

中欧互通精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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 盈利投资者数量占比	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧互通精选混合型证券投资基金	
基金简称	中欧互通精选混合	
基金主代码	166007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 8 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	23,328,117.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧互通精选混合 A	中欧互通精选混合 E
下属分级基金的场内简称	中欧互通	—
下属分级基金的交易代码	166007	001884
报告期末下属分级基金的份额总额	22,935,611.62 份	392,505.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将参照以 MSCI 中国 A 股国际通指数为主要标准配置基金资产，投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股的比重在 20 个交易日内不持续低于组合中股票市值的 70%。对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
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。

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	A 类：中国证券登记结算有限责任公司 E 类：中欧基金管理有限公司	A 类：北京市西城区太平桥大街 17 号 E 类：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)	
	中欧互通精选混合 A	中欧互通精选混合 E
本期已实现收益	6,124,084.20	113,408.69
本期利润	2,220,592.40	38,104.97
加权平均基金份额 本期利润	0.0935	0.0868
本期加权平均净 值利润率	4.36%	4.03%
本期基金份额净 值增长率	4.32%	4.32%
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	26,462,135.19	456,698.11
期末可供分配基金份额利润	1.1538	1.1635
期末基金资产净值	49,397,746.81	849,203.56
期末基金份额净值	2.1538	2.1635
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	112.91%	112.68%

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

中欧互通精选混合 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	5.75%	1.08%	9.51%	1.04%	-3.76%	0.04%
过去六个月	4.32%	1.05%	6.53%	0.94%	-2.21%	0.11%
过去一年	22.88%	0.96%	21.16%	0.83%	1.72%	0.13%
过去三年	40.18%	1.06%	23.34%	0.90%	16.84%	0.16%
过去五年	9.66%	1.06%	-1.85%	0.89%	11.51%	0.17%
过去七年	93.32%	1.11%	34.46%	0.93%	58.86%	0.18%
自基金转型生效起至今	112.91%	1.15%	47.52%	0.96%	65.39%	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

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。

中欧互通精选混合 E

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	5.75%	1.08%	9.51%	1.04%	-3.76%	0.04%
过去六个月	4.32%	1.05%	6.53%	0.94%	-2.21%	0.11%
过去一年	22.88%	0.96%	21.16%	0.83%	1.72%	0.13%
过去三年	39.55%	1.06%	23.34%	0.90%	16.21%	0.16%
过去五年	9.17%	1.05%	-1.85%	0.89%	11.02%	0.16%
过去七年	92.53%	1.11%	34.46%	0.93%	58.07%	0.18%
自基金转型生效起至今	112.68%	1.15%	47.52%	0.96%	65.16%	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。
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



注：自 2018 年 10 月 8 日起，原中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金转型为中欧互通精选混合型证券投资基金。图示为 2018 年 10 月 8 日至 2026 年 06 月 30 日。



注：自 2018 年 10 月 8 日起，原中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金转型为中欧互通精选混合型证券投资基金。图示为 2018 年 10 月 8 日至 2026 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理 / 基金经理助理	2021-11-03	-	10 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任分析师、基金经理助理。
赵子衡	基金经理 / 基金经	2024-04-23	-	4 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

	理助理				
徐熙宁	基金经理 / 基金经理助理	2026-03-09	-	3 年	2022-07-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济在温和通胀、政策积极支持的背景下平稳运行，呈现外需相对稳定、内需逐步恢复、新动能表现较好的特点，并在二季度进一步确认了温和复苏的方向，海外则始终

笼罩在不确定性之中，美伊冲突推升油价与美联储货币政策转鹰成为贯穿全程的两条外部压制线索，而国内层面 3 月 PPI 同比 41 个月来首次转正、企业盈利拐点显现；行业层面，年初能源与资源板块成为亮点，但 5 月以来随大宗价格高位回落而明显调整，电子、通信为代表的“新质生产力”持续领涨，消费板块则全程偏弱。

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。

本基金以 MSCI 中国 A 股国际通指数为主要标准配置基金资产，投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股的比重在 20 个交易日内不持续低于组合中股票市值的 70%，整体为高质量蓝筹风格。我们会持续跟踪市场风格因子特征，控制组合风险因子暴露，追求穿越周期的稳健超额。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 4.32%，同期业绩比较基准收益率为 6.53%；基金 E 类份额净值增长率为 4.32%，同期业绩比较基准收益率为 6.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席

指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，不存在损害本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本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

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：中欧互通精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	2,748,687.98	1,032,205.57
结算备付金		827,745.06	872,878.20
存出保证金		22,431.60	25,628.33
交易性金融资产	6.4.7.2	48,951,957.46	50,538,942.07
其中：股票投资		46,733,686.83	48,516,631.93
基金投资		-	-
债券投资		2,218,270.63	2,022,310.14
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		-	253,945.79
应收股利		-	-
应收申购款		5,865.55	1,024.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,556,687.65	52,724,624.01
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		1,980,083.27	-

应付清算款		183,986.34	238,235.22
应付赎回款		8,731.25	7,797.10
应付管理人报酬		49,564.35	52,456.92
应付托管费		8,260.72	8,742.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		76.28	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	79,035.07	102,803.23
负债合计		2,309,737.28	410,035.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	23,328,117.07	25,337,351.46
未分配利润	6.4.7.8	26,918,833.30	26,977,237.27
净资产合计		50,246,950.37	52,314,588.73
负债和净资产总计		52,556,687.65	52,724,624.01

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 23,328,117.07 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 2.1538 元,基金份额总额 22,935,611.62 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 2.1635 元，基金份额总额 392,505.45 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧互通精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	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		2,691,751.17	1,559,660.50
1. 利息收入		9,757.97	7,863.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,757.97	7,863.07
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）		6,657,962.20	67,035.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,242,111.75	-694,624.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,931.90	9,844.59
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	136,939.96
股利收益	6.4.7.14	402,918.55	614,875.97
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	-3,978,795.52	1,466,987.98
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	2,826.52	17,773.80
减：二、营业总支出		433,053.80	425,189.09
1. 管理人报酬		308,604.77	303,841.84
2. 托管费		51,434.12	50,640.35
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,182.73	759.28
其中：卖出回购金融资产 支出		7,182.73	759.28
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		29.97	495.11
8. 其他费用	6.4.7.18	65,802.21	69,452.51
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,258,697.37	1,134,471.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,258,697.37	1,134,471.41
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		2,258,697.37	1,134,471.41

