

中欧核心智选混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧核心智选混合型证券投资基金	
基金简称	中欧核心智选混合	
基金主代码	025058	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 14 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	917,811,004.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧核心智选混合 A	中欧核心智选混合 C
下属分级基金的交易代码	025058	025059
报告期末下属分级基金的份额总额	143,677,074.28 份	774,133,929.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选股票，在力争控制投资组合风险的前提下，追求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*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+中债综合指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，还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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	冯萌
	联系电话	021-68609600	021-52629999-213310
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95561
传真		021-50190017	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	窦玉明	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)	
	中欧核心智选混合 A	中欧核心智选混合 C
本期已实现收益	22, 179, 722. 40	157, 862, 630. 91
本期利润	17, 863, 524. 20	133, 904, 790. 22
加权平均基金份 额本期利润	0. 1573	0. 1666
本期加权平均净 值利润率	13. 88%	14. 78%
本期基金份额净 值增长率	15. 15%	14. 80%
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	25, 410, 998. 34	133, 025, 199. 34
期末可供分配基 金份额利润	0. 1769	0. 1718
期末基金资产净 值	169, 088, 072. 62	907, 159, 129. 07

期末基金份额净值	1.1769	1.1718
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	20.35%	19.71%

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

中欧核心智选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.15%	1.14%	10.51%	1.11%	-0.36%	0.03%
过去六个月	15.15%	1.16%	8.24%	1.03%	6.91%	0.13%
自基金合同生效起至今	20.35%	0.93%	18.26%	0.97%	2.09%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧核心智选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.97%	1.14%	10.51%	1.11%	-0.54%	0.03%
过去六个月	14.80%	1.15%	8.24%	1.03%	6.56%	0.12%
自基金合同生效起至今	19.71%	0.93%	18.26%	0.97%	1.45%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*15%+中证港股通综

合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧核心智选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 8 月 14 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。

中欧核心智选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 8 月 14 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		
张聪	基金经理 / 基金经理助理	2025-08-14	-	5 年	历任友联互通信息技术有限公司高级软件工程师，IDG 资本投资顾问（北京）有限公司分析师，北京联和运通投资有限公司高级分析师，华兴资本新经济基金数据研究副总裁/数据团队负责人，高瓴资本 PE 大消费组副总裁，西部证券研究发展中心另类数据总监。2023-08-21 加入中欧基金管理有限公司。
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2025-08-14	-	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。
宋婷	量化投委会委员 / 基金经理	2025-08-14	-	8 年	历任上海千象资产管理有限公司股票研究员、股票投资经理。2023-07-03 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中张聪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。

本基金是以中证 800 指数为主要基准权重指数的基金，对标基准保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中盘平衡风格。本基金的选股策略是基于交易所深度行情和上市公司基本面等信息，应用数量化的投资方法，系统性地捕捉市场的非有效性，力争获取相对基准的超额收益。展望 2026 年，在经济温和复苏与政策支撑并存的背景下，市场机会与风险并存，风格轮动可能加快。我们将平衡高波动环境下的风险，力争让组合的超额收益更为平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 15.15%，同期业绩比较基准收益率为 8.24%；基金 C 类份额净值增长率为 14.80%，同期业绩比较基准收益率为 8.24%。

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，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，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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中欧核心智选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,539,454.12	29,708,907.58
结算备付金		2,773,079.99	362,730.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,057,476,416.24	1,229,397,199.32
其中：股票投资		1,010,473,710.68	1,168,810,809.93
基金投资		-	-
债券投资		47,002,705.56	60,586,389.39
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		70,811.75	422,388.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,083,859,762.10	1,259,891,226.62
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		2,793,637.48	11,143,139.47
应付管理人报酬		828,407.19	1,519,259.10
应付托管费		182,475.36	245,451.25
应付销售服务费		464,308.67	663,105.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,527.46	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,342,204.25	2,808,470.38
负债合计		7,612,560.41	16,379,425.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	917,811,004.01	1,192,202,873.60
未分配利润	6.4.7.8	158,436,197.68	51,308,927.61
净资产合计		1,076,247,201.69	1,243,511,801.21
负债和净资产总计		1,083,859,762.10	1,259,891,226.62

注： 1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 917,811,004.01 份。其中 A 类基金份额净值（暂估超额管理费前）1.1769 元，基金份额总额 143,677,074.28 份；暂估超额管理费前，基金资产净值为 169,088,072.62 元；暂估超额管理费金额 0 元，考虑暂估超额管理费后，基金资产净值为 169,088,072.62 元。C 类基金份额净值（暂估超额管理费前）1.1718 元，基金份额总额 774,133,929.73 份，暂估超额管理费前，基金资产净值为 907,159,129.07 元，暂估超额管理费金额 0 元，考虑暂估超额管理费后，基金资产净值为 907,159,129.07 元。暂估超额管理费为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提超额管理费前）清算，按照符合基金合同约定估算的超额管理费，实际计提时的超额管理费金额可能会与此处暂估超额管理费金额有差异。该金额是各基金份额持有人的暂估超额管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的超额管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

2. 本基金基金合同于 2025 年 08 月 14 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：中欧核心智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		161,832,341.56
1. 利息收入		23,901.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,901.88
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）		189,503,174.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	181,227,534.17
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.11	161,446.33
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	8,114,194.10
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	-28,274,038.89
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	579,303.97
减：二、营业总支出		10,064,027.14
1. 管理人报酬		5,684,426.16
2. 托管费		1,029,865.25
3. 销售服务费		2,708,186.62
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		43,012.36
其中：卖出回购金融资产支出		43,012.36
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		381.87
8. 其他费用	6.4.7.18	598,154.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		151,768,314.42
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		151,768,314.42
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		151,768,314.42

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧核心智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,192,202,873.60	-	51,308,927.61	1,243,511,801.21
二、本期期初净资产	1,192,202,873.60	-	51,308,927.61	1,243,511,801.21
三、本期增减变	-274,391,869.5	-	107,127,270.07	-167,264,599.52

动额(减少以“-”号填列)	9			
(一)、综合收益总额	-	-	151,768,314.42	151,768,314.42
(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)	-274,391,869.59	-	-23,885,191.48	-298,277,061.07
其中: 1. 基金申购款	680,238,779.96	-	94,275,405.72	774,514,185.68
2. 基金赎回款	-954,630,649.55	-	-118,160,597.20	-1,072,791,246.75
(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)	-	-	-20,755,852.87	-20,755,852.87
四、本期期末净资产	917,811,004.01	-	158,436,197.68	1,076,247,201.69

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

中欧核心智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1542 号《关于准予中欧核心智选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧核心智选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,116,716,067.52 元，经向中国证监会备案，《中欧核心智选混合型证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,117,181,104.05 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 465,036.53 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	19,986.93
等于：本金	19,985.00
加：应计利息	1.93
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	23,519,467.19
等于：本金	23,518,897.96
加：应计利息	569.23
减：坏账准备	-
合计	23,539,454.12

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		1, 028, 687, 969. 76	-	1, 010, 473, 710. 68	-18, 214, 259. 08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46, 735, 773. 00	260, 675. 56	47, 002, 705. 56	6, 257. 00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46, 735, 773. 00	260, 675. 56	47, 002, 705. 56	6, 257. 00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1, 075, 423, 742. 76	260, 675. 56	1, 057, 476, 416. 24	-18, 208, 002. 08

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	33.97
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	20,827.67
其他应付	6,058.01
应付或有管理费	3,255,777.23
合计	3,342,204.25

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧核心智选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,060,100.54	128,060,100.54
本期申购	94,381,019.63	94,381,019.63
本期赎回（以“-”号填列）	-78,764,045.89	-78,764,045.89
本期末	143,677,074.28	143,677,074.28

中欧核心智选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,064,142,773.06	1,064,142,773.06
本期申购	585,857,760.33	585,857,760.33
本期赎回（以“-”号填列）	-875,866,603.66	-875,866,603.66
本期末	774,133,929.73	774,133,929.73

