

中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：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 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	中欧沪深 300 指数量化增强	
基金主代码	021757	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 11 月 29 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	1, 078, 917, 119. 63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧沪深 300 指数量化增强 A	中欧沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的交 易代码	021757	021758
报告期末下属分级 基金的份额总额	809, 995, 976. 07 份	268, 921, 143. 56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争控制本基金与业绩比较基准之间的跟踪偏离度。 同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用基金管理人量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合，以争取实现指数增强型基金的目标。 本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。本基金坚持研究创造价值的理念，通过对上市公司深入、持续的研究，依托基金管理人研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合，精选具有较强竞争优势的公司，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基

	金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	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	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)	
	中欧沪深 300 指数量化增强 A	中欧沪深 300 指数量化增强 C
本期已实现收益	64,450,140.93	25,602,693.23
本期利润	61,044,405.71	18,655,149.23
加权平均基金份 额本期利润	0.1263	0.1046

本期加权平均净 值利润率	9.46%	7.86%
本期基金份额净 值增长率	10.31%	10.09%
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	304,089,474.74	98,647,942.24
期末可供分配基 金份额利润	0.3754	0.3668
期末基金资产净 值	1,114,085,450.81	367,569,085.80
期末基金份额净 值	1.3754	1.3668
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	37.54%	36.68%

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

中欧沪深 300 指数量化增强 A

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	7.86%	1.04%	11.30%	1.19%	-3.44%	-0.15%
过去六个月	10.31%	1.01%	7.20%	1.07%	3.11%	-0.06%
过去一年	36.37%	0.92%	25.13%	0.97%	11.24%	-0.05%
自基金合同生效起	37.54%	0.94%	27.13%	0.96%	10.41%	-0.02%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧沪深 300 指数量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	7.76%	1.04%	11.30%	1.19%	-3.54%	-0.15%
过去六个月	10.09%	1.01%	7.20%	1.07%	2.89%	-0.06%
过去一年	35.82%	0.92%	25.13%	0.97%	10.69%	-0.05%
自基金合同生效起至今	36.68%	0.94%	27.13%	0.96%	9.55%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧沪深300指数量化增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧沪深300指数量化增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至2026年6月30日，本基金管理人共管理243只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2025-01-07	—	4年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
徐熙宁	基金经理 / 基金经理助理	2026-03-09	—	3年	2022-07-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
曲径	量化投决会主席 /	2024-11-29	—	19年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总

权益专户 投决会委员 / 量化 投资总监 / 基金经理 / 投资 经理					裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司，历任权益投决会委员。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理；徐熙宁担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	8,872,023,940.32	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,765,704,406.80	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	10,637,728,347.12	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济在温和通胀、政策积极支持的背景下平稳运行，呈现外需相对稳定、内需逐步恢复、新动能表现较好的特点，并在二季度进一步确认了温和复苏的方向，海外则始终笼罩在不确定性之中，美伊冲突推升油价与美联储货币政策转鹰成为贯穿全程的两条外部压制线索，而国内层面 3 月 PPI 同比 41 个月来首次转正、企业盈利拐点显现；行业层面，年初能源与资源板块成为亮点，但 5 月以来随大宗价格高位回落而明显调整，电子、通信为代表的“新质生产力”持续领涨，消费板块则全程偏弱。因子表现方面，今年以来表现突出的因子中，动量与 Beta 表现最为强劲，说明市场呈现显著的趋势行情，资金积极追逐高弹性资产。同时，成长性因子在多空收益和头部超额收益两个维度均表现亮眼。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多空收益表现不佳，市场呈现出极强的动量延续效应。

本基金是以沪深 300 指数为基准主要指数的指数量化增强基金，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差力争控制在合理范围内，整体表现为大盘平衡风格。基金利用基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成聚焦沪深 300 风险特征的投资组合，以追求达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对业绩比较基准指数的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 10.31%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；基金 C 类份额净值增长率为 10.09%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对中国主要股指持积极看多的判断，主要逻辑有三：其一，随着“反内卷”政策引导与供给自然出清逐见成效，资本开支增速下行，部分行业供需格局已显著改善，A 股有望从流动性驱动转向业绩驱动；其二，估值仍有空间，横向折价充分。当前 A 股相较美股、韩股显著折价，与欧日大体接近，性价比突出；其三，《推动中长期资金入市实施方案》落地，保险、社保、年金等长期资金加大入市力度，三年长周期考核引导“长钱长投”，资金端的制度红利将有望

持续释放。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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：中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	97,646,159.20	28,508,582.12
结算备付金		1,535,246.18	3,834,261.94
存出保证金		1,240,344.00	166,262.40
交易性金融资产	6.4.7.2	1,388,433,044.49	398,454,458.41
其中：股票投资		1,375,783,758.59	392,921,292.66
基金投资		-	-
债券投资		12,649,285.90	5,533,165.75
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		7,047,590.54	2,132,277.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,495,902,384.41	433,095,842.68
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		9,862,345.19	4,300,749.52
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,878,231.54	7,667,768.37
应付管理人报酬		947,531.23	304,340.80
应付托管费		236,882.80	76,085.20
应付销售服务费		113,895.38	33,643.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		57,219.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	151,742.43	52,533.82
负债合计		14,247,847.80	12,435,120.77
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	1,078,917,119.63	337,700,133.96
未分配利润	6.4.7.8	402,737,416.98	82,960,587.95
净资产合计		1,481,654,536.61	420,660,721.91
负债和净资产总计		1,495,902,384.41	433,095,842.68

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,078,917,119.63 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.3754 元，基金份额总额 809,995,976.07 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.3668 元，基金份额总额 268,921,143.56 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		84,628,627.51	9,134,210.84
1. 利息收入		69,038.56	54,803.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	69,038.56	54,803.63
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）		94,481,341.73	948,869.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	83,688,897.59	-1,370,948.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	62,726.18	54,908.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,762,150.11	-760,604.74
股利收益	6.4.7.14	8,967,567.85	3,025,513.84
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	-10,353,279.22	8,103,028.29
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	431,526.44	27,509.82
减：二、营业总支出		4,929,072.57	2,034,816.71
1. 管理人报酬		3,448,712.23	1,246,756.83
2. 托管费		862,178.02	311,689.21
3. 销售服务费		461,474.59	379,195.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		50,974.25	1,100.02
其中：卖出回购金融资产支出		50,974.25	1,100.02
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		6,448.91	-
8. 其他费用	6.4.7.18	99,284.57	96,074.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,699,554.94	7,099,394.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,699,554.94	7,099,394.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,699,554.94	7,099,394.13

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	337,700,133.96	-	82,960,587.95	420,660,721.91
二、本期期初净资产	337,700,133.96	-	82,960,587.95	420,660,721.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	741,216,985.67	-	319,776,829.03	1,060,993,814.70
(一)、综合收益总额	-	-	79,699,554.94	79,699,554.94
(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)	741,216,985.67	-	240,077,274.09	981,294,259.76
其中：1. 基金申购款	1,635,086,765.32	-	545,647,619.12	2,180,734,384.44
2. 基金赎回款	-893,869,779.65	-	-305,570,345.03	-1,199,440,124.68
(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	1,078,917,119.63	-	402,737,416.98	1,481,654,536.61
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	451,578,592.39	-	-4,518,334.25	447,060,258.14
二、本期期初净资产	451,578,592.39	-	-4,518,334.25	447,060,258.14

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-219,335,985.23	-	6,202,705.27	-213,133,279.96
(一)、综合收益总额	-	-	7,099,394.13	7,099,394.13
(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)	-219,335,985.23	-	-896,688.86	-220,232,674.09
其中：1. 基金申购款	80,929,459.51	-	-2,744,351.37	78,185,108.14
2. 基金赎回款	-300,265,444.74	-	1,847,662.51	-298,417,782.23
(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	232,242,607.16	-	1,684,371.02	233,926,978.18

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

中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]889 号文《关于准予中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 527,706,396.64 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70028871_B21 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧沪深 300 指数量化增强型证券

投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 29 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 527,891,954.75 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 185,558.11 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 178,155,713.27 份，包含认购利息折合 63,325.67 份；C 类基金的基金份额总额为 349,736,241.48 份，包含认购利息折合 122,232.44 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

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

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价

收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	20,144.07
等于：本金	20,000.00
加：应计利息	144.07
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	97,626,015.13
等于：本金	97,621,580.46
加：应计利息	4,434.67
减：坏账准备	—
合计	97,646,159.20

注：

其他存款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		1,381,964,554.16	—	1,375,783,758.59	-6,180,795.57
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	12,504,267.00	144,785.90	12,649,285.90	233.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	12,504,267.00	144,785.90	12,649,285.90	233.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,394,468,821.16	144,785.90	1,388,433,044.49	-6,180,562.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	10,283,250.00	—	—	—
其中：股指期货投资	10,283,250.00	—	—	—
其他衍	—	—	—	—

生工具				
合计	10,283,250.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	7.00	10,336,200.00	52,950.00
合计				52,950.00
减：可抵销期货暂收款				52,950.00
净额				0.00

