

中欧中证 A500 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 04 月 22 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59

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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	中欧中证 A500 指数量化增强	
基金主代码	026742	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 22 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	801,214,217.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧中证 A500 指数量化增强 A	中欧中证 A500 指数量化增强 C
下属分级基金的交 易代码	026742	026743
报告期末下属分级 基金的份额总额	704,239,588.33 份	96,974,628.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 A500 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 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，利用公司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	中证 A500 指数收益率×95%+活期存款基准利率×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，跟踪中证 A500 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 4 月 22 日-2026 年 6 月 30 日)	
	中欧中证 A500 指数量化增强 A	中欧中证 A500 指数量化增强 C
本期已实现收益	39,832,063.91	6,612,083.48
本期利润	44,273,878.88	7,003,346.21

加权平均基金份额本期利润	0.0435	0.0412
本期加权平均净值利润率	4.28%	4.06%
本期基金份额净值增长率	3.04%	3.01%
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	21,443,919.08	2,914,953.86
期末可供分配基金份额利润	0.0304	0.0301
期末基金资产净值	725,683,507.41	99,889,582.61
期末基金份额净值	1.0304	1.0301
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	3.04%	3.01%

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

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

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

4、本基金合同自 2026 年 04 月 22 日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证 A500 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

自基金合同生效起 至今	3.04%	1.28%	5.68%	1.35%	-2.64%	-0.07%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

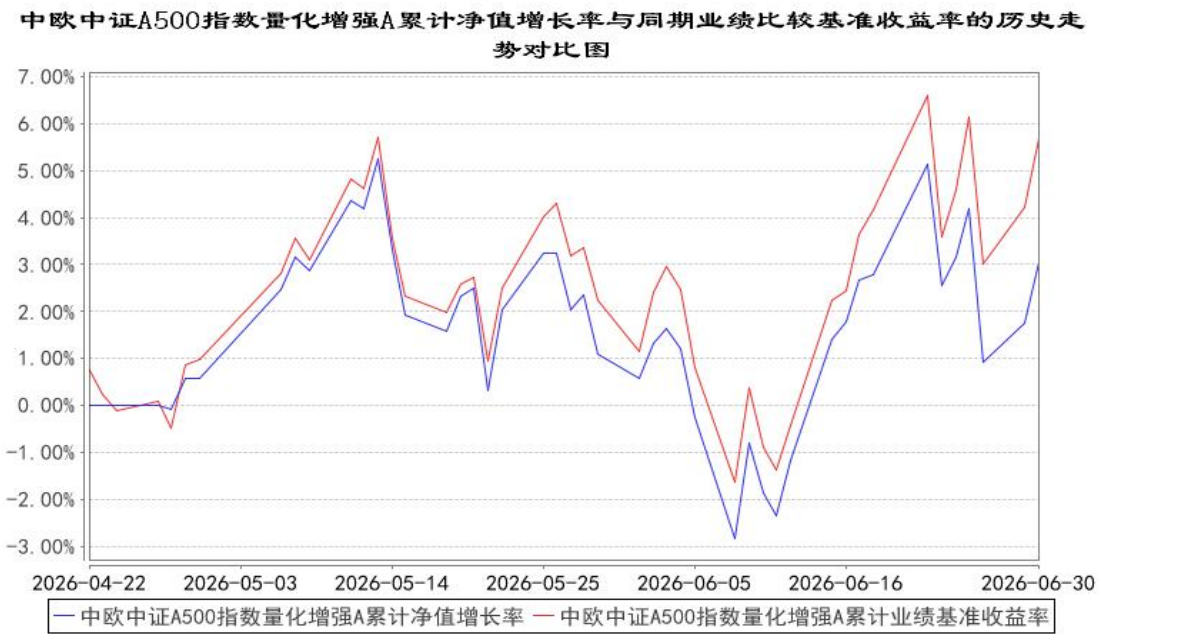
注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧中证 A500 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
自基金合同生效起 至今	3.01%	1.29%	5.68%	1.35%	-2.67%	-0.06%