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

中欧核心智选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,767,462.10	1,020,572.97	5,788,035.07
本期期初	4,767,462.10	1,020,572.97	5,788,035.07
本期利润	22,179,722.40	-4,316,198.20	17,863,524.20
本期基金份额交易产生的变动数	5,327,200.61	-949,721.99	4,377,478.62
其中：基金申购款	15,058,333.98	-339,843.10	14,718,490.88
基金赎回款	-9,731,133.37	-609,878.89	-10,341,012.26
本期已分配利润	-2,618,039.55	-	-2,618,039.55
本期末	29,656,345.56	-4,245,347.22	25,410,998.34

中欧核心智选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,064,761.30	8,456,131.24	45,520,892.54
本期期初	37,064,761.30	8,456,131.24	45,520,892.54
本期利润	157,862,630.91	-23,957,840.69	133,904,790.22
本期基金份额交易产生的变动数	-20,961,086.84	-7,301,583.26	-28,262,670.10
其中：基金申购款	81,432,551.04	-1,875,636.20	79,556,914.84
基金赎回款	-102,393,637.88	-5,425,947.06	-107,819,584.94
本期已分配利润	-18,137,813.32	-	-18,137,813.32
本期末	155,828,492.05	-22,803,292.71	133,025,199.34

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	1,196.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,198.54
结算备付金利息收入	10,349.16
其他	1,157.37
合计	23,901.88

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,943,459,904.56
减：卖出股票成本总额	5,756,946,829.20
减：交易费用	5,285,541.19
买卖股票差价收入	181,227,534.17

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	127,601.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,845.18
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	161,446.33

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	60,605,530.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,881,777.32
减：应计利息总额	689,907.51
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	33,845.18

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	8,114,194.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,114,194.10

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	-28,274,038.89
股票投资	-28,244,073.21
债券投资	-29,965.68
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-28,274,038.89

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	578,773.49
基金转换费收入	530.48
合计	579,303.97

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	20,827.67

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	13,854.56
账户维护费	9,000.00
开户费	200.00
或有管理费	494,765.28
合计	598,154.88

注：当满足本基金合同规定的特定条件时，或有管理费将返还给投资者或确认为应由管理人收取的管理费，该金额可能因期间结转的金额大于本期计提金额而列报为负数。

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

本基金的基金管理人于 2026 年 7 月 9 日宣告收益分配基准日为 2026 年 6 月 30 日的分红，向截至 2026 年 7 月 13 日止在本基金 A 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.177 元；向截至 2026 年 7 月 13 日止在本基金 C 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，分别按每 10 份基金份额派发红利 0.172 元。

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、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	5,684,426.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,730,052.27
应支付基金管理人的净管理费	2,954,373.89

注：根据本基金合同，支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费包含固定管理费、或有管理费和超额管理费。

(1) 固定管理费

支付基金管理人中欧基金的管理人报酬按前一日 基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

固定管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决

(2) 或有管理费和超额管理费

本基金根据每一基金份额的持有期限与持有期间年化收益率确定或有管理费和超额管理费。

当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，持有期限不足一年(即 365 天，下同)，则按 1.20%年费率收取管理费；

持有期限达到一年及以上，则根据持有期间年化收益率分为以下三种情况，分别确定对应的管理费率档位：

若持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率(扣除超额管理费后)超过 6%且持有收益率(扣除超额管理费后)为正，按 1.50%年费率确认管理费；若持有期间的年化超额收益率在-3%及以

下，按 0.60% 年费率确认管理费；其他情形按 1.20% 年费率确认管理费。

对于已经确认为管理人收入的或有管理费和超额管理费，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	1,029,865.25

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧核心智选混合 A	中欧核心智选混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	—	2,432,158.81	2,432,158.81
中欧财富	—	274.30	274.30
中欧基金	—	92,208.56	92,208.56
合计	—	2,524,641.67	2,524,641.67

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.60%。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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
兴业银行股份有限公司	19,986.93	1,196.81

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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

单位：人民币元

中欧核心智选混合 A							
序	权益	除息日	每 10 份基	现金形	再投资形	本期利	备注

号	登记日	场内	场外	金份额分 红数	式 发放总 额	式 发放总额	润分配 合计	
1	2026 年 1 月 13 日	-	2026 年 1 月 13 日	0.0750	862,530.6 8	-	862,530.6 8	-
2	2026 年 4 月 10 日	-	2026 年 4 月 10 日	0.1710	1,755,508 .87	-	1,755,508 .87	-
合计	-	-	-	0.2460	2,618,039 .55	-	2,618,039 .55	-
中欧核心智选混合 C								
序 号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 13 日	-	2026 年 1 月 13 日	0.0700	6,234,109 .26	-	6,234,109 .26	-
2	2026 年 4 月 10 日	-	2026 年 4 月 10 日	0.1640	11,903,70 4.06	-	11,903,70 4.06	-
合计	-	-	-	0.2340	18,137,81 3.32	-	18,137,81 3.32	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成功 认购 日	受限 期	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单 位： 股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	10.11	10.11	36,894	372,998.34	372,998.34	-
001248	华润	2026 年 6	1 个月 内（含）	新股 未上	10.11	10.11	15,811	159,849.21	159,849.21	-

	新 能 源	月 24 日		市						
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.12	27.73	5,943	60,143.16	164,799.39	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高 特 电 子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固	2026	6 个月	新 股	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

	德电材	年 2 月 27 日		流通受限						
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红	2026	6 个月	新股	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-

	板科技	年 3 月 31 日		流通受限						
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,390	27,355.20	196,671.10	-

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	287	186,349.82	252,425.11	-

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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过精选股票,在力争控制投资组合风险的前提下,追求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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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公司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	23,539,454.12	-	-	-	23,539,454.12
结算备付金	2,773,079.99	-	-	-	2,773,079.99
交易性金融资产	47,002,705.56	-	-	-1,010,473,710.68	1,057,476,416.24
应收申购款	-	-	-	70,811.75	70,811.75
资产总计	73,315,239.67	-	-	-1,010,544,522.43	1,083,859,762.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,793,637.48	2,793,637.48
应付管理人报酬	-	-	-	828,407.19	828,407.19

应付托管费	-	-	-	182,475.36	182,475.36
应付销售服务费	-	-	-	464,308.67	464,308.67
应交税费	-	-	-	1,527.46	1,527.46
其他负债	-	-	-	3,342,204.25	3,342,204.25
负债总计	-	-	-	7,612,560.41	7,612,560.41
利率敏感度缺口	73,315,239.67	-	-	-1,002,931,962.02	1,076,247,201.69
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	29,708,907.58	-	-	-	29,708,907.58
结算备付金	362,730.83	-	-	-	362,730.83
交易性金融资产	60,586,389.39	-	-	-1,168,810,809.93	1,229,397,199.32
应收申购款	-	-	-	422,388.89	422,388.89
资产总计	90,658,027.80	-	-	-1,169,233,198.82	1,259,891,226.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,143,139.47	11,143,139.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,519,259.10	1,519,259.10
应付托管费	-	-	-	245,451.25	245,451.25
应付销售服务费	-	-	-	663,105.21	663,105.21
其他负债	-	-	-	2,808,470.38	2,808,470.38
负债总计	-	-	-	16,379,425.41	16,379,425.41
利率敏感度缺口	90,658,027.80	-	-	-1,152,853,773.41	1,243,511,801.21

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 4.37%（2025 年 12 月 31 日：4.87%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,010,473,710.68	93.89	1,168,810,809.93	93.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,010,473,710.68	93.89	1,168,810,809.93	93.99

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%	57,705,518.06	29,042,601.57
	业绩比较基准下降 5%	-57,705,518.06	-29,042,601.57

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,007,663,844.67	1,166,407,935.99
第二层次	47,787,978.22	61,139,194.43
第三层次	2,024,593.35	1,850,068.90
合计	1,057,476,416.24	1,229,397,199.32

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	1,010,473,710.68	93.23
	其中：股票	1,010,473,710.68	93.23

