欧稳健添悦债券 A	407,495.97	0.06%

理人所有从业人员持有本基金	中欧稳健添悦债券 C	0.00	0.00%
	合计	407,495.97	0.05%

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	中欧稳健添悦债券 A	0
	中欧稳健添悦债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧稳健添悦债券 A	0
	中欧稳健添悦债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧稳健添悦债券 A	中欧稳健添悦债券 C
基金合同生效日 （2026 年 1 月 23 日） 基金份额总额	1,965,948,921.62	194,388,643.81
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	71,702,521.94	4,469,868.52
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	1,315,377,636.86	131,445,951.41
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	722,273,806.70	67,412,560.92

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未投资基金。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
中金公司	1	333,241,188.69	27.78	145,261.44	27.71	本报告期新增 1 个
中信建投	1	258,619,648.97	21.56	112,734.69	21.50	本报告期新增 1 个
民生证券	2	124,264,664.71	10.36	54,162.65	10.33	本报告期新增 2 个
申万宏源证券	1	108,350,021.73	9.03	47,230.40	9.01	本报告期新增 1 个
国海证券	1	105,725,968.38	8.82	46,086.31	8.79	本报告期新增 1 个
浙商证券	1	86,164,397.88	7.18	37,877.02	7.22	本报告期新增 1 个
华福证券	1	62,345,140.30	5.20	27,179.15	5.18	本报告期新增 1 个
国都证券	2	57,342,682.43	4.78	25,263.62	4.82	本报告期新增 2 个
东方证券	1	49,146,433.22	4.10	21,421.12	4.09	本报告期新增 1 个
华创证券	2	14,173,857.63	1.18	7,086.93	1.35	本报告期新增 2 个
财通证券	1	—	—	—	—	本报告期新增

						1 个
长江证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 2 个
德邦证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 2 个
东北证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 2 个
东方财富	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
东吴证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 2 个
光大证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国金证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国联民生	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

国泰海通	3	-	-	-	-	本报告期新增 3 个
国投证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华安证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华泰证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
开源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
西南证券	1	-	-	-	-	本报

						告期 新增 1 个
兴业证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 2 个
中信证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 2 个

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中金公司	150,680.45	0.01	77,000,000.00	0.31	-	-	-	-
中	-	-	23,000,000.00	0.09	-	-	-	-

信建投								
民生证券	-	-	1,703,700,000.00	6.96	-	-	-	-
申万宏源证券	60,671,639.17	5.69	-	-	-	-	-	-
国海证券	2,903,630.73	0.27	507,800,000.00	2.08	-	-	-	-
浙商证券	439,695,222.34	41.26	18,805,980,000.00	76.87	-	-	-	-
华福证券	-	-	440,500,000.00	1.80	-	-	-	-
国都证券	562,319,686.80	52.76	2,586,054,000.00	10.57	-	-	-	-
东方证券	-	-	320,000,000.00	1.31	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 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。

10.9 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	中欧稳健添悦债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2026-01-24
2	中欧稳健添悦债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-02-12
3	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
4	中欧稳健添悦债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2026-04-16
5	中欧稳健添悦债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2026-04-17
6	中欧稳健添悦债券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	2026-04-17
7	中欧稳健添悦债券型证券投资基金 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	中欧稳健添悦债券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	中国证监会指定媒介	2026-06-06

	本公司旗下基金销售业务的公告		
--	----------------	--	--

§ 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