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,468.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	64,962.45
预提费用-审计费	24,795.19
应付转出费	6.13
应付补差费	2.91
合计	151,742.43

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧沪深 300 指数量化增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	261,494,255.29	261,494,255.29
本期申购	1,185,671,274.46	1,185,671,274.46
本期赎回（以“-”号填列）	-637,169,553.68	-637,169,553.68
本期末	809,995,976.07	809,995,976.07

中欧沪深 300 指数量化增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,205,878.67	76,205,878.67
本期申购	449,415,490.86	449,415,490.86
本期赎回（以“-”号填列）	-256,700,225.97	-256,700,225.97
本期末	268,921,143.56	268,921,143.56

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

中欧沪深 300 指数量化增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,124,139.60	435,454.12	64,559,593.72
本期期初	64,124,139.60	435,454.12	64,559,593.72
本期利润	64,450,140.93	-3,405,735.22	61,044,405.71
本期基金份额交易产生的变动数	210,145,131.37	-31,659,656.06	178,485,475.31
其中：基金申购款	434,406,697.53	-35,994,459.89	398,412,237.64
基金赎回款	-224,261,566.16	4,334,803.83	-219,926,762.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	338,719,411.90	-34,629,937.16	304,089,474.74

中欧沪深 300 指数量化增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,275,090.85	125,903.38	18,400,994.23
本期期初	18,275,090.85	125,903.38	18,400,994.23
本期利润	25,602,693.23	-6,947,544.00	18,655,149.23
本期基金份额交易产生的变动数	66,205,976.19	-4,614,177.41	61,591,798.78
其中：基金申购款	157,726,187.34	-10,490,805.86	147,235,381.48
基金赎回款	-91,520,211.15	5,876,628.45	-85,643,582.70
本期已分配利润	-	-	-

本期末	110,083,760.27	-11,435,818.03	98,647,942.24
-----	----------------	----------------	---------------

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	3,371.10
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	50,128.53
结算备付金利息收入	12,018.97
其他	3,519.96
合计	69,038.56

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	3,764,378,806.91
减：卖出股票成本总额	3,677,121,137.14
减：交易费用	3,568,772.18
买卖股票差价收入	83,688,897.59

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	62,726.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	62,726.18

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,762,150.11

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	8,967,567.85
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	8,967,567.85

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	-10,369,509.22
股票投资	-10,368,285.22
债券投资	-1,224.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	16,230.00
权证投资	-
期货投资	16,230.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-10,353,279.22

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	425,615.23
基金转换费收入	5,911.21

合计	431,526.44
----	------------

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	5,982.01
账户维护费	9,000.00
合计	99,284.57

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、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,448,712.23	1,246,756.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,109,293.23	410,901.85
应支付基金管理人的净管理费	2,339,419.00	835,854.98

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	862,178.02	311,689.21

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		
	中欧沪深 300 指数量 化增强 A	中欧沪深 300 指数量 化增强 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	45,795.12	45,795.12
中欧财富	0.00	404.84	404.84
中欧基金	0.00	41,415.72	41,415.72
合计	0.00	87,615.68	87,615.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧沪深 300 指数量 化增强 A	中欧沪深 300 指数量 化增强 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	238,137.87	238,137.87
中欧财富	0.00	156.12	156.12
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	238,293.99	238,293.99

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算，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。若遇到法定节假日、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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧沪深 300 指数量化增强 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	3,623,308.29	0.45%	—	—

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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	20,144.07	3,371.10	1,114,679.38	4,412.22

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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	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	34,382	347,602.02	347,602.02	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	14,734	148,960.74	148,960.74	-
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	2026	6 个月	新股	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-

	海电子	年 5 月 11 日		流通受限						
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	5,780	58,493.60	160,279.40	-
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	976	44,974.08	452,210.08	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	579	40,333.14	92,674.74	-
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	2025	6 个月	新股	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

	广益	年 12 月 24 日		流通受限						
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	390	4,360.20	6,860.10	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,156	26,218.08	55,037.16	-
688785	恒	2026	6 个月	新股	92.18	463.15	106	9,771.08	49,093.90	-

	运昌	年 1 月 20 日		流通受限						
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	1,273	12,055.31	89,288.22	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	943	18,558.24	133,425.07	-

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	4,220	2,769,557.46	3,711,616.60	-

300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	1,300	8,122.98	5,590.00	-
--------	------	-----------------	--------	------	----------------	------	-------	----------	----------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 9,862,345.19 元, 于 2026 年 7 月 1 日和 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金, 其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票, 需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制, 力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年跟踪误差不超过 8% 的基础上, 追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心, 督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略, 并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作, 负责监察公司的风险管理措施的执行, 对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的

角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其

上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发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	97,646,159.20	-	-	-	97,646,159.20
结算备付金	1,535,246.18	-	-	-	1,535,246.18
存出保证金	-	-	-	1,240,344.00	1,240,344.00
交易性金融资产	12,649,285.90	-	-	1,375,783,758.59	1,388,433,044.49
应收申购款	-	-	-	7,047,590.54	7,047,590.54
资产总计	111,830,691.28	-	-	1,384,071,693.13	1,495,902,384.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,878,231.54	2,878,231.54
应付管理人报酬	-	-	-	947,531.23	947,531.23
应付托管费	-	-	-	236,882.80	236,882.80

卖出回购金融资产款	9,862,345.19	-	-	-	9,862,345.19
应付销售服务费	-	-	-	113,895.38	113,895.38
应交税费	-	-	-	57,219.23	57,219.23
其他负债	-	-	-	151,742.43	151,742.43
负债总计	9,862,345.19	-	-	4,385,502.61	14,247,847.80
利率敏感度缺口	101,968,346.09	-	-	-1,379,686,190.52	1,481,654,536.61
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	28,508,582.12	-	-	-	28,508,582.12
结算备付金	3,834,261.94	-	-	-	3,834,261.94
存出保证金	-	-	-	166,262.40	166,262.40
交易性金融资产	5,533,165.75	-	-	392,921,292.66	398,454,458.41
应收申购款	-	-	-	2,132,277.81	2,132,277.81
资产总计	37,876,009.81	-	-	395,219,832.87	433,095,842.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,667,768.37	7,667,768.37
应付管理人报酬	-	-	-	304,340.80	304,340.80
应付托管费	-	-	-	76,085.20	76,085.20
卖出回购金融资产款	4,300,749.52	-	-	-	4,300,749.52
应付销售服务费	-	-	-	33,643.06	33,643.06
其他负债	-	-	-	52,533.82	52,533.82
负债总计	4,300,749.52	-	-	8,134,371.25	12,435,120.77
利率敏感度缺口	33,575,260.29	-	-	387,085,461.62	420,660,721.91

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.85%（2025 年 12 月 31 日：1.32%），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	1,375,783,758.59	92.85	392,921,292.66	93.41
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	1,375,783,758.59	92.85	392,921,292.66	93.41

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%	66,478,427.82	18,919,479.51
	业绩比较基准下降 5%	-66,478,427.82	-18,919,479.51

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	1,369,797,224.17	391,177,090.53
第二层次	16,863,055.26	6,540,137.35
第三层次	1,772,765.06	737,230.53
合计	1,388,433,044.49	398,454,458.41

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,375,783,758.59	91.97
	其中：股票	1,375,783,758.59	91.97
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	12,649,285.90	0.85
	其中：债券	12,649,285.90	0.85
	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	99,181,405.38	6.63
8	其他各项资产	8,287,934.54	0.55
9	合计	1,495,902,384.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,593,319.00	0.65
B	采矿业	30,298,196.50	2.04
C	制造业	638,412,568.86	43.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,687,959.00	4.03
E	建筑业	5,360,674.00	0.36
F	批发和零售业	4,225,424.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	51,220,558.38	3.46
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,351,401.52	3.20
J	金融业	300,954,980.20	20.31
K	房地产业	8,308,072.16	0.56
L	租赁和商务服务业	2,025,904.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	7,968,640.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,165,407,697.62	78.66

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	150,120.00	0.01
B	采矿业	3,179,890.82	0.21
C	制造业	168,266,352.39	11.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,106,858.76	0.07
E	建筑业	3,132,039.00	0.21
F	批发和零售业	13,066,377.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	884,887.46	0.06
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,721,219.03	0.39
J	金融业	—	—
K	房地产业	690,900.00	0.05
L	租赁和商务服务业	1,132,957.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	3,214,358.80	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	3,621,792.71	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	2,083,200.00	0.14
P	教育	1,794,132.00	0.12
Q	卫生和社会工作	323,387.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	2,007,589.00	0.14
S	综合	—	—
	合计	210,376,060.97	14.20

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	36,100	45,847,000.00	3.09
2	600030	中信证券	1,370,700	39,380,211.00	2.66
3	600036	招商银行	1,069,968	37,983,864.00	2.56
4	600999	招商证券	1,452,900	30,656,190.00	2.07