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧互通精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	25,337,351.46	-	26,977,237.27	52,314,588.73

二、本期期初净资产	25,337,351.46	-	26,977,237.27	52,314,588.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,009,234.39	-	-58,403.97	-2,067,638.36
(一)、综合收益总额	-	-	2,258,697.37	2,258,697.37
(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)	-2,009,234.39	-	-2,317,101.34	-4,326,335.73
其中：1. 基金申购款	769,576.89	-	877,967.20	1,647,544.09
2. 基金赎回款	-2,778,811.28	-	-3,195,068.54	-5,973,879.82
(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	23,328,117.07	-	26,918,833.30	50,246,950.37
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	32,106,743.31	-	22,908,705.56	55,015,448.87
二、本期期初净资产	32,106,743.31	-	22,908,705.56	55,015,448.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,476,664.82	-	-601,036.38	-3,077,701.20
(一)、综合收益总额	-	-	1,134,471.41	1,134,471.41
(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)	-2,476,664.82	-	-1,735,507.79	-4,212,172.61
其中：1. 基金申购款	2,869,877.21	-	2,022,105.30	4,891,982.51
2. 基金赎回款	-5,346,542.03	-	-3,757,613.09	-9,104,155.12

回款				
(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	29,630,078.49	-	22,307,669.18	51,937,747.67

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

中欧互通精选混合型证券投资基金（原名为中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），以下简称“本基金”），系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[2010]第 588 号《关于核准中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》核准，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 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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 1,201,873,408.58 元，经向中国证监会备案，《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2010 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,202,197,493.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 324,084.75 份基金份额。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2010]第 254 号文审核同意，本基金 57,032,620 份基金份额于 2010 年 8 月 16 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。2018 年 8 月 29 日，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）份额持有人大会表决通过了《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意将中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）由指数增强型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，基金名称相应变更为中欧互通精选混合型证券投资基金，原有的上市基金份额终止上市交易，并调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费率、基金收益分配规则等内容。上述基金份额持

有人大会决议事项自表决通过之日起生效。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2018 年 9 月 28 日为 A 类基金份额终止上市的权益登记日，自该权益登记日的次一工作日起，《中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金的存续期限不定。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	2,748,687.98
等于：本金	2,748,420.42
加：应计利息	267.56
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,748,687.98

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		47,832,709.97	-	46,733,686.83	-1,099,023.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,202,422.00	16,490.63	2,218,270.63	-642.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,202,422.00	16,490.63	2,218,270.63	-642.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		50,035,131.97	16,490.63	48,951,957.46	-1,099,665.14

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	0.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,586.75

其中：交易所市场	18,586.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	39,671.58
预提费用-审计费	15,868.27
其他应付	4,907.69
合计	79,035.07

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧互通精选混合 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	24,906,522.01	24,906,522.01
本期申购	683,190.53	683,190.53
本期赎回（以“-”号填列）	-2,654,100.92	-2,654,100.92
本期末	22,935,611.62	22,935,611.62

中欧互通精选混合 E

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	430,829.45	430,829.45
本期申购	86,386.36	86,386.36
本期赎回（以“-”号填列）	-124,710.36	-124,710.36
本期末	392,505.45	392,505.45

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

中欧互通精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,008,275.46	-8,493,726.45	26,514,549.01
本期期初	35,008,275.46	-8,493,726.45	26,514,549.01
本期利润	6,124,084.20	-3,903,491.80	2,220,592.40
本期基金份额交易产生的变动数	-2,997,542.80	724,536.58	-2,273,006.22
其中：基金申购款	1,054,218.92	-276,263.84	777,955.08
基金赎回款	-4,051,761.72	1,000,800.42	-3,050,961.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,134,816.86	-11,672,681.67	26,462,135.19

中欧互通精选混合 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	477,046.84	-14,358.58	462,688.26

本期期初	477,046.84	-14,358.58	462,688.26
本期利润	113,408.69	-75,303.72	38,104.97
本期基金份额交易产生的变动数	-54,471.32	10,376.20	-44,095.12
其中：基金申购款	103,138.75	-3,126.63	100,012.12
基金赎回款	-157,610.07	13,502.83	-144,107.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	535,984.21	-79,286.10	456,698.11

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	4,138.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,576.56
其他	42.72
合计	9,757.97

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	146,280,196.67
减：卖出股票成本总额	139,846,494.45
减：交易费用	191,590.47
买卖股票差价收入	6,242,111.75

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	9,211.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,720.00
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	12,931.90

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	2,023,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,996,280.00
减：应计利息总额	23,200.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	3,720.00

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	402,918.55
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	402,918.55

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	-3,978,795.52
股票投资	-3,974,433.52
债券投资	-4,362.00
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	-3,978,795.52

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	2,716.33
基金转换费收入	110.19
合计	2,826.52

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	15,868.27
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,240.00
账户维护费	9,000.00
证券组合费	22.36
合计	65,802.21

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	308,604.77	303,841.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	89,170.64	87,097.52
应支付基金管理人的净管理费	219,434.13	216,744.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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，自动在月初 2 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,434.12	50,640.35

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。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，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		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
兴业银行股份有	2,748,687.98	4,138.69	2,749,285.96	4,407.37

限公司				
-----	--	--	--	--

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

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	400	3,376.00	3,620.00	-

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 1,980,083.27 元，于 2026 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,748,687.98	-	-	-	2,748,687.98
结算备付金	827,745.06	-	-	-	827,745.06
存出保证金	22,431.60	-	-	-	22,431.60
交易性金融资产	2,218,270.63	-	-	46,733,686.83	48,951,957.46
应收申购款	-	-	-	5,865.55	5,865.55
资产总计	5,817,135.27	-	-	46,739,552.38	52,556,687.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,731.25	8,731.25
应付管理人报酬	-	-	-	49,564.35	49,564.35
应付托管费	-	-	-	8,260.72	8,260.72
应付清算款	-	-	-	183,986.34	183,986.34
卖出回购金融资产款	1,980,083.27	-	-	-	1,980,083.27
应交税费	-	-	-	76.28	76.28
其他负债	-	-	-	79,035.07	79,035.07
负债总计	1,980,083.27	-	-	329,654.01	2,309,737.28
利率敏感度缺口	3,837,052.00	-	-	46,409,898.37	50,246,950.37
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	1,032,205.57	-	-	-	1,032,205.57
结算备付金	872,878.20	-	-	-	872,878.20
存出保证金	25,628.33	-	-	-	25,628.33
交易性金融资产	2,022,310.14	-	-	48,516,631.93	50,538,942.07
应收申购款	-	-	-	1,024.05	1,024.05
应收清算款	-	-	-	253,945.79	253,945.79
资产总计	3,953,022.24	-	-	48,771,601.77	52,724,624.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,797.10	7,797.10
应付管理人报酬	-	-	-	52,456.92	52,456.92
应付托管费	-	-	-	8,742.81	8,742.81
应付清算款	-	-	-	238,235.22	238,235.22
其他负债	-	-	-	102,803.23	102,803.23