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,002,705.56	4.34
	其中：债券	47,002,705.56	4.34
	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	26,312,534.11	2.43
8	其他各项资产	70,811.75	0.01
9	合计	1,083,859,762.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	552,660.00	0.05
B	采矿业	45,026,074.22	4.18
C	制造业	605,568,403.04	56.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,051,249.91	4.93
E	建筑业	7,579,573.00	0.70
F	批发和零售业	19,726,147.00	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	31,165,167.46	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,098,616.99	3.08
J	金融业	184,561,100.90	17.15
K	房地产业	7,549,185.00	0.70
L	租赁和商务服务业	5,717,719.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	7,268,886.94	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	4,435,467.22	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	1,897,200.00	0.18
P	教育	140,544.00	0.01
Q	卫生和社会工作	287,639.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	2,848,077.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	1,010,473,710.68	93.89

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	947,100	27,210,183.00	2.53
2	600036	招商银行	677,200	24,040,600.00	2.23
3	600999	招商证券	1,009,800	21,306,780.00	1.98
4	601988	中国银行	3,646,000	20,855,120.00	1.94
5	300308	中际旭创	13,600	17,272,000.00	1.60
6	601688	华泰证券	831,200	17,139,344.00	1.59
7	600000	浦发银行	1,621,700	13,962,837.00	1.30
8	000776	广发证券	576,100	13,480,740.00	1.25
9	300502	新易盛	17,160	10,416,120.00	0.97
10	600900	长江电力	375,800	9,947,426.00	0.92
11	002049	紫光国微	103,200	9,159,000.00	0.85
12	601658	邮储银行	1,749,400	8,624,542.00	0.80
13	600926	杭州银行	557,700	8,058,765.00	0.75
14	300750	宁德时代	20,500	8,056,705.00	0.75
15	300458	全志科技	201,460	7,949,611.60	0.74
16	600025	华能水电	871,900	7,751,191.00	0.72
17	600276	恒瑞医药	147,500	7,675,900.00	0.71
18	000983	山西焦煤	1,310,800	7,602,640.00	0.71
19	600183	生益科技	42,100	7,300,140.00	0.68
20	601919	中远海控	534,500	7,087,470.00	0.66
21	688582	芯动联科	107,388	6,980,220.00	0.65
22	601229	上海银行	783,000	6,796,440.00	0.63
23	600008	首创环保	2,269,500	6,173,040.00	0.57
24	300408	三环集团	35,900	5,991,710.00	0.56
25	301536	星宸科技	45,600	5,869,176.00	0.55
26	000100	TCL 科技	989,050	5,756,271.00	0.53
27	688469	芯联集成	540,189	5,731,405.29	0.53
28	300623	捷捷微电	125,100	5,628,249.00	0.52
29	603341	龙旗科技	129,500	5,502,455.00	0.51
30	601666	平煤股份	737,700	5,274,555.00	0.49
31	000937	冀中能源	1,312,850	5,225,143.00	0.49
32	600519	贵州茅台	4,400	5,216,156.00	0.48
33	300475	香农芯创	17,200	5,160,000.00	0.48
34	000050	深天马 A	512,100	5,074,911.00	0.47
35	601995	中金公司	137,800	4,981,470.00	0.46
36	600968	海油发展	1,484,100	4,942,053.00	0.46
37	002415	海康威视	140,109	4,791,727.80	0.45
38	601111	中国国航	779,000	4,712,950.00	0.44
39	002299	圣农发展	310,000	4,699,600.00	0.44
40	600098	广州发展	776,200	4,587,342.00	0.43

41	000519	中兵红箭	216,400	4,559,548.00	0.42
42	000032	深桑达 A	182,500	4,553,375.00	0.42
43	002064	华峰化学	478,200	4,538,118.00	0.42
44	688256	寒武纪	2,798	4,464,348.90	0.41
45	600498	烽火通信	60,500	4,452,800.00	0.41
46	600919	江苏银行	411,700	4,438,126.00	0.41
47	600177	雅戈尔	583,800	4,396,014.00	0.41
48	000831	中国稀土	76,100	4,222,789.00	0.39
49	000598	兴蓉环境	656,500	4,214,730.00	0.39
50	002916	深南电路	9,200	4,212,680.00	0.39
51	688498	源杰科技	2,198	4,145,428.00	0.39
52	601766	中国中车	790,700	4,111,640.00	0.38
53	600029	南方航空	792,900	4,107,222.00	0.38
54	002028	思源电气	23,700	4,100,100.00	0.38
55	300014	亿纬锂能	62,200	4,044,866.00	0.38
56	000878	云南铜业	251,300	3,990,644.00	0.37
57	002601	龙佰集团	241,200	3,974,976.00	0.37
58	300570	太辰光	16,100	3,972,031.00	0.37
59	600688	上海石化	1,344,200	3,938,506.00	0.37
60	300857	协创数据	11,460	3,895,254.00	0.36
61	600711	盛屯矿业	354,500	3,888,865.00	0.36
62	002130	沃尔核材	204,600	3,879,216.00	0.36
63	000657	中钨高新	40,400	3,867,088.00	0.36
64	600563	法拉电子	20,200	3,854,160.00	0.36
65	002600	领益智造	220,100	3,816,534.00	0.35
66	600153	建发股份	480,800	3,812,744.00	0.35
67	300033	同花顺	15,620	3,764,420.00	0.35
68	000425	徐工机械	462,900	3,744,861.00	0.35
69	002436	兴森科技	73,400	3,739,730.00	0.35
70	603986	兆易创新	4,500	3,667,500.00	0.34
71	002384	东山精密	13,800	3,620,430.00	0.34
72	001979	招商蛇口	561,500	3,610,445.00	0.34
73	600489	中金黄金	199,600	3,602,780.00	0.33
74	300017	网宿科技	275,700	3,586,857.00	0.33
75	000737	北方铜业	266,100	3,517,842.00	0.33
76	300548	长芯博创	12,500	3,475,000.00	0.32
77	688041	海光信息	9,245	3,423,423.50	0.32
78	600886	国投电力	250,556	3,334,900.36	0.31
79	001286	陕西能源	325,800	3,303,612.00	0.31
80	600362	江西铜业	76,200	3,299,460.00	0.31
81	688981	中芯国际	20,645	3,278,838.90	0.30
82	601156	东航物流	202,900	3,270,748.00	0.30
83	300679	电连技术	54,200	3,251,458.00	0.30

84	601211	国泰海通	177,400	3,228,680.00	0.30
85	300274	阳光电源	19,900	3,164,498.00	0.29
86	001696	宗申动力	149,600	3,113,176.00	0.29
87	002273	水晶光电	86,700	3,076,116.00	0.29
88	300136	信维通信	25,700	3,064,725.00	0.28
89	601872	招商轮船	172,100	3,023,797.00	0.28
90	002402	和而泰	114,100	2,947,203.00	0.27
91	600392	盛和资源	98,600	2,935,322.00	0.27
92	000733	振华科技	51,500	2,916,960.00	0.27
93	002414	高德红外	219,200	2,906,592.00	0.27
94	002851	麦格米特	17,100	2,858,778.00	0.27
95	601328	交通银行	443,000	2,848,490.00	0.26
96	601985	中国核电	313,700	2,832,711.00	0.26
97	600352	浙江龙盛	232,700	2,817,997.00	0.26
98	301611	珂玛科技	15,600	2,809,092.00	0.26
99	603920	世运电路	58,100	2,791,124.00	0.26
100	002913	奥士康	43,400	2,774,996.00	0.26
101	300418	昆仑万维	67,500	2,724,300.00	0.25
102	600588	用友网络	296,500	2,721,870.00	0.25
103	601857	中国石油	312,200	2,709,896.00	0.25
104	605218	伟时电子	163,500	2,702,655.00	0.25
105	000921	海信家电	98,100	2,680,092.00	0.25
106	600050	中国联通	666,500	2,666,000.00	0.25
107	300615	欣天科技	264,800	2,655,944.00	0.25
108	688266	泽璟制药	22,184	2,587,985.44	0.24
109	601869	长飞光纤	4,700	2,565,730.00	0.24
110	600998	九州通	542,900	2,546,201.00	0.24
111	002850	科达利	13,402	2,536,998.60	0.24
112	000932	华菱钢铁	729,000	2,529,630.00	0.24
113	601600	中国铝业	302,300	2,484,906.00	0.23
114	300454	深信服	25,500	2,453,100.00	0.23
115	301099	雅创电子	25,400	2,425,700.00	0.23
116	002475	立讯精密	34,200	2,407,680.00	0.22
117	002885	京泉华	57,100	2,333,106.00	0.22
118	603225	新凤鸣	118,000	2,318,700.00	0.22
119	600535	天士力	173,900	2,300,697.00	0.21
120	600584	长电科技	22,000	2,278,100.00	0.21
121	300620	光库科技	6,000	2,269,200.00	0.21
122	003022	联泓新科	87,100	2,255,890.00	0.21
123	688668	鼎通科技	5,982	2,233,080.60	0.21
124	601106	中国一重	675,700	2,229,810.00	0.21
125	002493	荣盛石化	205,700	2,211,275.00	0.21
126	600690	海尔智家	107,900	2,202,239.00	0.20