5	601166	兴业银行	1,741,800	28,844,208.00	1.95
6	300750	宁德时代	70,900	27,864,409.00	1.88
7	300502	新易盛	45,280	27,484,960.00	1.86
8	600519	贵州茅台	22,800	27,029,172.00	1.82
9	601995	中金公司	544,600	19,687,290.00	1.33
10	601988	中国银行	3,438,460	19,667,991.20	1.33
11	002049	紫光国微	207,812	18,443,315.00	1.24
12	601688	华泰证券	860,400	17,741,448.00	1.20
13	600900	长江电力	646,800	17,120,796.00	1.16
14	000776	广发证券	726,900	17,009,460.00	1.15
15	600276	恒瑞医药	316,100	16,449,844.00	1.11
16	600000	浦发银行	1,862,400	16,035,264.00	1.08
17	688256	寒武纪	8,652	13,804,698.60	0.93
18	601658	邮储银行	2,738,400	13,500,312.00	0.91
19	600183	生益科技	77,500	13,438,500.00	0.91
20	603986	兆易创新	16,300	13,284,500.00	0.90
21	600025	华能水电	1,479,000	13,148,310.00	0.89
22	601229	上海银行	1,411,000	12,247,480.00	0.83
23	600690	海尔智家	580,900	11,856,169.00	0.80
24	601919	中远海控	893,100	11,842,506.00	0.80
25	300408	三环集团	68,500	11,432,650.00	0.77
26	688041	海光信息	29,404	10,888,301.20	0.73
27	000100	TCL 科技	1,848,700	10,759,434.00	0.73
28	601111	中国国航	1,632,500	9,876,625.00	0.67
29	002384	东山精密	37,200	9,759,420.00	0.66
30	600887	伊利股份	401,300	9,615,148.00	0.65
31	002371	北方华创	10,800	9,553,248.00	0.64
32	002415	海康威视	277,300	9,483,660.00	0.64
33	688981	中芯国际	58,014	9,213,783.48	0.62
34	300274	阳光电源	56,000	8,905,120.00	0.60
35	600809	山西汾酒	81,300	8,891,781.00	0.60
36	002475	立讯精密	123,900	8,722,560.00	0.59
37	002916	深南电路	19,000	8,700,100.00	0.59
38	002028	思源电气	49,200	8,511,600.00	0.57
39	600886	国投电力	634,300	8,442,533.00	0.57
40	603799	华友钴业	174,400	8,416,544.00	0.57
41	688012	中微公司	17,963	8,415,665.50	0.57
42	300014	亿纬锂能	126,300	8,213,289.00	0.55
43	600029	南方航空	1,563,741	8,100,178.38	0.55
44	600489	中金黄金	441,900	7,976,295.00	0.54
45	603259	药明康德	64,000	7,968,640.00	0.54
46	601899	紫金矿业	315,200	7,924,128.00	0.53
47	688008	澜起科技	25,555	7,919,494.50	0.53

48	600588	用友网络	860,900	7,903,062.00	0.53
49	000568	泸州老窖	101,500	7,868,280.00	0.53
50	300033	同花顺	30,620	7,379,420.00	0.50
51	000538	云南白药	153,900	7,290,243.00	0.49
52	000625	长安汽车	986,700	7,074,639.00	0.48
53	000425	徐工机械	872,300	7,056,907.00	0.48
54	000657	中钨高新	73,500	7,035,420.00	0.47
55	601138	工业富联	97,400	7,027,410.00	0.47
56	601985	中国核电	773,800	6,987,414.00	0.47
57	601009	南京银行	696,400	6,887,396.00	0.46
58	002600	领益智造	393,900	6,830,226.00	0.46
59	600176	中国巨石	91,200	6,646,656.00	0.45
60	601766	中国中车	1,264,200	6,573,840.00	0.44
61	001979	招商蛇口	993,912	6,390,854.16	0.43
62	300476	胜宏科技	18,400	6,374,312.00	0.43
63	600362	江西铜业	144,600	6,261,180.00	0.42
64	002463	沪电股份	40,300	6,157,840.00	0.42
65	601600	中国铝业	731,700	6,014,574.00	0.41
66	600050	中国联通	1,498,000	5,992,000.00	0.40
67	300498	温氏股份	472,800	5,824,896.00	0.39
68	601872	招商轮船	309,300	5,434,401.00	0.37
69	600919	江苏银行	493,900	5,324,242.00	0.36
70	603993	洛阳钼业	303,000	5,317,650.00	0.36
71	601838	成都银行	289,900	5,131,230.00	0.35
72	600926	杭州银行	346,600	5,008,370.00	0.34
73	000725	京东方 A	574,000	4,982,320.00	0.34
74	601816	京沪高铁	1,097,100	4,969,863.00	0.34
75	000792	盐湖股份	160,500	4,845,495.00	0.33
76	600027	华电国际	1,084,800	4,827,360.00	0.33
77	300418	昆仑万维	116,800	4,714,048.00	0.32
78	600309	万华化学	67,800	4,638,198.00	0.31
79	601117	中国化学	623,800	4,584,930.00	0.31
80	600031	三一重工	261,300	4,515,264.00	0.30
81	601127	赛力斯	72,786	4,458,142.50	0.30
82	300394	天孚通信	14,560	4,407,020.80	0.30
83	002602	世纪华通	311,900	4,397,790.00	0.30
84	002353	杰瑞股份	28,500	4,346,250.00	0.29
85	600674	川投能源	305,600	4,330,352.00	0.29
86	600584	长电科技	41,800	4,328,390.00	0.29
87	300124	汇川技术	64,500	4,278,285.00	0.29
88	600893	航发动力	109,800	4,209,732.00	0.28
89	600018	上港集团	890,300	4,202,216.00	0.28
90	600875	东方电气	145,900	4,197,543.00	0.28

91	002493	荣盛石化	378,700	4,071,025.00	0.27
92	688521	芯原股份	10,678	3,963,032.92	0.27
93	600741	华域汽车	255,200	3,960,704.00	0.27
94	000895	双汇发展	176,200	3,946,880.00	0.27
95	601058	赛轮轮胎	341,700	3,939,801.00	0.27
96	000338	潍柴动力	143,100	3,899,475.00	0.26
97	300803	指南针	42,000	3,850,140.00	0.26
98	002714	牧原股份	107,700	3,768,423.00	0.25
99	688183	生益电子	28,122	3,723,352.80	0.25
100	688072	拓荆科技	4,220	3,711,616.60	0.25
101	300059	东方财富	181,200	3,692,856.00	0.25
102	600115	中国东航	951,600	3,625,596.00	0.24
103	002179	中航光电	77,900	3,598,980.00	0.24
104	688396	华润微	36,117	3,523,213.35	0.24
105	002236	大华股份	211,963	3,495,269.87	0.24
106	601066	中信建投	118,200	3,436,074.00	0.23
107	300866	安克创新	32,600	3,406,700.00	0.23
108	600150	中国船舶	100,100	3,382,379.00	0.23
109	000963	华东医药	116,200	3,267,544.00	0.22
110	300661	圣邦股份	22,500	3,228,300.00	0.22
111	301165	锐捷网络	39,500	3,177,775.00	0.21
112	000807	云铝股份	139,500	3,088,530.00	0.21
113	600549	厦门钨业	35,700	3,041,640.00	0.21
114	603893	瑞芯微	15,200	2,863,072.00	0.19
115	000001	平安银行	283,900	2,853,195.00	0.19
116	002422	科伦药业	73,600	2,835,072.00	0.19
117	601100	恒立液压	25,900	2,785,804.00	0.19
118	600085	同仁堂	120,000	2,773,200.00	0.19
119	002532	天山铝业	257,900	2,767,267.00	0.19
120	000408	藏格矿业	38,800	2,689,616.00	0.18
121	000630	铜陵有色	419,100	2,665,476.00	0.18
122	600426	华鲁恒升	109,300	2,614,456.00	0.18
123	600196	复星医药	114,800	2,579,556.00	0.17
124	300433	蓝思科技	47,100	2,527,386.00	0.17
125	601916	浙商银行	950,400	2,499,552.00	0.17
126	600011	华能国际	316,800	2,404,512.00	0.16
127	002648	卫星化学	102,140	2,399,268.60	0.16
128	600219	南山铝业	592,300	2,363,277.00	0.16
129	688009	中国通号	494,381	2,353,253.56	0.16
130	603296	华勤技术	30,980	2,300,884.60	0.16
131	600028	中国石化	510,200	2,275,492.00	0.15
132	601857	中国石油	260,500	2,261,140.00	0.15
133	600482	中国动力	68,300	2,240,240.00	0.15