负债总计	-	-	-	410,035.28	410,035.28
利率敏感度缺口	3,953,022.24	-	-	48,361,566.49	52,314,588.73

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 4.41%（2025 年 12 月 31 日：3.87%），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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	256,896.00	-	256,896.00
资产合计	-	256,896.00	-	256,896.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	256,896.00	-	256,896.00
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	795,852.00	-	795,852.00
资产合计	-	795,852.00	-	795,852.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	795,852.00	-	795,852.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	港币相对人民币贬值 5%	-12,844.80	-39,792.60
	港币相对人民币升值 5%	12,844.80	39,792.60

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	46,733,686.83	93.01	48,516,631.93	92.74
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	46,733,686.83	93.01	48,516,631.93	92.74

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%	2,710,830.32	3,079,603.94
	业绩比较基准下降 5%	-2,710,830.32	-3,079,603.94

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	46,730,066.83	48,459,879.93
第二层次	2,221,890.63	2,079,062.14
第三层次	－	－
合计	48,951,957.46	50,538,942.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	46,733,686.83	88.92
	其中：股票	46,733,686.83	88.92
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,218,270.63	4.22
	其中：债券	2,218,270.63	4.22
	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	3,576,433.04	6.80

8	其他各项资产	28,297.15	0.05
9	合计	52,556,687.65	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 256,896.00 元，占基金资产净值比例 0.51%。

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	573,939.00	1.14
B	采矿业	2,748,712.00	5.47
C	制造业	27,219,941.59	54.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,722,444.00	3.43
E	建筑业	344,840.00	0.69
F	批发和零售业	458,244.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	618,987.00	1.23
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,435,241.04	2.86
J	金融业	9,080,891.80	18.07
K	房地产业	128,840.00	0.26
L	租赁和商务服务业	688,475.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	1,052,933.40	2.10
N	水利、环境和公共设施管理业	69,464.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	293,230.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	10,386.00	0.02
S	综合	30,222.00	0.06
	合计	46,476,790.83	92.50

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	—	—
消费者非必需品	—	—
消费者常用品	256,896.00	0.51
能源	—	—
金融	—	—
医疗保健	—	—
工业	—	—
信息技术	—	—

电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	256,896.00	0.51

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,700	1,061,127.00	2.11
2	300308	中际旭创	700	889,000.00	1.77
3	600519	贵州茅台	600	711,294.00	1.42
4	300502	新易盛	1,120	679,840.00	1.35
5	601138	工业富联	8,500	613,275.00	1.22
6	601328	交通银行	92,500	594,775.00	1.18
7	600919	江苏银行	54,700	589,666.00	1.17
8	601398	工商银行	82,400	582,568.00	1.16
9	002371	北方华创	600	530,736.00	1.06
10	002384	东山精密	2,000	524,700.00	1.04
11	600900	长江电力	19,500	516,165.00	1.03
12	002475	立讯精密	7,300	513,920.00	1.02
13	601288	农业银行	84,500	512,915.00	1.02
14	600036	招商银行	14,400	511,200.00	1.02
15	600926	杭州银行	34,200	494,190.00	0.98
16	601899	紫金矿业	19,600	492,744.00	0.98
17	688256	寒武纪	298	475,473.90	0.95
18	600183	生益科技	2,700	468,180.00	0.93
19	601318	中国平安	9,600	458,304.00	0.91
20	601988	中国银行	78,500	449,020.00	0.89
21	300408	三环集团	2,600	433,940.00	0.86
22	601939	建设银行	45,000	433,350.00	0.86
23	600150	中国船舶	12,427	419,908.33	0.84
24	603259	药明康德	3,300	410,883.00	0.82
25	603993	洛阳钼业	22,700	398,385.00	0.79
26	300274	阳光电源	2,500	397,550.00	0.79
27	002463	沪电股份	2,600	397,280.00	0.79
28	000338	潍柴动力	14,300	389,675.00	0.78
29	600309	万华化学	5,600	383,096.00	0.76
30	601838	成都银行	20,900	369,930.00	0.74
31	601601	中国太保	12,900	367,908.00	0.73
32	002938	鹏鼎控股	3,400	358,292.00	0.71
33	600887	伊利股份	14,900	357,004.00	0.71
34	600989	宝丰能源	17,500	355,775.00	0.71

35	600674	川投能源	24,900	352,833.00	0.70
36	600276	恒瑞医药	6,700	348,668.00	0.69
37	002142	宁波银行	11,700	347,373.00	0.69
38	000792	盐湖股份	11,400	344,166.00	0.68
39	002027	分众传媒	70,900	343,156.00	0.68
40	600031	三一重工	19,700	340,416.00	0.68
41	601872	招商轮船	19,300	339,101.00	0.67
42	002493	荣盛石化	31,300	336,475.00	0.67
43	000100	TCL 科技	57,800	336,396.00	0.67
44	688396	华润微	3,427	334,303.85	0.67
45	600489	中金黄金	18,500	333,925.00	0.66
46	000408	藏格矿业	4,800	332,736.00	0.66
47	300014	亿纬锂能	5,000	325,150.00	0.65
48	688041	海光信息	878	325,123.40	0.65
49	600346	恒力石化	18,300	324,093.00	0.65
50	601788	光大证券	22,400	323,232.00	0.64
51	600893	航发动力	8,300	318,222.00	0.63
52	600028	中国石化	70,500	314,430.00	0.63
53	603799	华友钴业	6,500	313,690.00	0.62
54	600030	中信证券	10,900	313,157.00	0.62
55	000807	云铝股份	14,000	309,960.00	0.62
56	600875	东方电气	10,700	307,839.00	0.61
57	000975	山金国际	18,100	307,700.00	0.61
58	603296	华勤技术	4,120	305,992.40	0.61
59	600482	XD 中国动	9,300	305,040.00	0.61
60	300759	康龙化成	10,500	303,765.00	0.60
61	600066	宇通客车	11,200	300,272.00	0.60
62	600426	华鲁恒升	12,300	294,216.00	0.59
63	688981	中芯国际	1,850	293,817.00	0.58
64	300015	爱尔眼科	35,500	293,230.00	0.58
65	002415	海康威视	8,500	290,700.00	0.58
66	688472	阿特斯	26,772	289,673.04	0.58
67	002422	科伦药业	7,500	288,900.00	0.57
68	601689	拓普集团	5,100	287,742.00	0.57
69	000768	中航西飞	13,900	284,672.00	0.57
70	600415	小商品城	28,000	284,480.00	0.57
71	000963	华东医药	10,100	284,012.00	0.57
72	300316	晶盛机电	4,700	283,880.00	0.56
73	600690	海尔智家	13,900	283,699.00	0.56
74	600760	中航沈飞	6,900	283,590.00	0.56
75	603893	瑞芯微	1,500	282,540.00	0.56
76	002714	牧原股份	8,000	279,920.00	0.56
77	688169	石头科技	2,934	278,641.98	0.55