127	300748	金力永磁	70,800	2,184,180.00	0.20
128	600189	泉阳泉	289,400	2,179,182.00	0.20
129	002861	瀛通通讯	97,200	2,165,616.00	0.20
130	002025	航天电器	28,100	2,141,782.00	0.20
131	603858	步长制药	146,500	2,138,900.00	0.20
132	603308	应流股份	35,400	2,138,160.00	0.20
133	601699	潞安环能	149,700	2,137,716.00	0.20
134	688599	天合光能	150,666	2,127,403.92	0.20
135	603766	隆鑫通用	177,600	2,118,768.00	0.20
136	601865	福莱特	201,200	2,114,612.00	0.20
137	600027	华电国际	474,200	2,110,190.00	0.20
138	002155	湖南黄金	87,000	2,076,690.00	0.19
139	601799	星宇股份	22,900	2,075,198.00	0.19
140	003031	中瓷电子	11,500	2,073,450.00	0.19
141	001287	中电港	66,400	2,068,360.00	0.19
142	002461	珠江啤酒	272,600	2,063,582.00	0.19
143	688180	君实生物	60,102	2,032,649.64	0.19
144	300939	秋田微	29,200	2,020,640.00	0.19
145	000070	特发信息	96,600	2,013,144.00	0.19
146	002179	中航光电	43,500	2,009,700.00	0.19
147	600516	方大炭素	322,200	1,987,974.00	0.18
148	600176	中国巨石	27,000	1,967,760.00	0.18
149	600875	东方电气	68,100	1,959,237.00	0.18
150	300627	华测导航	68,800	1,953,920.00	0.18
151	301176	逸豪新材	28,700	1,951,600.00	0.18
152	600801	华新建材	124,900	1,948,440.00	0.18
153	002353	杰瑞股份	12,700	1,936,750.00	0.18
154	603421	鼎信通讯	311,900	1,918,185.00	0.18
155	000830	鲁西化工	158,700	1,904,400.00	0.18
156	300736	百邦科技	61,200	1,897,200.00	0.18
157	002465	海格通信	147,700	1,886,129.00	0.18
158	300077	国民技术	59,700	1,871,595.00	0.17
159	300120	经纬辉开	164,600	1,864,918.00	0.17
160	600282	南钢股份	405,500	1,861,245.00	0.17
161	603379	三美股份	24,500	1,859,305.00	0.17
162	301123	奕东电子	15,200	1,834,944.00	0.17
163	688343	云天励飞	22,439	1,832,368.74	0.17
164	601598	中国外运	364,300	1,806,928.00	0.17
165	300432	富临精工	89,800	1,804,082.00	0.17
166	300843	胜蓝股份	11,400	1,781,250.00	0.17
167	603259	药明康德	14,300	1,780,493.00	0.17
168	600893	航发动力	46,300	1,775,142.00	0.16
169	603999	读者传媒	353,500	1,767,500.00	0.16

170	000683	博源化工	306,200	1,763,712.00	0.16
171	300661	圣邦股份	12,200	1,750,456.00	0.16
172	000893	亚钾国际	42,800	1,750,092.00	0.16
173	688065	XD 凯赛生	36,491	1,746,094.35	0.16
174	688578	艾力斯	15,955	1,742,286.00	0.16
175	600601	方正科技	125,700	1,739,688.00	0.16
176	300476	胜宏科技	5,000	1,732,150.00	0.16
177	002532	天山铝业	161,400	1,731,822.00	0.16
178	600348	华阳股份	224,200	1,715,130.00	0.16
179	688728	格科微	81,342	1,711,435.68	0.16
180	688629	华丰科技	9,113	1,708,778.63	0.16
181	688772	珠海冠宇	86,427	1,696,562.01	0.16
182	600115	中国东航	443,300	1,688,973.00	0.16
183	000060	中金岭南	222,600	1,685,082.00	0.16
184	600887	伊利股份	70,300	1,684,388.00	0.16
185	002371	北方华创	1,900	1,680,664.00	0.16
186	688012	中微公司	3,579	1,676,761.50	0.16
187	600299	安迪苏	212,500	1,668,125.00	0.15
188	688617	惠泰医疗	8,927	1,620,786.12	0.15
189	301165	锐捷网络	20,100	1,617,045.00	0.15
190	000559	万向钱潮	124,000	1,603,320.00	0.15
191	000723	美锦能源	476,200	1,595,270.00	0.15
192	002584	西陇科学	164,300	1,557,564.00	0.14
193	300751	迈为股份	5,500	1,553,530.00	0.14
194	002993	奥海科技	21,400	1,532,454.00	0.14
195	002463	沪电股份	10,000	1,528,000.00	0.14
196	300735	光弘科技	67,000	1,523,580.00	0.14
197	601058	赛轮轮胎	132,000	1,521,960.00	0.14
198	688329	艾隆科技	75,136	1,518,498.56	0.14
199	688396	华润微	15,543	1,516,219.65	0.14
200	000792	盐湖股份	49,800	1,503,462.00	0.14
201	688248	南网科技	21,706	1,501,621.08	0.14
202	301377	鼎泰高科	2,700	1,487,430.00	0.14
203	601138	工业富联	20,600	1,486,290.00	0.14
204	002120	韵达股份	228,400	1,452,624.00	0.13
205	301358	湖南裕能	19,100	1,449,117.00	0.13
206	300763	锦浪科技	16,000	1,445,600.00	0.13
207	688331	荣昌生物	11,037	1,437,679.62	0.13
208	000623	吉林敖东	80,600	1,429,038.00	0.13
209	688183	生益电子	10,676	1,413,502.40	0.13
210	600847	万里股份	104,600	1,411,054.00	0.13
211	603126	中材节能	223,500	1,408,050.00	0.13
212	600483	福能股份	137,000	1,396,030.00	0.13

213	002056	横店东磁	45,700	1,392,936.00	0.13
214	601233	桐昆股份	64,100	1,387,765.00	0.13
215	600345	长江通信	21,100	1,382,261.00	0.13
216	002057	中钢天源	111,200	1,382,216.00	0.13
217	301177	迪阿股份	50,100	1,381,257.00	0.13
218	000625	长安汽车	189,800	1,360,866.00	0.13
219	000338	潍柴动力	48,500	1,321,625.00	0.12
220	600309	万华化学	19,300	1,320,313.00	0.12
221	300803	指南针	14,400	1,320,048.00	0.12
222	003042	中农联合	108,600	1,319,490.00	0.12
223	688061	灿瑞科技	25,819	1,282,429.73	0.12
224	002583	海能达	166,700	1,281,923.00	0.12
225	688322	奥比中光	9,787	1,277,692.85	0.12
226	002811	郑中设计	114,100	1,276,779.00	0.12
227	002855	捷荣技术	134,300	1,275,850.00	0.12
228	688220	翱捷科技	10,151	1,261,972.32	0.12
229	002429	兆驰股份	120,700	1,254,073.00	0.12
230	600549	厦门钨业	14,700	1,252,440.00	0.12
231	601139	深圳燃气	217,900	1,233,314.00	0.11
232	603885	吉祥航空	119,700	1,231,713.00	0.11
233	300285	国瓷材料	11,900	1,227,842.00	0.11
234	600353	旭光电子	26,800	1,222,080.00	0.11
235	300972	万辰集团	7,000	1,213,870.00	0.11
236	688120	华海清科	3,767	1,213,652.06	0.11
237	002126	银轮股份	24,300	1,210,140.00	0.11
238	603939	益丰药房	66,600	1,197,468.00	0.11
239	301205	联特科技	3,500	1,169,350.00	0.11
240	600663	陆家嘴	185,200	1,163,056.00	0.11
241	002745	木林森	91,600	1,149,580.00	0.11
242	603659	璞泰来	39,600	1,145,628.00	0.11
243	301337	亚华电子	41,100	1,142,580.00	0.11
244	002602	世纪华通	80,500	1,135,050.00	0.11
245	603993	洛阳钼业	64,500	1,131,975.00	0.11
246	603042	华脉科技	78,430	1,129,392.00	0.10
247	600380	健康元	119,800	1,128,516.00	0.10
248	002897	意华股份	12,700	1,117,346.00	0.10
249	300724	捷佳伟创	15,800	1,115,480.00	0.10
250	002648	卫星化学	47,300	1,111,077.00	0.10
251	301189	奥尼电子	18,800	1,107,884.00	0.10
252	688008	澜起科技	3,559	1,102,934.10	0.10
253	688709	成都华微	28,469	1,084,384.21	0.10
254	600031	三一重工	62,500	1,080,000.00	0.10
255	600988	赤峰黄金	41,000	1,079,120.00	0.10