134	002938	鹏鼎控股	20,600	2,170,828.00	0.15
135	601211	国泰海通	116,800	2,125,760.00	0.14
136	600415	小商品城	199,400	2,025,904.00	0.14
137	600522	中天科技	32,900	1,996,372.00	0.13
138	600089	特变电工	88,200	1,984,500.00	0.13
139	600547	山东黄金	83,000	1,916,470.00	0.13
140	300450	先导智能	45,800	1,864,976.00	0.13
141	600660	福耀玻璃	36,300	1,830,972.00	0.12
142	301308	江波龙	2,600	1,829,880.00	0.12
143	688047	龙芯中科	11,735	1,815,052.45	0.12
144	000938	紫光股份	61,700	1,780,662.00	0.12
145	688472	阿特斯	161,891	1,751,660.62	0.12
146	002001	新 和 成	61,200	1,739,304.00	0.12
147	002202	金风科技	68,400	1,634,760.00	0.11
148	601225	陕西煤业	78,100	1,589,335.00	0.11
149	003816	中国广核	406,100	1,587,851.00	0.11
150	002558	巨人网络	56,400	1,554,384.00	0.10
151	600989	宝丰能源	76,400	1,553,212.00	0.10
152	300442	润泽科技	17,700	1,470,339.00	0.10
153	000708	中信特钢	116,200	1,466,444.00	0.10
154	601360	三六零	167,400	1,454,706.00	0.10
155	000157	中联重科	202,500	1,411,425.00	0.10
156	002074	国轩高科	50,700	1,394,757.00	0.09
157	600346	恒力石化	77,600	1,374,296.00	0.09
158	601012	隆基绿能	96,900	1,271,328.00	0.09
159	600515	海南机场	453,300	1,242,042.00	0.08
160	002594	比亚迪	14,900	1,187,530.00	0.08
161	002311	海大集团	26,500	1,182,165.00	0.08
162	000988	华工科技	6,400	1,181,504.00	0.08
163	300832	新产业	28,100	1,180,200.00	0.08
164	300628	亿联网络	34,000	1,149,880.00	0.08
165	601728	中国电信	221,400	1,149,066.00	0.08
166	002241	歌尔股份	50,800	1,144,524.00	0.08
167	000063	中兴通讯	31,100	1,125,509.00	0.08
168	600104	上汽集团	111,400	1,087,264.00	0.07
169	601006	大秦铁路	215,800	994,838.00	0.07
170	688036	传音控股	16,759	987,943.05	0.07
171	600026	中远海能	54,200	972,348.00	0.07
172	601607	上海医药	62,200	957,880.00	0.06
173	600406	国电南瑞	41,500	948,275.00	0.06
174	000596	古井贡酒	11,600	925,680.00	0.06
175	601877	正泰电器	34,200	857,394.00	0.06
176	688303	大全能源	48,414	843,856.02	0.06

177	600905	三峡能源	226,100	838,831.00	0.06
178	600039	四川路桥	99,200	775,744.00	0.05
179	002352	顺丰控股	24,400	762,744.00	0.05
180	000975	山金国际	43,100	732,700.00	0.05
181	002460	赣锋锂业	11,200	732,480.00	0.05
182	300896	爱美客	8,200	715,040.00	0.05
183	000002	万科 A	228,100	675,176.00	0.05
184	000301	东方盛虹	52,400	599,980.00	0.04
185	600460	士兰微	10,700	584,862.00	0.04
186	600438	通威股份	45,200	547,372.00	0.04
187	688223	晶科能源	71,262	338,494.50	0.02
188	600938	中国海油	11,000	298,650.00	0.02
189	603260	合盛硅业	4,821	232,661.46	0.02
190	600019	宝钢股份	38,600	209,598.00	0.01
191	001965	招商公路	17,600	161,216.00	0.01
192	601018	宁波港	46,300	145,845.00	0.01
193	605499	东鹏饮料	1,180	145,647.40	0.01
194	601021	春秋航空	2,900	132,182.00	0.01
195	000768	中航西飞	4,200	86,016.00	0.01
196	600372	中航机载	1,100	11,935.00	0.00
197	601601	中国太保	400	11,408.00	0.00
198	605117	德业股份	100	10,618.00	0.00
199	001280	中国铀业	95	6,336.50	0.00
200	600066	宇通客车	100	2,681.00	0.00
201	601059	信达证券	100	1,619.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688582	芯动联科	72,576	4,717,440.00	0.32
2	002913	奥士康	65,600	4,194,464.00	0.28
3	605218	伟时电子	227,500	3,760,575.00	0.25
4	301099	雅创电子	32,400	3,094,200.00	0.21
5	300615	欣天科技	299,900	3,007,997.00	0.20
6	300939	秋田微	42,400	2,934,080.00	0.20
7	002885	京泉华	68,800	2,811,168.00	0.19
8	688668	鼎通科技	7,355	2,745,621.50	0.19
9	000070	特发信息	127,300	2,652,932.00	0.18
10	300843	胜蓝股份	16,800	2,625,000.00	0.18
11	001287	中电港	83,600	2,604,140.00	0.18
12	301176	逸豪新材	35,200	2,393,600.00	0.16
13	300120	经纬辉开	211,100	2,391,763.00	0.16
14	600345	长江通信	35,900	2,351,809.00	0.16
15	601666	平煤股份	328,300	2,347,345.00	0.16

16	300570	太辰光	9,500	2,343,745.00	0.16
17	603341	龙旗科技	50,700	2,154,243.00	0.15
18	688329	艾隆科技	103,828	2,098,363.88	0.14
19	300736	百邦科技	67,200	2,083,200.00	0.14
20	603042	华脉科技	144,640	2,082,816.00	0.14
21	301108	洁雅股份	87,100	2,054,689.00	0.14
22	300655	晶瑞电材	95,000	2,034,900.00	0.14
23	002584	西陇科学	203,900	1,932,972.00	0.13
24	000032	深桑达 A	76,300	1,903,685.00	0.13
25	300077	国民技术	60,700	1,902,945.00	0.13
26	002897	意华股份	21,100	1,856,378.00	0.13
27	603519	立霸股份	120,300	1,840,590.00	0.12
28	300458	全志科技	46,000	1,815,160.00	0.12
29	600498	烽火通信	24,600	1,810,560.00	0.12
30	600455	博通股份	81,700	1,794,132.00	0.12
31	301177	迪阿股份	63,300	1,745,181.00	0.12
32	301123	奕东电子	14,200	1,714,224.00	0.12
33	300475	香农芯创	5,700	1,710,000.00	0.12
34	301205	联特科技	4,900	1,637,090.00	0.11
35	688718	唯赛勃	102,304	1,633,794.88	0.11
36	603999	读者传媒	325,800	1,629,000.00	0.11
37	600353	旭光电子	34,600	1,577,760.00	0.11
38	002993	奥海科技	22,000	1,575,420.00	0.11
39	603332	苏州龙杰	153,700	1,553,907.00	0.10
40	301536	星辰科技	12,000	1,544,520.00	0.10
41	600847	万里股份	111,100	1,498,739.00	0.10
42	003042	中农联合	122,500	1,488,375.00	0.10
43	002491	通鼎互联	45,500	1,474,200.00	0.10
44	688701	卓锦股份	191,407	1,441,294.71	0.10
45	603289	泰瑞机器	178,000	1,436,460.00	0.10
46	301337	亚华电子	49,400	1,373,320.00	0.09
47	002513	蓝丰生化	280,700	1,341,746.00	0.09
48	002861	瀛通通讯	59,900	1,334,572.00	0.09
49	001696	宗申动力	64,000	1,331,840.00	0.09
50	300894	火星人	104,200	1,308,752.00	0.09
51	603126	中材节能	206,400	1,300,320.00	0.09
52	002824	和胜股份	36,900	1,276,002.00	0.09
53	002809	红墙股份	170,400	1,267,776.00	0.09
54	605180	华生科技	106,300	1,259,655.00	0.09
55	000509	华塑控股	327,700	1,222,321.00	0.08
56	001360	南矿集团	67,000	1,185,230.00	0.08
57	002715	登云股份	88,900	1,177,925.00	0.08
58	000020	深华发 A	107,600	1,172,840.00	0.08

59	002655	共达电声	24,500	1,127,000.00	0.08
60	603738	泰晶科技	18,600	1,116,930.00	0.08
61	600714	金瑞矿业	53,900	1,106,567.00	0.07
62	000050	深天马 A	109,800	1,088,118.00	0.07
63	002345	潮宏基	116,700	1,070,139.00	0.07
64	600563	法拉电子	5,600	1,068,480.00	0.07
65	603897	长城科技	32,500	1,054,950.00	0.07
66	600356	恒丰纸业	141,100	1,045,551.00	0.07
67	603421	鼎信通讯	169,100	1,039,965.00	0.07
68	002811	郑中设计	92,700	1,037,313.00	0.07
69	002972	科安达	52,800	1,032,768.00	0.07
70	002057	中钢天源	82,200	1,021,746.00	0.07
71	688539	高华科技	32,002	1,020,223.76	0.07
72	301189	奥尼电子	17,300	1,019,489.00	0.07
73	605066	天正电气	149,900	1,017,821.00	0.07
74	300576	容大感光	19,700	1,009,034.00	0.07
75	603626	科森科技	53,800	995,300.00	0.07
76	002578	闽发铝业	314,700	991,305.00	0.07
77	002855	捷荣技术	104,300	990,850.00	0.07
78	605177	东亚药业	56,900	973,559.00	0.07
79	002888	惠威科技	44,100	969,318.00	0.07
80	600280	中央商场	356,800	938,384.00	0.06
81	603331	百达精工	86,700	924,222.00	0.06
82	300921	南凌科技	44,500	903,795.00	0.06
83	688061	灿瑞科技	18,077	897,884.59	0.06
84	300709	精研科技	15,900	894,375.00	0.06
85	300623	捷捷微电	19,600	881,804.00	0.06
86	603166	福达股份	64,900	867,713.00	0.06
87	002449	国星光电	111,100	861,025.00	0.06
88	001368	通达创智	41,400	851,598.00	0.06
89	300961	深水海纳	65,600	842,960.00	0.06
90	002412	汉森制药	151,400	832,700.00	0.06
91	002623	亚玛顿	53,300	832,546.00	0.06
92	603320	迪贝电气	47,000	820,150.00	0.06
93	003023	彩虹集团	41,600	808,704.00	0.05
94	605388	均瑶健康	166,800	805,644.00	0.05
95	002949	华阳国际	80,700	798,123.00	0.05
96	300882	万胜智能	46,800	775,944.00	0.05
97	001260	坤泰股份	49,500	774,675.00	0.05
98	001366	播恩集团	70,800	767,472.00	0.05
99	300481	濮阳惠成	39,200	745,584.00	0.05
100	002998	优彩资源	113,000	735,630.00	0.05
101	603697	有友食品	76,500	733,635.00	0.05