78	300418	昆仑万维	6,900	278,484.00	0.55
79	300347	泰格医药	5,800	278,400.00	0.55
80	000651	格力电器	7,400	277,500.00	0.55
81	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.55
82	600803	新奥股份	17,500	276,500.00	0.55
83	300498	温氏股份	22,400	275,968.00	0.55
84	601117	中国化学	37,300	274,155.00	0.55
85	300866	安克创新	2,600	271,700.00	0.54
86	600938	中国海油	10,000	271,500.00	0.54
87	688271	联影医疗	2,671	270,385.33	0.54
88	002601	龙佰集团	16,200	266,976.00	0.53
89	000001	平安银行	26,200	263,310.00	0.52
90	02419	德康农牧	7,200	256,896.00	0.51
91	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.49
92	601688	华泰证券	10,700	220,634.00	0.44
93	600999	招商证券	10,000	211,000.00	0.42
94	601211	国泰海通	11,354	206,642.80	0.41
95	600886	国投电力	15,400	204,974.00	0.41
96	600000	浦发银行	20,200	173,922.00	0.35
97	000776	广发证券	6,600	154,440.00	0.31
98	601009	南京银行	15,400	152,306.00	0.30
99	301308	江波龙	200	140,760.00	0.28
100	688012	中微公司	298	139,613.00	0.28
101	300394	天孚通信	460	139,232.80	0.28
102	601766	中国中车	26,700	138,840.00	0.28
103	002916	深南电路	300	137,370.00	0.27
104	600176	中国巨石	1,800	131,184.00	0.26
105	600390	五矿资本	27,900	127,224.00	0.25
106	601881	中国银河	9,900	124,443.00	0.25
107	688008	XD 澜起科	400	123,960.00	0.25
108	601225	陕西煤业	5,800	118,030.00	0.23
109	600487	亨通光电	1,000	109,340.00	0.22
110	000725	京东方 A	12,300	106,764.00	0.21
111	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.21
112	300604	长川科技	300	102,426.00	0.20
113	600019	宝钢股份	18,300	99,369.00	0.20
114	601665	齐鲁银行	17,200	99,244.00	0.20
115	601857	中国石油	11,400	98,952.00	0.20
116	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.20
117	000333	美的集团	1,300	98,189.00	0.20
118	002299	圣农发展	6,300	95,508.00	0.19
119	300857	协创数据	280	95,172.00	0.19
120	001309	德明利	100	94,290.00	0.19

121	601995	中金公司	2,600	93,990.00	0.19
122	601998	中信银行	13,300	92,169.00	0.18
123	000166	申万宏源	20,100	88,440.00	0.18
124	000657	中钨高新	900	86,148.00	0.17
125	600522	中天科技	1,400	84,952.00	0.17
126	300059	东方财富	4,000	81,520.00	0.16
127	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.15
128	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.15
129	002080	中材科技	800	72,000.00	0.14
130	600115	中国东航	18,600	70,866.00	0.14
131	601168	西部矿业	2,600	70,564.00	0.14
132	300433	蓝思科技	1,300	69,758.00	0.14
133	600795	国电电力	14,700	68,649.00	0.14
134	600549	厦门钨业	800	68,160.00	0.14
135	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.12
136	002353	杰瑞股份	400	61,000.00	0.12
137	600029	南方航空	11,700	60,606.00	0.12
138	600188	兖矿能源	3,400	60,418.00	0.12
139	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.12
140	605117	德业股份	560	59,460.80	0.12
141	600718	东软集团	8,100	58,644.00	0.12
142	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.11
143	300134	大富科技	6,700	57,285.00	0.11
144	002736	国信证券	5,700	56,943.00	0.11
145	002001	新 和 成	2,000	56,840.00	0.11
146	002602	世纪华通	4,000	56,400.00	0.11
147	600801	华新建材	3,600	56,160.00	0.11
148	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.11
149	301039	中集车辆	7,700	54,285.00	0.11
150	601100	恒立液压	500	53,780.00	0.11
151	000425	徐工机械	6,600	53,394.00	0.11
152	600015	华夏银行	8,300	53,037.00	0.11
153	300073	当升科技	1,100	52,844.00	0.11
154	601066	中信建投	1,800	52,326.00	0.10
155	000938	紫光股份	1,800	51,948.00	0.10
156	601088	中国神华	1,300	50,752.00	0.10
157	300223	北京君正	200	49,780.00	0.10
158	601985	中国核电	5,400	48,762.00	0.10
159	600011	华能国际	6,400	48,576.00	0.10
160	300033	同花顺	200	48,200.00	0.10
161	601336	新华保险	800	47,728.00	0.09
162	600105	永鼎股份	700	47,236.00	0.09
163	601699	潞安环能	3,300	47,124.00	0.09