256	603626	科森科技	58,300	1,078,550.00	0.10
257	300866	安克创新	10,300	1,076,350.00	0.10
258	601579	会稽山	73,200	1,075,308.00	0.10
259	600241	时代万恒	162,900	1,057,221.00	0.10
260	605388	均瑶健康	218,600	1,055,838.00	0.10
261	002491	通鼎互联	32,000	1,036,800.00	0.10
262	002513	蓝丰生化	216,100	1,032,958.00	0.10
263	600674	川投能源	72,300	1,024,491.00	0.10
264	600482	XD 中国动	31,100	1,020,080.00	0.09
265	002738	中矿资源	17,100	1,008,729.00	0.09
266	603806	福斯特	59,220	994,303.80	0.09
267	603568	伟明环保	64,420	990,779.60	0.09
268	000155	川能动力	82,700	990,746.00	0.09
269	688701	卓锦股份	130,454	982,318.62	0.09
270	300961	深水海纳	76,300	980,455.00	0.09
271	000883	湖北能源	226,900	980,208.00	0.09
272	000739	普洛药业	58,700	977,942.00	0.09
273	603650	彤程新材	9,900	970,002.00	0.09
274	002824	和胜股份	27,600	954,408.00	0.09
275	000509	华塑控股	255,600	953,388.00	0.09
276	300481	濮阳惠成	50,100	952,902.00	0.09
277	600595	中孚实业	169,000	949,780.00	0.09
278	600970	中材国际	133,100	949,003.00	0.09
279	603519	立霸股份	61,600	942,480.00	0.09
280	600018	上港集团	199,400	941,168.00	0.09
281	000807	云铝股份	42,095	931,983.30	0.09
282	300894	火星人	73,600	924,416.00	0.09
283	688361	中科飞测	2,148	923,640.00	0.09
284	601117	中国化学	124,500	915,075.00	0.09
285	688521	芯原股份	2,461	913,375.54	0.08
286	002174	游族网络	71,900	906,659.00	0.08
287	002715	登云股份	68,200	903,650.00	0.08
288	002578	闽发铝业	286,600	902,790.00	0.08
289	300576	容大感光	17,600	901,472.00	0.08
290	600028	中国石化	201,400	898,244.00	0.08
291	300115	长盈精密	31,700	885,698.00	0.08
292	603897	长城科技	27,200	882,912.00	0.08
293	601216	君正集团	196,200	875,052.00	0.08
294	002449	国星光电	112,400	871,100.00	0.08
295	002756	永兴材料	15,300	866,592.00	0.08
296	000568	泸州老窖	11,100	860,472.00	0.08
297	600602	云赛智联	53,400	858,672.00	0.08
298	601696	中银证券	67,800	857,670.00	0.08

299	300655	晶瑞电材	39,955	855,836.10	0.08
300	300223	北京君正	3,400	846,260.00	0.08
301	300263	隆华科技	51,800	844,340.00	0.08
302	002938	鹏鼎控股	8,000	843,040.00	0.08
303	002008	大族激光	5,600	840,616.00	0.08
304	688718	唯赛勃	52,460	837,786.20	0.08
305	001360	南矿集团	47,300	836,737.00	0.08
306	601212	白银有色	164,700	836,676.00	0.08
307	002432	九安医疗	11,800	834,024.00	0.08
308	300058	蓝色光标	59,200	814,592.00	0.08
309	300709	精研科技	14,300	804,375.00	0.07
310	300953	震裕科技	5,980	799,526.00	0.07
311	002077	大港股份	41,300	796,677.00	0.07
312	600377	宁沪高速	68,200	789,074.00	0.07
313	300604	长川科技	2,300	785,266.00	0.07
314	600714	金瑞矿业	38,200	784,246.00	0.07
315	000408	藏格矿业	11,300	783,316.00	0.07
316	603697	有友食品	81,200	778,708.00	0.07
317	601700	风范股份	178,200	776,952.00	0.07
318	603289	泰瑞机器	95,900	773,913.00	0.07
319	600785	新华百货	78,680	771,064.00	0.07
320	605177	东亚药业	44,600	763,106.00	0.07
321	600105	永鼎股份	11,300	762,524.00	0.07
322	301285	鸿日达	6,900	761,277.00	0.07
323	605007	五洲特纸	56,700	759,213.00	0.07
324	002809	红墙股份	100,500	747,720.00	0.07
325	688676	金盘科技	8,766	741,954.24	0.07
326	603738	泰晶科技	12,000	720,600.00	0.07
327	002440	闰土股份	70,100	718,525.00	0.07
328	301108	洁雅股份	30,400	717,136.00	0.07
329	688182	灿勤科技	16,640	716,684.80	0.07
330	001389	广合科技	3,000	711,750.00	0.07
331	300959	线上线下	4,800	709,488.00	0.07
332	002645	华宏科技	25,700	707,007.00	0.07
333	603290	斯达半导	4,600	703,524.00	0.07
334	000695	滨海能源	56,000	700,000.00	0.07
335	600863	华能蒙电	148,900	699,830.00	0.07
336	603345	安井食品	8,600	689,634.00	0.06
337	603799	华友钴业	14,100	680,466.00	0.06
338	000020	深华发 A	62,100	676,890.00	0.06
339	600884	杉杉股份	49,400	669,370.00	0.06
340	002281	光迅科技	2,600	668,044.00	0.06
341	301448	开创电气	14,700	667,086.00	0.06

342	600280	中央商场	252,800	664,864.00	0.06
343	605180	华生科技	55,800	661,230.00	0.06
344	300808	久量股份	29,500	653,720.00	0.06
345	002388	新亚制程	124,500	652,380.00	0.06
346	000586	汇源通信	49,300	651,253.00	0.06
347	600208	衢州发展	228,200	645,806.00	0.06
348	601858	中国科传	37,300	645,663.00	0.06
349	601360	三六零	74,200	644,798.00	0.06
350	002888	惠威科技	29,100	639,618.00	0.06
351	600292	电投水电	53,100	639,324.00	0.06
352	601567	三星电气	42,600	636,444.00	0.06
353	603931	格林达	10,700	635,580.00	0.06
354	600298	安琪酵母	17,500	633,500.00	0.06
355	300921	南凌科技	31,140	632,453.40	0.06
356	601838	成都银行	35,507	628,473.90	0.06
357	301200	大族数控	1,700	613,105.00	0.06
358	002244	滨江集团	80,400	611,040.00	0.06
359	603979	金诚信	10,200	602,106.00	0.06
360	002012	凯恩股份	93,800	601,258.00	0.06
361	688213	思特威	5,543	593,489.01	0.06
362	000629	钒钛股份	177,300	592,182.00	0.06
363	300134	大富科技	69,200	591,660.00	0.05
364	002517	恺英网络	36,400	591,500.00	0.05
365	000738	航发控制	32,300	590,767.00	0.05
366	002805	丰元股份	20,500	586,095.00	0.05
367	300059	东方财富	28,500	580,830.00	0.05
368	000002	万科 A	195,700	579,272.00	0.05
369	300882	万胜智能	34,600	573,668.00	0.05
370	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
371	603331	百达精工	52,900	563,914.00	0.05
372	300124	汇川技术	8,500	563,805.00	0.05
373	301132	满坤科技	10,700	561,964.00	0.05
374	300688	创业黑马	20,400	552,840.00	0.05
375	002678	珠江钢琴	130,300	551,169.00	0.05
376	300054	鼎龙股份	5,200	551,044.00	0.05
377	688416	恒烁股份	3,930	550,200.00	0.05
378	002558	巨人网络	19,900	548,444.00	0.05
379	300319	麦捷科技	18,500	548,155.00	0.05
380	002203	海亮股份	23,700	541,545.00	0.05
381	600339	中油工程	176,200	540,934.00	0.05
382	002443	金洲管道	56,300	536,539.00	0.05
383	300606	金太阳	12,600	536,256.00	0.05
384	001248	华润新能源	52,705	532,847.55	0.05