102	603172	万丰股份	42,500	698,275.00	0.05
103	002645	华宏科技	25,200	693,252.00	0.05
104	002188	中天服务	141,000	690,900.00	0.05
105	300571	平治信息	15,100	689,466.00	0.05
106	603326	我乐家居	110,500	680,680.00	0.05
107	603029	天鹅股份	48,300	679,098.00	0.05
108	002012	凯恩股份	105,700	677,537.00	0.05
109	301163	宏德股份	30,500	676,490.00	0.05
110	301251	威尔高	12,400	660,672.00	0.04
111	300548	长芯博创	2,300	639,400.00	0.04
112	600785	新华百货	65,240	639,352.00	0.04
113	600241	时代万恒	96,300	624,987.00	0.04
114	688367	工大高科	18,215	606,559.50	0.04
115	002712	思美传媒	142,900	593,035.00	0.04
116	300808	久量股份	26,700	591,672.00	0.04
117	301132	满坤科技	11,100	582,972.00	0.04
118	002760	凤形股份	35,300	579,626.00	0.04
119	300987	川网传媒	46,800	575,640.00	0.04
120	300263	隆华科技	34,800	567,240.00	0.04
121	002440	闰土股份	55,300	566,825.00	0.04
122	605007	五洲特纸	42,100	563,719.00	0.04
123	300606	金太阳	13,200	561,792.00	0.04
124	301028	鼎熔岩	34,900	557,004.00	0.04
125	601116	三江购物	56,400	556,668.00	0.04
126	601579	会稽山	37,500	550,875.00	0.04
127	301098	金埔园林	66,700	546,940.00	0.04
128	002130	沃尔核材	28,400	538,464.00	0.04
129	688273	麦澜德	13,491	522,641.34	0.04
130	001373	翔腾新材	17,300	521,595.00	0.04
131	300616	尚品宅配	49,900	519,958.00	0.04
132	002388	新亚制程	98,700	517,188.00	0.03
133	002805	丰元股份	17,900	511,761.00	0.03
134	600130	波导股份	114,900	509,007.00	0.03
135	000159	国际实业	93,500	503,030.00	0.03
136	002443	金洲管道	52,600	501,278.00	0.03
137	301198	喜悦智行	37,300	499,820.00	0.03
138	001248	华润新能源	49,116	496,562.76	0.03
139	603968	醋化股份	53,100	491,706.00	0.03
140	000695	滨海能源	39,200	490,000.00	0.03
141	600768	宁波富邦	32,300	483,854.00	0.03
142	002782	可立克	22,900	482,045.00	0.03
143	300679	电连技术	8,000	479,920.00	0.03
144	002780	三夫户外	39,000	473,460.00	0.03

145	003027	同兴科技	26,900	468,867.00	0.03
146	301373	凌玮科技	3,000	466,500.00	0.03
147	301666	大普微	976	452,210.08	0.03
148	603808	歌力思	58,900	445,873.00	0.03
149	003001	中岩大地	34,200	442,890.00	0.03
150	688793	倍轻松	27,153	437,434.83	0.03
151	002174	游族网络	33,900	427,479.00	0.03
152	688021	奥福科技	21,864	423,287.04	0.03
153	603182	嘉华股份	37,000	421,800.00	0.03
154	300726	宏达电子	4,900	414,393.00	0.03
155	603711	香飘飘	37,200	413,292.00	0.03
156	605080	浙江自然	21,300	410,238.00	0.03
157	688266	泽璟制药	3,499	408,193.34	0.03
158	301448	开创电气	8,800	399,344.00	0.03
159	301212	联盛化学	17,000	396,950.00	0.03
160	301032	新柴股份	42,500	395,250.00	0.03
161	000586	汇源通信	29,800	393,658.00	0.03
162	600395	盘江股份	83,900	382,584.00	0.03
163	001387	雪祺电气	29,900	381,823.00	0.03
164	600149	廊坊发展	85,000	381,650.00	0.03
165	000520	凤凰航运	100,300	374,119.00	0.03
166	603020	爱普股份	26,400	372,240.00	0.03
167	000952	广济药业	68,200	369,644.00	0.02
168	300959	线上线下	2,400	354,744.00	0.02
169	300787	海能实业	38,300	349,296.00	0.02
170	300590	移为通信	24,000	344,400.00	0.02
171	301285	鸿日达	3,100	342,023.00	0.02
172	002907	华森制药	25,600	339,712.00	0.02
173	002159	三特索道	27,400	338,938.00	0.02
174	688727	恒坤新材	4,399	329,045.20	0.02
175	002524	光正眼科	97,700	323,387.00	0.02
176	600319	亚星化学	51,900	323,337.00	0.02
177	301383	天键股份	13,500	322,650.00	0.02
178	688182	灿勤科技	7,329	315,660.03	0.02
179	000679	大连友谊	50,200	309,734.00	0.02
180	605567	春雪食品	37,600	300,424.00	0.02
181	300929	华骐环保	28,500	300,390.00	0.02
182	300319	麦捷科技	10,000	296,300.00	0.02
183	000733	振华科技	5,200	294,528.00	0.02
184	600493	凤竹纺织	56,000	293,440.00	0.02
185	300688	创业黑马	10,700	289,970.00	0.02
186	300713	英可瑞	22,000	280,280.00	0.02
187	301287	康力源	8,300	268,007.00	0.02

188	301638	南网数字	11,098	266,906.90	0.02
189	002927	泰永长征	13,500	262,575.00	0.02
190	601086	国芳集团	39,500	261,885.00	0.02
191	603755	日辰股份	11,500	260,935.00	0.02
192	002903	宇环数控	5,700	258,894.00	0.02
193	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
194	002800	天顺股份	19,500	253,305.00	0.02
195	300795	米奥会展	29,200	249,952.00	0.02
196	002866	传艺科技	15,100	246,885.00	0.02
197	301515	港通医疗	14,000	245,420.00	0.02
198	301025	读客文化	31,100	241,336.00	0.02
199	600561	江西长运	48,400	239,580.00	0.02
200	603931	格林达	4,000	237,600.00	0.02
201	603057	紫燕食品	10,600	236,380.00	0.02
202	605258	协和电子	6,900	233,772.00	0.02
203	600792	云煤能源	72,000	228,240.00	0.02
204	002064	华峰化学	24,000	227,760.00	0.02
205	001376	百通能源	21,400	222,560.00	0.02
206	688681	科汇股份	15,856	221,666.88	0.01
207	300513	恒实科技	30,400	220,096.00	0.01
208	601616	广电电气	64,000	218,240.00	0.01
209	000968	蓝焰控股	35,500	212,645.00	0.01
210	002802	洪汇新材	19,500	205,140.00	0.01
211	600232	金鹰股份	32,000	201,600.00	0.01
212	688038	中科通达	11,597	195,061.54	0.01
213	603578	三星新材	15,800	185,650.00	0.01
214	002771	真视通	14,900	182,972.00	0.01
215	002862	实丰文化	14,000	179,620.00	0.01
216	002367	康力电梯	25,900	178,969.00	0.01
217	002766	索菱股份	50,000	176,500.00	0.01
218	002745	木林森	13,800	173,190.00	0.01
219	300834	星辉环材	4,100	171,380.00	0.01
220	603536	惠发食品	21,800	169,822.00	0.01
221	000995	皇台酒业	17,800	169,100.00	0.01
222	301227	森鹰窗业	6,700	168,907.00	0.01
223	603989	艾华集团	3,200	168,000.00	0.01
224	002686	亿利达	31,400	161,710.00	0.01
225	002857	三晖电气	9,200	161,644.00	0.01
226	001217	华尔泰	19,100	161,013.00	0.01
227	001399	惠科股份	5,780	160,279.40	0.01
228	300610	晨化股份	16,400	159,900.00	0.01
229	002678	珠江钢琴	37,500	158,625.00	0.01
230	002350	北京科锐	11,700	158,067.00	0.01