164	002197	证通电子	8,200	47,068.00	0.09
165	002064	华峰化学	4,900	46,501.00	0.09
166	601628	中国人寿	1,300	45,955.00	0.09
167	601555	东吴证券	5,800	45,936.00	0.09
168	600037	歌华有线	7,300	45,771.00	0.09
169	601600	中国铝业	5,500	45,210.00	0.09
170	002648	卫星化学	1,900	44,631.00	0.09
171	002399	海普瑞	4,900	44,002.00	0.09
172	600418	江淮汽车	1,700	43,911.00	0.09
173	600027	华电国际	9,800	43,610.00	0.09
174	688653	康希通信	2,478	43,067.64	0.09
175	600955	维远股份	2,900	42,688.00	0.08
176	001286	陕西能源	4,100	41,574.00	0.08
177	300442	润泽科技	500	41,535.00	0.08
178	688469	芯联集成	3,880	41,166.80	0.08
179	688110	东芯股份	200	40,740.00	0.08
180	000683	博源化工	7,000	40,320.00	0.08
181	600061	国投资本	6,100	39,955.00	0.08
182	688262	国芯科技	922	39,858.06	0.08
183	002746	仙坛股份	7,700	39,270.00	0.08
184	601360	三六零	4,500	39,105.00	0.08
185	300168	万达信息	8,500	39,015.00	0.08
186	002266	浙富控股	7,700	38,962.00	0.08
187	002061	浙江交科	11,800	38,940.00	0.08
188	002532	天山铝业	3,600	38,628.00	0.08
189	600872	中炬高新	2,200	38,192.00	0.08
190	002236	大华股份	2,300	37,927.00	0.08
191	600352	浙江龙盛	3,100	37,541.00	0.07
192	000988	华工科技	200	36,922.00	0.07
193	000957	中通客车	3,900	36,504.00	0.07
194	603228	景旺电子	500	36,205.00	0.07
195	601777	千里科技	4,400	35,904.00	0.07
196	688561	奇安信	1,477	35,418.46	0.07
197	300919	中伟新材	800	35,000.00	0.07
198	601700	风范股份	8,000	34,880.00	0.07
199	000543	皖能电力	4,600	34,822.00	0.07
200	688126	沪硅产业	861	34,345.29	0.07
201	002250	联化科技	2,500	34,175.00	0.07
202	600026	中远海能	1,900	34,086.00	0.07
203	603915	国茂股份	2,400	34,056.00	0.07
204	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.07
205	300124	汇川技术	500	33,165.00	0.07
206	000426	兴业银锡	1,000	32,960.00	0.07

207	000060	中金岭南	4,300	32,551.00	0.06
208	601231	环旭电子	1,000	32,400.00	0.06
209	688249	晶合集成	545	32,171.35	0.06
210	603345	安井食品	400	32,076.00	0.06
211	000933	神火股份	1,500	31,800.00	0.06
212	002577	雷柏科技	1,700	31,212.00	0.06
213	601058	赛轮轮胎	2,700	31,131.00	0.06
214	688387	信科移动	1,560	30,950.40	0.06
215	688002	睿创微纳	200	30,938.00	0.06
216	603939	益丰药房	1,700	30,566.00	0.06
217	301358	湖南裕能	400	30,348.00	0.06
218	002558	巨人网络	1,100	30,316.00	0.06
219	601108	财通证券	3,500	30,275.00	0.06
220	600673	东阳光	900	30,222.00	0.06
221	300429	强力新材	1,700	30,124.00	0.06
222	002593	日上集团	7,400	29,526.00	0.06
223	600498	烽火通信	400	29,440.00	0.06
224	688382	益方生物	1,633	29,394.00	0.06
225	000630	铜陵有色	4,600	29,256.00	0.06
226	002966	苏州银行	4,200	29,232.00	0.06
227	600662	外服控股	7,200	29,016.00	0.06
228	600369	西南证券	7,200	28,944.00	0.06
229	000301	东方盛虹	2,500	28,625.00	0.06
230	688257	新锐股份	280	28,532.00	0.06
231	600018	上港集团	6,000	28,320.00	0.06
232	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.06
233	605088	冠盛股份	1,000	28,180.00	0.06
234	000800	一汽解放	4,700	27,965.00	0.06
235	000686	东北证券	3,300	27,720.00	0.06
236	688779	五矿新能	3,366	27,298.26	0.05
237	688183	生益电子	200	26,480.00	0.05
238	002408	齐翔腾达	5,600	26,264.00	0.05
239	600428	中远海特	3,300	25,773.00	0.05
240	300034	钢研高纳	1,500	25,710.00	0.05
241	601038	一拖股份	2,400	25,416.00	0.05
242	002206	海利得	4,900	25,333.00	0.05
243	000069	华侨城 A	15,400	25,256.00	0.05
244	603588	高能环境	1,300	24,960.00	0.05
245	600601	方正科技	1,800	24,912.00	0.05
246	688148	芳源股份	2,870	24,624.60	0.05
247	002517	恺英网络	1,500	24,375.00	0.05
248	000708	中信特钢	1,900	23,978.00	0.05
249	603077	和邦生物	10,300	23,896.00	0.05

250	001389	广合科技	100	23,725.00	0.05
251	603198	迎驾贡酒	800	23,680.00	0.05
252	688036	传音控股	400	23,580.00	0.05
253	600642	申能股份	2,700	23,571.00	0.05
254	300233	金城医药	1,900	23,560.00	0.05
255	688777	中控技术	200	23,500.00	0.05
256	603638	艾迪精密	1,000	23,450.00	0.05
257	603659	璞泰来	800	23,144.00	0.05
258	600547	山东黄金	1,000	23,090.00	0.05
259	300590	移为通信	1,600	22,960.00	0.05
260	000027	深圳能源	3,700	22,940.00	0.05
261	002793	罗欣药业	5,900	22,656.00	0.05
262	601061	中信金属	2,100	22,617.00	0.05
263	600189	泉阳泉	3,000	22,590.00	0.04
264	002311	海大集团	500	22,305.00	0.04
265	301285	鸿日达	200	22,066.00	0.04
266	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.04
267	600166	福田汽车	7,500	21,825.00	0.04
268	603225	新凤鸣	1,100	21,615.00	0.04
269	601901	方正证券	3,000	21,600.00	0.04
270	601677	明泰铝业	1,300	21,580.00	0.04
271	601216	君正集团	4,800	21,408.00	0.04
272	001872	招商港口	1,100	21,373.00	0.04
273	000960	锡业股份	500	21,345.00	0.04
274	600050	中国联通	5,300	21,200.00	0.04
275	301149	隆华新材	2,000	21,160.00	0.04
276	000977	浪潮信息	300	21,000.00	0.04
277	002128	电投能源	900	20,808.00	0.04
278	002216	三全食品	1,800	20,754.00	0.04
279	002832	比音勒芬	1,000	20,640.00	0.04
280	688327	云从科技	1,648	20,534.08	0.04
281	002488	金固股份	2,300	20,493.00	0.04
282	688599	天合光能	1,450	20,474.00	0.04
283	603826	坤彩科技	800	20,448.00	0.04
284	000949	新乡化纤	3,200	20,288.00	0.04
285	600641	先导基电	500	19,930.00	0.04
286	600901	江苏金租	3,400	19,550.00	0.04
287	000951	中国重汽	1,000	19,510.00	0.04
288	002285	世联行	9,500	19,475.00	0.04
289	600499	科达制造	1,400	19,320.00	0.04
290	002465	海格通信	1,500	19,155.00	0.04
291	688199	久日新材	550	18,991.50	0.04
292	688678	福立旺	781	18,876.77	0.04