385	300909	汇创达	9,100	529,802.00	0.05
386	688411	海博思创	1,817	529,110.40	0.05
387	688009	中国通号	110,802	527,417.52	0.05
388	000951	中国重汽	26,900	524,819.00	0.05
389	605066	天正电气	76,900	522,151.00	0.05
390	603057	紫燕食品	23,400	521,820.00	0.05
391	600642	申能股份	59,600	520,308.00	0.05
392	600359	新农开发	94,600	510,840.00	0.05
393	002078	太阳纸业	40,800	509,592.00	0.05
394	002623	亚玛顿	32,500	507,650.00	0.05
395	002927	泰永长征	26,100	507,645.00	0.05
396	600130	波导股份	114,000	505,020.00	0.05
397	603968	醋化股份	54,400	503,744.00	0.05
398	001373	翔腾新材	16,500	497,475.00	0.05
399	603332	苏州龙杰	49,000	495,390.00	0.05
400	301389	隆扬电子	5,700	494,703.00	0.05
401	002001	新 和 成	17,400	494,508.00	0.05
402	000068	华控赛格	174,700	494,401.00	0.05
403	688035	德邦科技	5,368	492,782.40	0.05
404	600011	华能国际	64,800	491,832.00	0.05
405	002422	科伦药业	12,700	489,204.00	0.05
406	601615	明阳智能	41,900	484,783.00	0.05
407	600809	山西汾酒	4,300	470,291.00	0.04
408	603296	华勤技术	6,300	467,901.00	0.04
409	000952	广济药业	86,100	466,662.00	0.04
410	003035	南网能源	80,100	466,182.00	0.04
411	601816	京沪高铁	102,500	464,325.00	0.04
412	300571	平治信息	10,100	461,166.00	0.04
413	300390	天华新能	4,900	458,199.00	0.04
414	300726	宏达电子	5,300	448,221.00	0.04
415	600515	海南机场	162,800	446,072.00	0.04
416	688234	天岳先进	2,564	444,879.64	0.04
417	301028	鼎熔岩	27,600	440,496.00	0.04
418	000001	平安银行	43,200	434,160.00	0.04
419	002412	汉森制药	78,500	431,750.00	0.04
420	600039	四川路桥	54,600	426,972.00	0.04
421	002185	华天科技	19,100	426,121.00	0.04
422	000708	中信特钢	33,600	424,032.00	0.04
423	300433	蓝思科技	7,900	423,914.00	0.04
424	000822	山东海化	105,400	423,708.00	0.04
425	301526	国际复材	9,000	420,030.00	0.04
426	600346	恒力石化	23,500	416,185.00	0.04
427	300567	精测电子	1,300	412,880.00	0.04

428	000729	燕京啤酒	40,479	410,052.27	0.04
429	300814	中富电路	2,000	409,000.00	0.04
430	000967	盈峰环境	38,800	408,564.00	0.04
431	600985	淮北矿业	28,900	406,045.00	0.04
432	002313	日海智能	54,500	398,940.00	0.04
433	300383	光环新网	31,900	396,836.00	0.04
434	600319	亚星化学	63,600	396,228.00	0.04
435	600166	福田汽车	135,300	393,723.00	0.04
436	001366	播恩集团	35,300	382,652.00	0.04
437	603711	香飘飘	34,400	382,184.00	0.04
438	001260	坤泰股份	24,200	378,730.00	0.04
439	301373	凌玮科技	2,400	373,200.00	0.03
440	002136	安纳达	28,500	372,780.00	0.03
441	601116	三江购物	37,300	368,151.00	0.03
442	600429	三元股份	89,600	361,984.00	0.03
443	002782	可立克	17,100	359,955.00	0.03
444	000679	大连友谊	57,900	357,243.00	0.03
445	301163	宏德股份	16,100	357,098.00	0.03
446	603172	万丰股份	21,700	356,531.00	0.03
447	600149	廊坊发展	79,400	356,506.00	0.03
448	002603	以岭药业	23,700	355,500.00	0.03
449	002065	东华软件	49,400	352,716.00	0.03
450	301251	威尔高	6,600	351,648.00	0.03
451	600637	东方明珠	42,300	351,513.00	0.03
452	002949	华阳国际	35,500	351,095.00	0.03
453	300929	华骐环保	33,300	350,982.00	0.03
454	301515	港通医疗	20,000	350,600.00	0.03
455	600391	航发科技	10,300	344,535.00	0.03
456	301085	亚康股份	5,600	339,416.00	0.03
457	000786	北新建材	18,600	336,474.00	0.03
458	605058	澳弘电子	9,200	332,672.00	0.03
459	002683	广东宏大	11,300	330,977.00	0.03
460	301227	森鹰窗业	13,100	330,251.00	0.03
461	688793	倍轻松	20,483	329,981.13	0.03
462	003023	彩虹集团	16,800	326,592.00	0.03
463	603320	迪贝电气	18,600	324,570.00	0.03
464	000630	铜陵有色	50,800	323,088.00	0.03
465	603777	来伊份	20,500	318,365.00	0.03
466	600583	海油工程	62,900	316,387.00	0.03
467	300568	星源材质	16,900	316,368.00	0.03
468	688367	工大高科	9,465	315,184.50	0.03
469	600578	京能电力	48,700	314,115.00	0.03
470	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.03

471	688819	天能股份	13,749	305,227.80	0.03
472	301383	天键股份	12,700	303,530.00	0.03
473	000758	中色股份	45,900	301,563.00	0.03
474	601086	国芳集团	44,400	294,372.00	0.03
475	601616	广电电气	86,100	293,601.00	0.03
476	600316	洪都航空	10,500	293,370.00	0.03
477	300987	川网传媒	23,700	291,510.00	0.03
478	002524	光正眼科	86,900	287,639.00	0.03
479	600150	中国船舶	8,369	282,788.51	0.03
480	600792	云煤能源	89,200	282,764.00	0.03
481	300834	星辉环材	6,700	280,060.00	0.03
482	002800	天顺股份	21,400	277,986.00	0.03
483	301025	读客文化	35,800	277,808.00	0.03
484	603170	宝立食品	24,400	275,720.00	0.03
485	002367	康力电梯	39,200	270,872.00	0.03
486	301198	喜悦智行	20,200	270,680.00	0.03
487	002903	宇环数控	5,900	267,978.00	0.02
488	601155	新城控股	26,000	266,760.00	0.02
489	301098	金埔园林	32,500	266,500.00	0.02
490	688539	高华科技	8,275	263,807.00	0.02
491	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
492	601127	赛力斯	4,200	257,250.00	0.02
493	300670	大烨智能	36,400	256,984.00	0.02
494	300650	太龙股份	17,600	255,728.00	0.02
495	688072	拓荆科技	287	252,425.11	0.02
496	605080	浙江自然	13,100	252,306.00	0.02
497	300842	帝科股份	2,800	249,676.00	0.02
498	002702	海欣食品	55,600	247,420.00	0.02
499	603326	我乐家居	39,900	245,784.00	0.02
500	688335	复洁科技	10,170	244,486.80	0.02
501	300870	欧陆通	700	241,983.00	0.02
502	301056	森赫股份	20,900	234,080.00	0.02
503	000811	冰轮环境	4,100	230,502.00	0.02
504	300616	尚品宅配	21,900	228,198.00	0.02
505	300917	特发服务	9,300	226,734.00	0.02
506	688047	龙芯中科	1,438	222,415.46	0.02
507	300759	康龙化成	7,500	216,975.00	0.02
508	300839	博汇股份	17,300	202,583.00	0.02
509	002131	利欧股份	42,500	201,875.00	0.02
510	301568	思泰克	1,800	200,880.00	0.02
511	688820	盛合晶微	1,390	196,671.10	0.02
512	688472	阿特斯	17,644	190,908.08	0.02
513	688273	麦澜德	4,889	189,399.86	0.02