231	603960	克来机电	9,000	156,690.00	0.01
232	001278	一彬科技	10,100	155,338.00	0.01
233	300603	立昂技术	20,200	154,934.00	0.01
234	600359	新农开发	27,800	150,120.00	0.01
235	300514	友讯达	16,000	149,600.00	0.01
236	300565	科信技术	14,600	148,628.00	0.01
237	300907	康平科技	2,600	145,600.00	0.01
238	605058	澳弘电子	4,000	144,640.00	0.01
239	688820	盛合晶微	943	133,425.07	0.01
240	002877	智能自控	18,500	130,240.00	0.01
241	000811	冰轮环境	2,300	129,306.00	0.01
242	600189	泉阳泉	16,700	125,751.00	0.01
243	000758	中色股份	19,100	125,487.00	0.01
244	002125	湘潭电化	9,100	124,306.00	0.01
245	300916	朗特智能	5,300	123,861.00	0.01
246	600463	空港股份	16,100	122,843.00	0.01
247	002313	日海智能	16,100	117,852.00	0.01
248	002442	龙星科技	22,700	111,911.00	0.01
249	301568	思泰克	1,000	111,600.00	0.01
250	603096	新经典	7,800	104,364.00	0.01
251	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
252	002763	汇洁股份	14,200	96,418.00	0.01
253	603819	神力股份	8,400	96,180.00	0.01
254	300839	博汇股份	8,200	96,022.00	0.01
255	301682	宏明电子	579	92,674.74	0.01
256	603176	汇通集团	21,600	92,448.00	0.01
257	002999	天禾股份	16,800	89,376.00	0.01
258	688818	电科蓝天	1,273	89,288.22	0.01
259	301380	挖金客	3,000	82,770.00	0.01
260	603073	彩蝶实业	5,200	77,532.00	0.01
261	002494	华斯股份	16,700	74,148.00	0.01
262	002723	小崧股份	8,000	70,720.00	0.00
263	301024	霍普股份	1,900	69,958.00	0.00
264	300964	本川智能	800	68,936.00	0.00
265	000506	招金黄金	5,800	67,976.00	0.00
266	600828	茂业商业	18,500	66,230.00	0.00
267	300614	百川畅银	6,800	65,824.00	0.00
268	300909	汇创达	1,100	64,042.00	0.00
269	300597	吉大通信	9,000	63,720.00	0.00
270	301010	晶雪节能	3,700	60,273.00	0.00
271	603214	爱婴室	4,700	56,917.00	0.00
272	688781	视涯科技	1,156	55,037.16	0.00
273	300637	扬帆新材	5,200	53,976.00	0.00

274	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
275	301203	国泰环保	1,200	50,700.00	0.00
276	003003	天元股份	5,000	49,750.00	0.00
277	688286	敏芯股份	430	49,480.10	0.00
278	688785	恒运昌	106	49,093.90	0.00
279	301372	科净源	1,400	44,114.00	0.00
280	002627	三峡旅游	7,600	43,396.00	0.00
281	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
282	301388	欣灵电气	1,700	39,644.00	0.00
283	603633	徕木股份	5,600	38,136.00	0.00
284	603798	康普顿	2,700	36,936.00	0.00
285	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
286	301507	民生健康	3,000	36,090.00	0.00
287	688288	鸿泉技术	2,027	36,019.79	0.00
288	688077	大地熊	1,343	35,576.07	0.00
289	002692	远程股份	9,400	35,438.00	0.00
290	605001	威奥股份	6,500	35,425.00	0.00
291	301020	密封科技	1,600	34,944.00	0.00
292	603700	宁水集团	2,900	33,669.00	0.00
293	603919	金徽酒	2,200	33,110.00	0.00
294	002591	恒大高新	5,400	33,048.00	0.00
295	601858	中国科传	1,900	32,889.00	0.00
296	600703	三安光电	1,500	31,830.00	0.00
297	000788	北大医药	6,200	30,256.00	0.00
298	002743	富煌钢构	7,700	29,722.00	0.00
299	300784	利安科技	700	29,659.00	0.00
300	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
301	002863	今飞凯达	6,100	25,864.00	0.00
302	603048	浙江黎明	1,400	24,836.00	0.00
303	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
304	688310	迈得医疗	1,427	21,932.99	0.00
305	603023	威帝股份	5,800	21,634.00	0.00
306	001282	三联锻造	1,000	20,380.00	0.00
307	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
308	002724	海洋王	3,900	18,915.00	0.00
309	603028	赛福天	2,900	18,763.00	0.00
310	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
311	002716	湖南白银	2,300	18,607.00	0.00
312	300422	博世科	4,300	18,103.00	0.00
313	300842	帝科股份	200	17,834.00	0.00
314	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
315	301113	雅艺科技	1,100	16,401.00	0.00
316	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

317	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
318	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
319	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
320	301129	瑞纳智能	700	14,609.00	0.00
321	603022	新通联	1,800	14,382.00	0.00
322	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
323	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
324	603880	南卫股份	1,800	12,708.00	0.00
325	002056	横店东磁	400	12,192.00	0.00
326	603283	赛腾股份	150	12,147.00	0.00
327	300013	新宁物流	3,000	11,700.00	0.00
328	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
329	605166	聚合顺	1,200	11,508.00	0.00
330	002459	晶澳科技	1,400	11,340.00	0.00
331	300118	东方日升	900	11,205.00	0.00
332	301056	森赫股份	1,000	11,200.00	0.00
333	002951	金时科技	800	10,688.00	0.00
334	002876	三利谱	300	10,563.00	0.00
335	300323	华灿光电	500	10,200.00	0.00
336	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
337	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
338	601700	风范股份	2,300	10,028.00	0.00
339	300992	泰福泵业	400	9,972.00	0.00
340	603285	键邦股份	200	8,962.00	0.00
341	301045	天禄科技	100	8,908.00	0.00
342	600470	六国化工	1,500	8,700.00	0.00
343	300031	宝通科技	300	8,571.00	0.00
344	002067	景兴纸业	2,200	8,096.00	0.00
345	603679	华体科技	400	8,072.00	0.00
346	002747	埃斯顿	200	7,466.00	0.00
347	002725	跃岭股份	600	7,392.00	0.00
348	600531	豫光金铅	500	7,380.00	0.00
349	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
350	688755	汉邦科技	264	7,275.84	0.00
351	002757	南兴股份	400	7,220.00	0.00
352	600593	大连圣亚	200	7,206.00	0.00
353	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
354	002788	鹭燕医药	700	7,021.00	0.00
355	002515	金字火腿	700	7,007.00	0.00
356	603321	梅轮电梯	1,200	6,864.00	0.00
357	601112	振石股份	390	6,860.10	0.00
358	300588	熙菱信息	300	6,768.00	0.00
359	002375	亚厦股份	2,000	6,760.00	0.00

360	600391	航发科技	200	6,690.00	0.00
361	001316	润贝航科	200	6,596.00	0.00
362	300711	广哈通信	400	6,560.00	0.00
363	003019	宸展光电	200	6,510.00	0.00
364	300855	图南股份	200	6,252.00	0.00
365	300977	深圳瑞捷	400	6,168.00	0.00
366	603218	日月股份	600	6,132.00	0.00
367	300982	苏文电能	400	6,044.00	0.00
368	002454	松芝股份	1,200	5,736.00	0.00
369	603937	丽岛新材	400	5,608.00	0.00
370	300332	天壕能源	1,300	5,590.00	0.00
371	301636	泽润新能	128	5,390.08	0.00
372	300798	锦鸡股份	800	5,224.00	0.00
373	603078	江化微	100	4,942.00	0.00
374	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
375	688455	科捷智能	247	4,609.02	0.00
376	002307	北新路桥	1,600	4,608.00	0.00
377	002930	宏川智慧	500	4,600.00	0.00
378	002114	罗平锌电	600	4,338.00	0.00
379	002775	文科股份	1,200	4,092.00	0.00
380	605055	迎丰股份	400	4,080.00	0.00
381	002796	世嘉科技	100	4,078.00	0.00
382	600382	广东明珠	600	4,038.00	0.00
383	603225	新凤鸣	200	3,930.00	0.00
384	688280	精进电动	706	3,875.94	0.00
385	603698	航天工程	100	3,856.00	0.00
386	002397	梦洁股份	1,000	3,820.00	0.00
387	002420	毅昌科技	700	3,808.00	0.00
388	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.00
389	301428	世纪恒通	100	3,457.00	0.00
390	301048	金鹰重工	400	3,444.00	0.00
391	300658	延江股份	300	3,429.00	0.00
392	603978	深圳新星	100	3,143.00	0.00
393	300687	赛意信息	100	3,100.00	0.00
394	603683	晶华新材	100	3,082.00	0.00
395	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
396	002774	快意电梯	200	2,842.00	0.00
397	603709	中源家居	200	2,708.00	0.00
398	301126	达嘉维康	300	2,565.00	0.00
399	301449	天溯计量	64	2,476.80	0.00
400	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
401	300286	安科瑞	100	2,415.00	0.00
402	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