293	600256	广汇能源	3,800	18,772.00	0.04
294	300390	天华新能	200	18,702.00	0.04
295	002838	道恩股份	600	18,372.00	0.04
296	688180	君实生物	540	18,262.80	0.04
297	300761	立华股份	1,100	18,051.00	0.04
298	688700	东威科技	200	17,880.00	0.04
299	002152	广电运通	1,900	17,822.00	0.04
300	603150	万朗磁塑	251	17,770.80	0.04
301	002738	中矿资源	300	17,697.00	0.04
302	600663	陆家嘴	2,800	17,584.00	0.03
303	603658	安图生物	600	17,412.00	0.03
304	000883	湖北能源	4,000	17,280.00	0.03
305	688226	威腾电气	400	17,132.00	0.03
306	301391	卡莱特	300	17,130.00	0.03
307	300700	岱勒新材	800	17,024.00	0.03
308	600595	中孚实业	3,000	16,860.00	0.03
309	600515	海南机场	6,000	16,440.00	0.03
310	001313	粤海饲料	2,300	16,307.00	0.03
311	688202	美迪西	200	16,142.00	0.03
312	688378	奥来德	259	16,058.00	0.03
313	002594	比亚迪	200	15,940.00	0.03
314	300797	钢研纳克	1,200	15,912.00	0.03
315	300691	联合光电	1,000	15,810.00	0.03
316	688173	希荻微	811	15,522.54	0.03
317	000415	渤海租赁	3,800	15,466.00	0.03
318	002833	弘亚数控	800	15,432.00	0.03
319	000782	恒申新材	1,900	15,352.00	0.03
320	000157	中联重科	2,200	15,334.00	0.03
321	600623	华谊集团	1,900	15,333.00	0.03
322	603127	昭衍新药	400	15,288.00	0.03
323	601608	中信重工	3,200	15,264.00	0.03
324	300773	拉卡拉	980	14,994.00	0.03
325	001203	大中矿业	500	14,975.00	0.03
326	000989	九芝堂	1,900	14,763.00	0.03
327	601121	宝地矿业	2,600	14,664.00	0.03
328	301238	瑞泰新材	600	14,640.00	0.03
329	000783	长江证券	1,500	14,625.00	0.03
330	688299	长阳科技	854	14,270.34	0.03
331	000059	华锦股份	3,800	14,250.00	0.03
332	601319	中国人保	2,100	14,196.00	0.03
333	002273	水晶光电	400	14,192.00	0.03
334	300424	航新科技	900	14,166.00	0.03
335	000607	华媒控股	4,600	14,122.00	0.03

336	300432	富临精工	700	14,063.00	0.03
337	300127	银河磁体	500	13,975.00	0.03
338	600219	南山铝业	3,500	13,965.00	0.03
339	000967	盈峰环境	1,300	13,689.00	0.03
340	603025	大豪科技	1,000	13,640.00	0.03
341	600655	豫园股份	3,300	13,563.00	0.03
342	600640	国脉文化	1,400	13,538.00	0.03
343	300277	汽轮科技	900	13,536.00	0.03
344	300628	亿联网络	400	13,528.00	0.03
345	603233	大参林	900	13,527.00	0.03
346	301487	盟固利	700	13,405.00	0.03
347	603867	新化股份	400	13,396.00	0.03
348	300395	菲利华	100	13,373.00	0.03
349	600827	百联股份	1,800	13,338.00	0.03
350	000810	创维数字	1,000	13,250.00	0.03
351	301321	翰博高新	300	13,245.00	0.03
352	600606	绿地控股	10,900	13,189.00	0.03
353	603507	振江股份	400	13,156.00	0.03
354	300236	上海新阳	100	13,150.00	0.03
355	600980	北矿科技	700	13,125.00	0.03
356	300568	星源材质	700	13,104.00	0.03
357	002545	东方铁塔	800	12,976.00	0.03
357	603181	皇马科技	800	12,976.00	0.03
358	003022	联泓新科	500	12,950.00	0.03
359	688219	会通股份	995	12,875.30	0.03
360	300358	楚天科技	1,600	12,800.00	0.03
361	688567	孚能科技	1,182	12,411.00	0.02
362	000553	安道麦 A	2,300	12,305.00	0.02
363	002755	奥赛康	900	12,258.00	0.02
364	000036	华联控股	2,800	12,236.00	0.02
365	688443	智翔金泰	526	12,229.50	0.02
366	600409	三友化工	2,000	12,220.00	0.02
367	002948	青岛银行	2,400	12,192.00	0.02
368	000983	山西焦煤	2,100	12,180.00	0.02
369	301260	格力博	900	12,159.00	0.02
370	688389	普门科技	1,240	12,139.60	0.02
371	688239	航宇科技	200	11,966.00	0.02
372	300136	信维通信	100	11,925.00	0.02
373	603195	公牛集团	300	11,745.00	0.02
374	600490	鹏欣资源	2,000	11,640.00	0.02
375	002487	大金重工	200	11,594.00	0.02
376	000697	炼石航空	1,100	11,418.00	0.02
377	688223	晶科能源	2,382	11,314.50	0.02