514	002606	大连电瓷	14,100	189,081.00	0.02
515	600499	科达制造	13,400	184,920.00	0.02
516	002831	裕同科技	5,200	184,912.00	0.02
517	300450	先导智能	4,500	183,240.00	0.02
518	300513	恒实科技	25,200	182,448.00	0.02
519	300982	苏文电能	12,000	181,320.00	0.02
520	603536	惠发食品	22,600	176,054.00	0.02
521	300715	凯伦股份	10,600	174,476.00	0.02
522	300578	会畅科技	9,900	172,161.00	0.02
523	300637	扬帆新材	16,400	170,232.00	0.02
524	688429	时创能源	16,520	168,338.80	0.02
525	688038	中科通达	9,863	165,895.66	0.02
526	001376	百通能源	15,900	165,360.00	0.02
527	001399	惠科股份	5,943	164,799.39	0.02
528	000607	华媒控股	53,600	164,552.00	0.02
529	603356	华菱精工	9,900	163,548.00	0.02
530	301040	中环海陆	6,700	163,279.00	0.02
531	603578	三星新材	13,600	159,800.00	0.01
532	002627	三峡旅游	26,800	153,028.00	0.01
533	300686	智动力	8,200	147,682.00	0.01
534	002655	共达电声	3,200	147,200.00	0.01
535	688202	美迪西	1,786	144,148.06	0.01
536	600455	博通股份	6,400	140,544.00	0.01
537	002760	凤形股份	8,200	134,644.00	0.01
538	603020	爱普股份	9,500	133,950.00	0.01
539	300590	移为通信	9,300	133,455.00	0.01
540	002692	远程股份	35,000	131,950.00	0.01
541	002176	江特电机	12,900	129,129.00	0.01
542	300907	康平科技	2,300	128,800.00	0.01
543	603166	福达股份	9,600	128,352.00	0.01
544	688099	晶晨股份	1,236	127,184.40	0.01
545	603755	日辰股份	5,600	127,064.00	0.01
546	002862	实丰文化	9,900	127,017.00	0.01
547	000968	蓝焰控股	21,200	126,988.00	0.01
548	603960	克来机电	7,200	125,352.00	0.01
549	688478	晶升股份	1,415	125,298.25	0.01
550	300249	依米康	8,100	124,740.00	0.01
551	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
552	002345	潮宏基	13,000	119,210.00	0.01
553	605258	协和电子	3,500	118,580.00	0.01
554	600590	泰豪科技	11,700	118,170.00	0.01
555	301024	霍普股份	3,200	117,824.00	0.01
556	002265	建设工业	6,700	116,580.00	0.01

557	688002	睿创微纳	744	115,089.36	0.01
558	601608	中信重工	24,100	114,957.00	0.01
559	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
560	601019	山东出版	17,800	113,920.00	0.01
561	600219	南山铝业	27,800	110,922.00	0.01
562	002682	龙洲股份	26,100	110,664.00	0.01
563	603803	瑞斯康达	9,300	109,182.00	0.01
564	000159	国际实业	20,100	108,138.00	0.01
565	600989	宝丰能源	5,300	107,749.00	0.01
566	300798	锦鸡股份	16,500	107,745.00	0.01
567	002426	胜利精密	26,900	107,062.00	0.01
568	301032	新柴股份	11,500	106,950.00	0.01
569	002270	华明装备	5,600	105,560.00	0.01
570	003001	中岩大地	8,100	104,895.00	0.01
571	600026	中远海能	5,800	104,052.00	0.01
572	002857	三晖电气	5,900	103,663.00	0.01
573	300510	金冠股份	32,600	101,712.00	0.01
574	603381	永臻股份	6,600	101,706.00	0.01
575	301287	康力源	3,100	100,099.00	0.01
576	600768	宁波富邦	6,600	98,868.00	0.01
577	688077	大地熊	3,731	98,834.19	0.01
578	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
579	603719	良品铺子	11,200	96,880.00	0.01
580	300614	百川畅银	9,800	94,864.00	0.01
581	001309	德明利	100	94,290.00	0.01
582	000995	皇台酒业	9,900	94,050.00	0.01
583	301020	密封科技	4,300	93,912.00	0.01
584	600561	江西长运	18,900	93,555.00	0.01
585	600126	杭钢股份	15,200	93,176.00	0.01
586	002596	海南瑞泽	32,500	92,950.00	0.01
587	000027	深圳能源	14,600	90,520.00	0.01
588	605567	春雪食品	11,300	90,287.00	0.01
589	003027	同兴科技	5,100	88,893.00	0.01
590	000895	双汇发展	3,900	87,360.00	0.01
591	002743	富煌钢构	22,400	86,464.00	0.01
592	300795	米奥会展	10,100	86,456.00	0.01
593	002723	小崧股份	9,700	85,748.00	0.01
594	002771	真视通	6,900	84,732.00	0.01
595	600463	空港股份	11,100	84,693.00	0.01
596	002712	思美传媒	20,400	84,660.00	0.01
597	300787	海能实业	9,100	82,992.00	0.01
598	300558	贝达药业	1,200	78,084.00	0.01
599	000962	东方钽业	800	72,480.00	0.01

600	002159	三特索道	5,800	71,746.00	0.01
601	688683	莱尔科技	1,718	65,146.56	0.01
602	300603	立昂技术	8,400	64,428.00	0.01
603	603798	康普顿	4,600	62,928.00	0.01
604	000506	招金黄金	5,300	62,116.00	0.01
605	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.01
606	603176	汇通集团	14,300	61,204.00	0.01
607	000803	山高环能	9,000	61,020.00	0.01
608	600530	交大昂立	12,300	60,639.00	0.01
609	688681	科汇股份	4,227	59,093.46	0.01
610	002849	威星智能	3,400	57,528.00	0.01
611	600426	华鲁恒升	2,400	57,408.00	0.01
612	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
613	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
614	002947	恒铭达	700	53,235.00	0.00
615	600232	金鹰股份	8,100	51,030.00	0.00
616	002686	亿利达	9,900	50,985.00	0.00
617	600367	红星发展	800	50,344.00	0.00
618	002951	金时科技	3,700	49,432.00	0.00
619	688278	特宝生物	907	49,340.80	0.00
620	300346	南大光电	500	46,325.00	0.00
621	605158	华达新材	7,200	46,080.00	0.00
622	600493	凤竹纺织	8,600	45,064.00	0.00
623	300992	泰福泵业	1,800	44,874.00	0.00
624	600067	冠城新材	15,200	44,080.00	0.00
625	603028	赛福天	6,800	43,996.00	0.00
626	300713	英可瑞	3,400	43,316.00	0.00
627	300964	本川智能	500	43,085.00	0.00
628	601118	海南橡胶	8,500	41,820.00	0.00
629	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
630	002418	康盛股份	9,700	38,218.00	0.00
631	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
632	688303	大全能源	1,920	33,465.60	0.00
633	002793	罗欣药业	8,700	33,408.00	0.00
634	002442	龙星科技	6,600	32,538.00	0.00
635	001278	一彬科技	2,100	32,298.00	0.00
636	603096	新经典	2,200	29,436.00	0.00
637	688618	三旺通信	916	28,185.32	0.00
638	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
639	601399	国机重装	7,000	24,500.00	0.00
640	600281	华阳新材	5,600	22,960.00	0.00
641	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
642	301372	科净源	700	22,057.00	0.00