403	002054	德美化工	300	1,995.00	0.00
404	603050	科林电气	100	1,956.00	0.00
405	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
406	300796	贝斯美	300	1,887.00	0.00
407	603058	永吉股份	200	1,742.00	0.00
408	002830	名雕股份	100	1,729.00	0.00
409	600865	百大集团	200	1,638.00	0.00
410	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
411	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
412	002795	永和智控	200	1,338.00	0.00
413	000421	南京公用	100	496.00	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	57,824,806.39	13.75
2	300308	中际旭创	51,074,967.00	12.14
3	300750	宁德时代	50,680,798.00	12.05
4	600036	招商银行	50,245,471.36	11.94
5	000651	格力电器	45,743,795.50	10.87
6	601166	兴业银行	37,102,350.80	8.82
7	300502	新易盛	35,269,460.00	8.38
8	601919	中远海控	34,680,385.00	8.24
9	600460	士兰微	34,379,837.00	8.17
10	600030	中信证券	34,134,810.00	8.11
11	600999	招商证券	32,772,699.00	7.79
12	688008	澜起科技	30,641,802.13	7.28
13	000983	山西焦煤	30,322,570.60	7.21
14	600000	浦发银行	29,736,064.00	7.07
15	601899	紫金矿业	29,611,613.50	7.04
16	601995	中金公司	29,081,674.00	6.91
17	601728	中国电信	27,141,717.00	6.45
18	601766	中国中车	26,874,528.00	6.39
19	000938	紫光股份	26,608,016.70	6.33
20	300394	天孚通信	26,515,692.00	6.30
21	600522	中天科技	26,370,841.00	6.27
22	600276	恒瑞医药	26,240,879.84	6.24
23	603259	药明康德	26,006,866.00	6.18
24	601988	中国银行	25,371,534.60	6.03
25	002463	沪电股份	25,212,359.00	5.99
26	002475	立讯精密	24,940,494.34	5.93
27	688256	寒武纪	24,366,484.98	5.79
28	300059	东方财富	24,097,361.00	5.73

29	300661	圣邦股份	24,059,211.00	5.72
30	002371	北方华创	23,466,293.10	5.58
31	601138	工业富联	23,385,175.00	5.56
32	600183	生益科技	23,292,012.00	5.54
33	002384	东山精密	23,122,212.00	5.50
34	688012	中微公司	22,900,222.69	5.44
35	600900	长江电力	22,687,458.00	5.39
36	002049	紫光国微	22,539,336.69	5.36
37	603288	海天味业	22,351,668.32	5.31
38	300274	阳光电源	22,091,361.16	5.25
39	600196	复星医药	21,478,675.24	5.11
40	603986	兆易创新	20,816,759.00	4.95
41	600584	长电科技	20,542,522.00	4.88
42	002600	领益智造	20,540,354.00	4.88
43	600150	中国船舶	20,358,887.61	4.84
44	600176	中国巨石	20,244,689.00	4.81
45	002714	牧原股份	20,132,549.00	4.79
46	603296	华勤技术	19,495,710.00	4.63
47	002415	海康威视	19,436,331.00	4.62
48	300476	胜宏科技	19,218,001.13	4.57
49	601600	中国铝业	19,118,228.00	4.54
50	002028	思源电气	18,906,343.00	4.49
51	000776	广发证券	18,853,226.00	4.48
52	600887	伊利股份	18,665,986.00	4.44
53	601088	中国神华	18,634,843.00	4.43
54	688981	中芯国际	18,465,889.35	4.39
55	002709	天赐材料	18,275,788.38	4.34
56	300316	晶盛机电	18,202,065.00	4.33
57	603993	洛阳钼业	18,097,766.00	4.30
58	000063	中兴通讯	18,007,973.00	4.28
59	000100	TCL 科技	17,660,011.00	4.20
60	002001	新 和 成	17,293,194.56	4.11
61	002074	国轩高科	17,133,170.00	4.07
62	600690	海尔智家	17,085,360.00	4.06
63	300014	亿纬锂能	17,051,861.49	4.05
64	600025	华能水电	16,959,283.00	4.03
65	601229	上海银行	16,819,185.00	4.00
66	601688	华泰证券	16,774,867.00	3.99
67	000999	华润三九	16,025,824.60	3.81
68	601857	中国石油	15,994,467.00	3.80
69	601916	浙商银行	15,981,755.00	3.80
70	300498	温氏股份	15,608,013.00	3.71
71	601117	中国化学	15,581,766.00	3.70

72	300124	汇川技术	15,538,322.00	3.69
73	600489	中金黄金	15,457,829.00	3.67
74	000630	铜陵有色	15,412,265.00	3.66
75	002916	深南电路	15,399,759.00	3.66
76	000977	浪潮信息	15,191,608.00	3.61
77	000895	双汇发展	15,127,544.00	3.60
78	300408	三环集团	15,078,417.00	3.58
79	600309	万华化学	14,805,970.00	3.52
80	600938	中国海油	14,795,684.00	3.52
81	603799	华友钴业	14,640,922.00	3.48
82	002352	顺丰控股	14,630,063.00	3.48
83	601111	中国国航	14,504,281.00	3.45
84	600893	航发动力	14,482,566.00	3.44
85	000657	中钨高新	14,439,453.00	3.43
86	300442	润泽科技	14,297,218.00	3.40
87	000333	美的集团	14,029,144.00	3.34
88	000725	京东方 A	13,931,921.00	3.31
89	688082	盛美上海	13,929,929.19	3.31
90	600588	用友网络	13,918,654.60	3.31
91	002179	中航光电	13,876,540.00	3.30
92	300033	同花顺	13,798,803.00	3.28
93	000338	潍柴动力	13,654,895.00	3.25
94	601658	邮储银行	13,642,552.00	3.24
95	601838	成都银行	13,535,259.00	3.22
96	605117	德业股份	13,449,417.00	3.20
97	600104	上汽集团	13,309,054.00	3.16
98	300418	昆仑万维	13,201,615.00	3.14
99	300866	安克创新	13,179,919.00	3.13
100	002422	科伦药业	13,156,435.00	3.13
101	002648	卫星化学	12,946,905.60	3.08
102	600188	兖矿能源	12,822,837.72	3.05
103	688041	海光信息	12,784,167.04	3.04
104	601009	南京银行	12,783,113.00	3.04
105	300759	康龙化成	12,778,333.00	3.04
106	600886	国投电力	12,625,267.00	3.00
107	002460	赣锋锂业	12,566,267.00	2.99
108	000568	泸州老窖	12,466,943.00	2.96
109	601066	中信建投	12,112,628.00	2.88
110	601872	招商轮船	11,849,321.00	2.82
111	002938	鹏鼎控股	11,675,292.00	2.78
112	688126	沪硅产业	11,669,402.66	2.77
113	688396	华润微	11,425,118.88	2.72
114	600941	中国移动	11,372,113.00	2.70

115	603019	中科曙光	11,341,937.00	2.70
116	600875	东方电气	11,328,081.00	2.69
117	603260	合盛硅业	11,160,496.55	2.65
118	600048	保利发展	11,081,019.00	2.63
119	000768	中航西飞	11,033,051.00	2.62
120	601898	中煤能源	11,026,744.13	2.62
121	002736	国信证券	11,024,164.00	2.62
122	300782	卓胜微	10,976,916.00	2.61
123	300628	亿联网络	10,930,809.60	2.60
124	002466	天齐锂业	10,820,898.00	2.57
125	600026	中远海能	10,760,930.00	2.56
126	600989	宝丰能源	10,667,373.00	2.54
127	600029	南方航空	10,540,041.40	2.51
128	002236	大华股份	10,507,432.14	2.50
129	600482	中国动力	10,369,679.00	2.47
130	600926	杭州银行	10,310,204.00	2.45
131	300803	指南针	10,244,208.00	2.44
132	600011	华能国际	10,213,245.00	2.43
133	600674	川投能源	10,081,146.00	2.40
134	601939	建设银行	9,979,261.15	2.37
135	000425	徐工机械	9,933,845.00	2.36
136	601127	赛力斯	9,834,590.62	2.34
137	600845	宝信软件	9,801,775.42	2.33
138	001979	招商蛇口	9,736,478.76	2.31
139	601006	大秦铁路	9,711,829.00	2.31
140	600023	浙能电力	9,697,304.00	2.31
141	000792	盐湖股份	9,608,253.00	2.28
142	688472	阿特斯	9,521,652.74	2.26
143	600018	上港集团	9,473,222.48	2.25
144	600809	山西汾酒	9,407,506.00	2.24
145	603893	瑞芯微	9,383,445.00	2.23
146	003816	中国广核	9,340,030.00	2.22
147	600406	国电南瑞	9,312,131.00	2.21
148	600362	江西铜业	9,312,060.00	2.21
149	600115	中国东航	9,239,920.00	2.20
150	601881	中国银河	9,165,133.00	2.18
151	600027	华电国际	9,122,630.00	2.17
152	600031	三一重工	9,048,409.00	2.15
153	002459	晶澳科技	9,004,443.00	2.14
154	688047	龙芯中科	8,904,543.96	2.12
155	000807	云铝股份	8,828,365.00	2.10
156	601669	中国电建	8,749,930.00	2.08
157	688668	鼎通科技	8,494,811.68	2.02