378	300115	长盈精密	400	11,176.00	0.02
379	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.02
380	601083	锦江航运	1,100	10,934.00	0.02
381	300765	石药创新	400	10,892.00	0.02
382	002053	云南能投	1,100	10,813.00	0.02
383	300128	锦富技术	1,800	10,656.00	0.02
384	300177	中海达	1,700	10,540.00	0.02
385	688176	亚虹医药	1,060	10,515.20	0.02
386	002484	江海股份	100	10,500.00	0.02
387	601858	中国科传	600	10,386.00	0.02
388	600584	长电科技	100	10,355.00	0.02
389	600971	恒源煤电	1,500	10,350.00	0.02
390	300022	吉峰科技	1,300	10,101.00	0.02
391	601068	中铝国际	2,300	9,936.00	0.02
392	601059	信达证券	600	9,714.00	0.02
393	001979	招商蛇口	1,500	9,645.00	0.02
394	601816	京沪高铁	2,100	9,513.00	0.02
395	002271	东方雨虹	800	9,496.00	0.02
396	300490	华自科技	700	9,261.00	0.02
397	002290	禾盛新材	100	9,187.00	0.02
398	600746	江苏索普	1,700	8,891.00	0.02
399	600711	盛屯矿业	800	8,776.00	0.02
400	600546	山煤国际	800	8,744.00	0.02
401	301389	隆扬电子	100	8,679.00	0.02
402	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.02
403	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.02
404	600060	海信视像	300	8,361.00	0.02
405	300438	鹏辉能源	100	8,285.00	0.02
406	603615	茶花股份	500	8,075.00	0.02
407	600973	宝胜股份	1,100	7,799.00	0.02
408	301201	诚达药业	200	7,272.00	0.01
409	301507	民生健康	600	7,218.00	0.01
410	300331	苏大维格	100	7,111.00	0.01
411	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.01
412	002600	领益智造	400	6,936.00	0.01
413	300382	斯莱克	300	6,933.00	0.01
414	000688	国城矿业	200	6,846.00	0.01
415	688046	药康生物	282	6,824.40	0.01
416	600733	北汽蓝谷	1,400	6,818.00	0.01
417	603173	福斯达	200	6,780.00	0.01
418	601077	渝农商行	1,100	6,721.00	0.01
419	603806	福斯特	400	6,716.00	0.01
420	002812	恩捷股份	100	6,691.00	0.01

421	601111	中国国航	1,100	6,655.00	0.01
422	002653	海思科	100	6,634.00	0.01
423	603288	海天味业	200	6,632.00	0.01
424	301393	昊帆生物	100	6,477.00	0.01
425	688062	迈威生物	224	6,328.00	0.01
426	300748	金力永磁	200	6,170.00	0.01
427	300933	中辰股份	1,000	6,080.00	0.01
428	301085	亚康股份	100	6,061.00	0.01
429	603308	应流股份	100	6,040.00	0.01
430	300493	润欣科技	400	5,964.00	0.01
431	002961	瑞达期货	300	5,874.00	0.01
432	301096	百诚医药	100	5,719.00	0.01
433	600246	万通发展	300	5,700.00	0.01
434	300207	欣旺达	300	5,697.00	0.01
435	600429	三元股份	1,400	5,656.00	0.01
436	002979	雷赛智能	100	5,578.00	0.01
437	002645	华宏科技	200	5,502.00	0.01
438	301246	宏源药业	200	5,380.00	0.01
439	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.01
440	300602	飞荣达	100	5,120.00	0.01
441	300079	数码视讯	1,200	5,040.00	0.01
441	300322	硕贝德	200	5,040.00	0.01
442	688175	高凌信息	200	5,030.00	0.01
443	688620	安凯微	305	4,941.00	0.01
444	001283	豪鹏科技	100	4,902.00	0.01
445	600577	精达股份	500	4,890.00	0.01
446	000039	中集集团	600	4,866.00	0.01
447	601156	东航物流	300	4,836.00	0.01
448	601377	兴业证券	800	4,832.00	0.01
449	601375	中原证券	1,200	4,788.00	0.01
450	688128	中国电研	200	4,748.00	0.01
451	000629	钒钛股份	1,400	4,676.00	0.01
452	601618	中国中冶	1,900	4,636.00	0.01
453	300755	华致酒行	400	4,556.00	0.01
454	688221	前沿生物	200	4,480.00	0.01
455	000750	国海证券	1,200	4,416.00	0.01
456	300871	回盛生物	200	4,412.00	0.01
457	600362	江西铜业	100	4,330.00	0.01
458	300315	掌趣科技	1,100	4,290.00	0.01
459	300480	光力科技	100	4,268.00	0.01
460	301665	泰禾股份	200	4,192.00	0.01
461	300579	数字认证	200	4,140.00	0.01
462	688512	慧智微	258	4,120.26	0.01

463	300323	华灿光电	200	4,080.00	0.01
464	301026	浩通科技	200	4,044.00	0.01
464	600267	海正药业	400	4,044.00	0.01
465	000928	中钢国际	800	3,984.00	0.01
466	601139	深圳燃气	700	3,962.00	0.01
467	601106	中国一重	1,200	3,960.00	0.01
468	301316	慧博云通	100	3,938.00	0.01
469	600167	联美控股	700	3,913.00	0.01
470	000987	越秀资本	500	3,910.00	0.01
471	301002	崧盛股份	100	3,860.00	0.01
472	000599	青岛双星	900	3,798.00	0.01
473	600380	健康元	400	3,768.00	0.01
474	301090	华润材料	600	3,762.00	0.01
475	000828	东莞控股	400	3,744.00	0.01
476	600927	永安期货	300	3,735.00	0.01
477	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.01
478	603118	共进股份	300	3,633.00	0.01
479	603093	南华期货	200	3,630.00	0.01
480	603010	万盛股份	200	3,624.00	0.01
481	601369	陕鼓动力	400	3,620.00	0.01
482	300227	光韵达	300	3,570.00	0.01
483	688538	和辉光电	1,370	3,562.00	0.01
484	300050	世纪鼎利	600	3,552.00	0.01
485	600770	综艺股份	500	3,500.00	0.01
486	301116	益客食品	400	3,424.00	0.01
487	600216	浙江医药	300	3,420.00	0.01
488	300547	川环科技	100	3,339.00	0.01
489	300363	博腾股份	200	3,248.00	0.01
490	002228	合兴包装	1,100	3,234.00	0.01
491	002120	韵达股份	500	3,180.00	0.01
492	002099	海翔药业	600	3,168.00	0.01
493	000045	深纺织 A	300	3,162.00	0.01
494	300817	双飞集团	200	3,120.00	0.01
495	600336	澳柯玛	500	3,115.00	0.01
496	600475	华光环能	200	3,050.00	0.01
496	600841	动力新科	500	3,050.00	0.01
497	600096	云天化	100	3,040.00	0.01
498	688609	九联科技	275	3,027.75	0.01
499	601002	晋亿实业	700	3,024.00	0.01
500	002079	苏州固锝	200	3,006.00	0.01
501	002895	川恒股份	100	2,920.00	0.01
502	000546	金圆股份	600	2,916.00	0.01
503	603969	银龙股份	400	2,908.00	0.01