643	300621	维业股份	3,400	21,590.00	0.00
644	301212	联盛化学	900	21,015.00	0.00
645	603013	亚普股份	1,300	20,527.00	0.00
646	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
647	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
648	001282	三联锻造	900	18,342.00	0.00
649	002877	智能自控	2,600	18,304.00	0.00
650	002955	鸿合科技	500	17,875.00	0.00
651	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
652	688318	财富趋势	231	16,472.61	0.00
653	301010	晶雪节能	1,000	16,290.00	0.00
654	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
655	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
656	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
657	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
658	688620	安凯微	880	14,256.00	0.00
659	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
660	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
661	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
662	603407	长裕集团	163	12,820.54	0.00
663	002820	桂发祥	1,500	12,600.00	0.00
664	002153	石基信息	1,700	12,291.00	0.00
665	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
666	301388	欣灵电气	500	11,660.00	0.00
667	002236	大华股份	700	11,543.00	0.00
668	003003	天元股份	1,100	10,945.00	0.00
669	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
670	300303	聚飞光电	900	9,954.00	0.00
671	001280	中国铀业	142	9,471.40	0.00
672	301232	飞沃科技	60	9,237.00	0.00
673	603727	博迈科	500	8,530.00	0.00
674	301236	软通动力	200	8,490.00	0.00
675	002591	恒大高新	1,300	7,956.00	0.00
676	301356	天振股份	300	7,881.00	0.00
677	688148	芳源股份	918	7,876.44	0.00
678	600251	冠农股份	900	7,776.00	0.00
679	002084	海鸥住工	2,200	7,656.00	0.00
680	600724	宁波富达	1,500	7,605.00	0.00
681	601921	浙版传媒	1,100	7,359.00	0.00
682	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
683	600203	福日电子	600	7,290.00	0.00
684	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
685	002931	锋龙股份	100	6,898.00	0.00

686	600775	南京熊猫	700	6,692.00	0.00
687	002910	庄园牧场	600	6,648.00	0.00
688	300927	江天化学	300	6,459.00	0.00
689	605167	利柏特	400	6,440.00	0.00
690	300144	宋城演艺	1,100	6,391.00	0.00
691	688616	西力科技	568	5,736.80	0.00
692	001306	夏厦精密	100	5,457.00	0.00
693	603392	万泰生物	200	5,394.00	0.00
694	300536	农尚环境	600	5,094.00	0.00
695	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
696	300522	世名科技	200	4,794.00	0.00
697	600085	同仁堂	200	4,622.00	0.00
698	605399	晨光新材	300	4,407.00	0.00
699	301268	铭利达	300	4,194.00	0.00
700	002773	康弘药业	200	4,090.00	0.00
701	301060	兰卫医学	500	4,085.00	0.00
702	000637	茂化实华	1,000	3,500.00	0.00
703	603909	建发合诚	400	3,412.00	0.00
704	300746	汉嘉数智	300	3,243.00	0.00
705	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
706	000617	中油资本	400	2,636.00	0.00
707	301449	天溯计量	64	2,476.80	0.00
708	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
709	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
710	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
711	000017	深中华 A	300	1,836.00	0.00
712	002296	辉煌科技	200	1,776.00	0.00
713	000725	京东方 A	200	1,736.00	0.00
714	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
715	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
716	002946	新乳业	100	1,408.00	0.00
717	601717	中创智领	100	1,391.00	0.00
718	301100	风光股份	100	1,390.00	0.00
719	300121	阳谷华泰	100	1,260.00	0.00
720	603616	韩建河山	200	1,208.00	0.00
721	600255	鑫科材料	300	1,044.00	0.00
722	600198	大唐电信	100	965.00	0.00
723	600906	财达证券	100	746.00	0.00
724	001313	粤海饲料	100	709.00	0.00
725	001213	中铁特货	100	335.00	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	600519	贵州茅台	48,402,212.00	3.89
2	600030	中信证券	32,921,598.00	2.65
3	300750	宁德时代	28,622,359.00	2.30
4	000651	格力电器	27,637,145.70	2.22
5	600036	招商银行	26,372,263.00	2.12
6	000060	中金岭南	25,209,912.62	2.03
7	600999	招商证券	25,089,124.00	2.02
8	300308	中际旭创	24,571,001.00	1.98
9	600460	士兰微	23,335,094.15	1.88
10	601988	中国银行	22,172,393.00	1.78
11	603259	药明康德	20,170,706.00	1.62
12	600000	浦发银行	19,948,479.00	1.60
13	002475	立讯精密	19,545,477.00	1.57
14	603288	海天味业	19,369,528.08	1.56
15	600372	中航机载	19,356,235.71	1.56
16	600048	保利发展	19,148,186.00	1.54
17	600183	生益科技	18,968,925.00	1.53
18	601919	中远海控	18,666,352.00	1.50
19	300502	新易盛	18,383,013.80	1.48
20	688008	澜起科技	18,017,462.81	1.45

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	600519	贵州茅台	41,220,262.50	3.31
2	601318	中国平安	40,298,168.98	3.24
3	600030	中信证券	39,280,000.00	3.16
4	600497	驰宏锌锗	38,128,117.46	3.07
5	601899	紫金矿业	32,374,965.00	2.60
6	000060	中金岭南	28,993,336.00	2.33
7	300750	宁德时代	28,823,951.00	2.32
8	000651	格力电器	28,618,145.00	2.30
9	600522	中天科技	26,977,793.00	2.17
10	600372	中航机载	26,496,297.18	2.13
11	600487	亨通光电	25,959,940.00	2.09
12	600460	士兰微	25,566,794.00	2.06
13	000725	京东方 A	24,493,271.00	1.97
14	603288	海天味业	22,425,894.58	1.80
15	300394	天孚通信	22,362,105.10	1.80
16	600887	伊利股份	22,291,111.00	1.79
17	688008	澜起科技	22,005,553.95	1.77
18	601066	中信建投	20,414,511.16	1.64

19	600188	兖矿能源	20,271,662.85	1.63
20	600598	北大荒	19,910,663.00	1.60

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,626,853,803.16
卖出股票收入（成交）总额	5,943,459,904.56

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	47,002,705.56	4.37
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	47,002,705.56	4.37

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	019827	26 国债 01	467,000	47,002,705.56	4.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易

成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商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的处罚。中国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的处罚。上海浦东发展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、中国人民银行上海市分行(国家外汇管理局上海市分局)的处罚。广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	70,811.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,811.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧核心 智选混合 A	752	191,059.94	48,027,485.92	33.43%	95,649,588.36	66.57%
中欧核心 智选混合 C	3,948	196,082.56	139,095,693.86	17.97%	635,038,235.87	82.03%
合计	4,700	195,278.94	187,123,179.78	20.39%	730,687,824.23	79.61%

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	中欧核心智选混合 A	125,279.36	0.09%
	中欧核心智选混合 C	0.00	0.00%
	合计	125,279.36	0.01%

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	中欧核心智选混合 A	0
	中欧核心智选混合 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧核心智选混合 A	0
	中欧核心智选混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧核心智选混合 A	中欧核心智选混合 C
基金合同生效日 (2025 年 8 月 14 日) 基金份额总额	177,394,880.35	1,939,786,223.70
本报告期期初基金份 额总额	128,060,100.54	1,064,142,773.06
本报告期基金总申购 份额	94,381,019.63	585,857,760.33
减：本报告期基金总 赎回份额	78,764,045.89	875,866,603.66
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	143,677,074.28	774,133,929.73

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	11,044,918,391.34	95.48	1,501,037.58	95.48	-
国信证券	3	522,407,515.41	4.52	70,994.72	4.52	-
浙商证券	3	-	-	-	-	本报告期新增3个

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
兴业证券	46,887,183.33	72.06	542,140,000.00	100.00	-	-
国信证券	18,175,991.21	27.94	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧核心智选混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2026-01-09
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	中欧核心智选混合型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“赤峰黄金”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-21
5	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
6	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
7	中欧核心智选混合型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
8	中欧核心智选混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2026-04-09
9	中欧核心智选混合型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金	中国证监会指定媒介	2026-04-22

	2026 年第一季度报告的提示性公告		
11	中欧核心智选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
12	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