158	600426	华鲁恒升	8,452,221.00	2.01
-----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	46,025,463.50	10.94
2	600460	士兰微	38,383,565.00	9.12
3	600522	中天科技	34,405,684.07	8.18
4	688008	澜起科技	30,935,975.85	7.35
5	300750	宁德时代	28,285,902.00	6.72
6	000983	山西焦煤	28,076,476.20	6.67
7	600519	贵州茅台	27,670,723.60	6.58
8	601899	紫金矿业	27,394,396.80	6.51
9	300394	天孚通信	26,730,498.00	6.35
10	601728	中国电信	26,708,718.00	6.35
11	600584	长电科技	26,333,528.00	6.26
12	601919	中远海控	26,212,119.40	6.23
13	000938	紫光股份	25,949,726.00	6.17
14	000725	京东方 A	24,433,918.00	5.81
15	603288	海天味业	24,390,662.34	5.80
16	300661	圣邦股份	23,565,250.46	5.60
17	603259	药明康德	21,612,825.95	5.14
18	600188	兖矿能源	21,179,474.18	5.03
19	002463	沪电股份	20,792,451.00	4.94
20	688012	中微公司	20,437,241.74	4.86
21	002371	北方华创	20,304,085.65	4.83
22	002709	天赐材料	19,909,218.75	4.73
23	601766	中国中车	19,843,632.00	4.72
24	300316	晶盛机电	19,533,601.00	4.64
25	002475	立讯精密	19,324,184.00	4.59
26	601066	中信建投	18,957,853.22	4.51
27	300059	东方财富	18,908,620.00	4.49
28	600150	中国船舶	18,648,145.33	4.43
29	600176	中国巨石	18,326,871.00	4.36
30	603296	华勤技术	18,217,022.00	4.33
31	688256	寒武纪	18,060,748.21	4.29
32	000100	TCL 科技	17,982,306.00	4.27
33	000977	浪潮信息	17,794,842.00	4.23
34	300502	新易盛	17,654,739.40	4.20
35	600196	复星医药	17,620,044.00	4.19
36	600938	中国海油	17,552,865.00	4.17
37	601088	中国神华	17,533,167.00	4.17
38	600887	伊利股份	17,439,375.00	4.15

39	002384	东山精密	17,405,159.00	4.14
40	000063	中兴通讯	17,403,573.00	4.14
41	601318	中国平安	17,323,084.00	4.12
42	002001	新 和 成	16,947,854.44	4.03
43	600372	中航机载	16,674,944.70	3.96
44	002074	国轩高科	16,228,273.59	3.86
45	601138	工业富联	16,153,128.00	3.84
46	603986	兆易创新	16,040,645.00	3.81
47	688981	中芯国际	16,036,775.00	3.81
48	688126	沪硅产业	15,889,871.56	3.78
49	002714	牧原股份	15,606,733.00	3.71
50	000999	华润三九	15,543,754.56	3.70
51	601857	中国石油	15,473,800.00	3.68
52	002600	领益智造	15,384,688.00	3.66
53	605117	德业股份	15,380,913.40	3.66
54	688082	盛美上海	15,099,235.62	3.59
55	601166	兴业银行	14,699,210.00	3.49
56	000338	潍柴动力	14,527,102.00	3.45
57	600183	生益科技	14,420,285.00	3.43
58	002648	卫星化学	14,415,350.00	3.43
59	300274	阳光电源	14,271,983.00	3.39
60	600036	招商银行	14,248,759.00	3.39
61	000630	铜陵有色	14,199,803.00	3.38
62	000333	美的集团	14,119,108.28	3.36
63	601898	中煤能源	14,070,853.59	3.34
64	601916	浙商银行	14,023,556.00	3.33
65	300476	胜宏科技	14,019,617.95	3.33
66	688396	华润微	13,888,773.11	3.30
67	300782	卓胜微	13,883,993.43	3.30
68	300308	中际旭创	13,564,329.00	3.22
69	002352	顺丰控股	13,555,506.00	3.22
70	600893	航发动力	13,392,679.00	3.18
71	300759	康龙化成	13,350,092.00	3.17
72	300498	温氏股份	13,090,012.00	3.11
73	601988	中国银行	13,036,468.00	3.10
74	002460	赣锋锂业	12,977,936.55	3.09
75	600482	中国动力	12,804,994.00	3.04
76	300442	润泽科技	12,748,557.00	3.03
77	601939	建设银行	12,648,664.35	3.01
78	002422	科伦药业	12,580,117.00	2.99
79	603993	洛阳钼业	12,398,309.00	2.95
80	002179	中航光电	11,960,064.78	2.84
81	000895	双汇发展	11,864,865.00	2.82

82	600000	浦发银行	11,654,703.00	2.77
83	603260	合盛硅业	11,641,275.00	2.77
84	002466	天齐锂业	11,631,968.00	2.77
85	600104	上汽集团	11,601,017.00	2.76
86	300628	亿联网络	11,572,891.20	2.75
87	600309	万华化学	11,444,876.50	2.72
88	600160	巨化股份	11,380,430.33	2.71
89	601995	中金公司	11,285,511.00	2.68
90	000768	中航西飞	11,275,377.20	2.68
91	601600	中国铝业	11,204,467.00	2.66
92	600023	浙能电力	11,127,182.00	2.65
93	600026	中远海能	11,115,515.00	2.64
94	600941	中国移动	10,992,692.00	2.61
95	603019	中科曙光	10,935,528.00	2.60
96	600276	恒瑞医药	10,851,919.00	2.58
97	601838	成都银行	10,848,101.00	2.58
98	002736	国信证券	10,839,372.00	2.58
99	601117	中国化学	10,756,028.00	2.56
100	300866	安克创新	10,613,100.00	2.52
101	000786	北新建材	10,365,514.00	2.46
102	002938	鹏鼎控股	10,351,859.17	2.46
103	600048	保利发展	10,276,354.00	2.44
104	300014	亿纬锂能	10,247,715.06	2.44
105	600406	国电南瑞	10,245,643.00	2.44
106	002459	晶澳科技	10,226,093.00	2.43
107	601009	南京银行	10,216,763.00	2.43
108	000975	山金国际	10,148,832.00	2.41
109	600989	宝丰能源	9,931,412.00	2.36
110	300124	汇川技术	9,920,108.00	2.36
111	002916	深南电路	9,913,303.00	2.36
112	300548	长芯博创	9,859,699.00	2.34
113	002028	思源电气	9,848,109.00	2.34
114	600900	长江电力	9,710,535.00	2.31
115	002415	海康威视	9,316,427.00	2.21
116	600845	宝信软件	9,288,119.26	2.21
117	300408	三环集团	9,248,414.00	2.20
118	600030	中信证券	9,226,526.00	2.19
119	601825	沪农商行	9,038,773.00	2.15
120	300418	昆仑万维	8,928,650.00	2.12
121	601058	赛轮轮胎	8,737,062.00	2.08
122	600926	杭州银行	8,634,708.36	2.05
123	601669	中国电建	8,611,116.00	2.05
124	600111	北方稀土	8,482,319.00	2.02

125	600011	华能国际	8,413,809.00	2.00
-----	--------	------	--------------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,670,351,888.29
卖出股票收入（成交）总额	3,764,378,806.91

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	12,649,285.90	0.85
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	12,649,285.90	0.85

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	85,000	8,607,316.58	0.58
2	019792	25 国债 19	40,000	4,041,969.32	0.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。兴业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。

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	1,240,344.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,047,590.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,287,934.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧沪深 300 指数量化增强 A	20,160	40,178.37	180,214,788.07	22.25%	629,781,188.00	77.75%
中欧沪深 300 指数量化增强 C	16,233	16,566.32	122,236,921.92	45.45%	146,684,221.64	54.55%
合计	36,393	29,646.28	302,451,709.99	28.03%	776,465,409.64	71.97%

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	中欧沪深 300 指数量化增强 A	3,656,508.03	0.45%
	中欧沪深 300 指数量化增强 C	65,992.08	0.02%
	合计	3,722,500.11	0.35%

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、	中欧沪深 300 指数量化增强	10~50

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	A	
	中欧沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧沪深 300 指数量化增强 A	10~50
	中欧沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧沪深 300 指数量化增强 A	中欧沪深 300 指数量化增强 C
基金合同生效日 (2024 年 11 月 29 日) 基金份额总额	178, 155, 713. 27	349, 736, 241. 48
本报告期期初基金份额总额	261, 494, 255. 29	76, 205, 878. 67
本报告期基金总申购份额	1, 185, 671, 274. 46	449, 415, 490. 86
减：本报告期基金总赎回份额	637, 169, 553. 68	256, 700, 225. 97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	809, 995, 976. 07	268, 921, 143. 56

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动
本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大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 (%)	
财通证券	3	4,245,216,059.38	50.35	576,934.62	50.35	-
方正证券	3	4,186,817,200.59	49.65	569,012.65	49.65	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-

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 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	7,054,182.37	100.00	251,180,000.00	100.00	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
4	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理	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