504	300681	英搏尔	100	2,862.00	0.01
505	002443	金洲管道	300	2,859.00	0.01
506	601958	金钼股份	100	2,811.00	0.01
507	600985	淮北矿业	200	2,810.00	0.01
508	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.01
509	600155	华创云信	500	2,760.00	0.01
510	600395	盘江股份	600	2,736.00	0.01
511	002132	恒星科技	500	2,705.00	0.01
512	002238	天威视讯	500	2,700.00	0.01
513	605228	神通科技	200	2,686.00	0.01
514	002414	高德红外	200	2,652.00	0.01
515	000617	中油资本	400	2,636.00	0.01
516	601519	大智慧	300	2,589.00	0.01
517	600773	西藏城投	200	2,574.00	0.01
518	600685	中船防务	100	2,544.00	0.01
519	600724	宁波富达	500	2,535.00	0.01
520	301109	军信股份	200	2,492.00	0.00
521	002810	山东赫达	100	2,470.00	0.00
522	000830	鲁西化工	200	2,400.00	0.00
522	603279	景津装备	200	2,400.00	0.00
523	002274	华昌化工	500	2,315.00	0.00
524	301216	万凯新材	100	2,299.00	0.00
525	300552	万集科技	100	2,285.00	0.00
526	601515	衢州东峰	700	2,240.00	0.00
527	002010	传化智联	500	2,235.00	0.00
528	300629	新劲刚	100	2,146.00	0.00
529	300201	海伦哲	100	2,107.00	0.00
530	300075	数字政通	200	2,044.00	0.00
531	300428	立中集团	100	1,818.00	0.00
532	603926	铁流股份	100	1,769.00	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	300308	中际旭创	1,782,741.00	3.41
2	603259	药明康德	1,602,250.00	3.06
3	002371	北方华创	1,417,724.00	2.71
4	600519	贵州茅台	1,401,198.00	2.68
5	300502	新易盛	1,379,458.00	2.64
6	600036	招商银行	1,276,681.00	2.44
7	002493	荣盛石化	1,233,326.00	2.36
8	601318	中国平安	1,207,395.00	2.31
9	000893	亚钾国际	1,100,413.00	2.10

10	300750	宁德时代	1,069,819.00	2.04
11	002027	分众传媒	981,098.00	1.88
12	600183	生益科技	943,457.00	1.80
13	601211	国泰海通	921,656.00	1.76
14	688717	艾罗能源	888,959.80	1.70
15	688012	中微公司	844,635.67	1.61
16	600926	杭州银行	839,844.00	1.61
17	301308	江波龙	837,313.00	1.60
18	600418	江淮汽车	826,941.00	1.58
19	300818	耐普矿机	813,277.00	1.55
20	002475	立讯精密	812,516.00	1.55

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	300308	中际旭创	2,216,238.00	4.24
2	603259	药明康德	1,622,445.00	3.10
3	300502	新易盛	1,575,108.00	3.01
4	600036	招商银行	1,466,946.00	2.80
5	002371	北方华创	1,412,299.00	2.70
6	601318	中国平安	1,350,151.00	2.58
7	300750	宁德时代	1,292,233.00	2.47
8	600519	贵州茅台	1,235,357.00	2.36
9	600183	生益科技	1,098,252.00	2.10
10	000893	亚钾国际	1,094,716.00	2.09
11	002384	东山精密	1,062,113.00	2.03
12	601138	工业富联	1,032,416.00	1.97
13	601211	国泰海通	967,089.00	1.85
14	300818	耐普矿机	957,259.00	1.83
15	688717	艾罗能源	938,924.73	1.79
16	002812	恩捷股份	928,560.00	1.77
17	002493	荣盛石化	915,928.00	1.75
18	300776	帝尔激光	907,756.00	1.74
19	688041	海光信息	885,389.52	1.69
20	600999	招商证券	884,075.00	1.69

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	142,037,982.87
卖出股票收入（成交）总额	146,280,196.67

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,218,270.63	4.41
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	2,218,270.63	4.41

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	12,000	1,207,778.30	2.40
2	019792	25 国债 19	10,000	1,010,492.33	2.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为主要目的，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，在最大限度保证基金资产安全

基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

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，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。中国工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、中国人民银行、中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、国家外汇管理局北京市分局)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	22,431.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,865.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,297.15

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
中欧互通 精选混合 A	2,111	10,864.81	775,008.02	3.38%	22,160,603.60	96.62%
中欧互通 精选混合 E	140	2,803.61	0.00	0.00%	392,505.45	100.00%
合计	2,251	10,363.45	775,008.02	3.32%	22,553,109.05	96.68%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	92.22

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	中欧互通精选混合 A	3,249,899.91	14.17%
	中欧互通精选混合 E	63,760.18	16.24%
	合计	3,313,660.09	14.20%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门 负责人持有本开放式 基金	中欧互通精选混合 A	0
	中欧互通精选混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧互通精选混合 A	10~50
	中欧互通精选混合 E	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧互通精选混合 A	中欧互通精选混合 E
基金合同生效日 (2018 年 10 月 8 日) 基金份额总额	110,769,697.04	1,014,268.95
本报告期期初基金份额总额	24,906,522.01	430,829.45
本报告期基金总申购份额	683,190.53	86,386.36
减：本报告期基金总赎回份额	2,654,100.92	124,710.36
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	22,935,611.62	392,505.45

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 (%)	
申万宏源证券	1	85,489,839.65	29.65	24,164.28	24.22	-
招商证券	1	74,375,655.07	25.80	19,606.33	19.65	-
国海证券	1	53,868,570.06	18.68	23,498.59	23.55	-
东方证券	1	34,952,437.00	12.12	15,237.17	15.27	-
瑞银证券	1	19,221,909.00	6.67	8,379.18	8.40	-
中信建投	1	14,358,834.50	4.98	6,257.18	6.27	-
国泰海通	1	3,869,867.00	1.34	1,687.07	1.69	-
长城证券	1	2,181,067.26	0.76	950.72	0.95	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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 (%)
申万宏源证券	2, 210, 341.02	100.00	20, 510, 000.00	52.24	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	17, 550, 000.00	44.70	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	1, 200, 000.00	3.06	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证	-	-	-	-	-	-

券						
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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
2	中欧互通精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
3	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
4	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2025年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧互通精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
7	中欧互通精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
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2026年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
9	中欧互通精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
10	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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