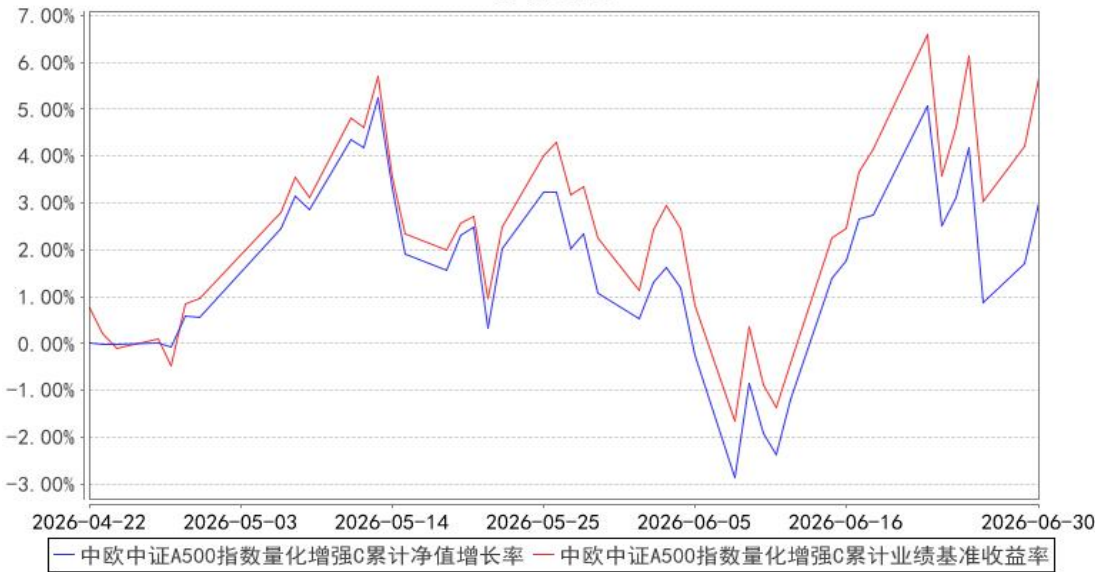
注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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



注：本基金基金合同生效日期为 2026 年 4 月 22 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

中欧中证A500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



注：本基金基金合同生效日期为 2026 年 4 月 22 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理 / 基金经理助理	2026-04-22	-	10 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任分析师、基金经理助理。

徐熙宁	基金经理 / 基金经 理助理	2026-04- 27	-	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；徐熙宁担任本基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济在温和通胀、政策积极支持的背景下平稳运行，呈现外需相对稳定、内需逐步恢复、新动能表现较好的特点，并在二季度进一步确认了温和复苏的方向，海外则始终笼罩在不确定性之中，美伊冲突推升油价与美联储货币政策转鹰成为贯穿全程的两条外部压制线

索，而国内层面 3 月 PPI 同比 41 个月来首次转正、企业盈利拐点显现；行业层面，年初能源与资源板块成为亮点，但 5 月以来随大宗价格高位回落而明显调整，电子、通信为代表的“新质生产力”持续领涨，消费板块则全程偏弱。

因子表现方面，今年以来表现突出的因子中，动量与 Beta 表现最为强劲，说明市场呈现显著的趋势行情，资金积极追逐高弹性资产。同时，成长性因子表现亮眼。相对而言，基本面质量与价值因子表现承压。投资质量、短期反转及盈利质量的表现偏弱，说明市场对传统防御性质量因子并不买账。市场呈现出极强的动量延续效应。

本基金是以中证 A500 指数为标的指数的指数增强基金，对标标的指数保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差力争控制在合理范围内。整体组合持仓较为分散。本基金的选股策略是基于交易所深度行情和上市公司基本面等信息，应用数量化的投资方法，系统性地捕捉市场的非有效性，追求穿越周期的稳健超额。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准收益率为 5.68%；基金 C 类份额净值增长率为 3.01%，同期业绩比较基准收益率为 5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：中欧中证 A500 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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	48,032,437.80
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	791,791,705.87
其中：股票投资		771,507,596.28
基金投资		—
债券投资		20,284,109.59
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资		—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资		—
其他权益工具投资		—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		1,181,156.87
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		841,005,300.54
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		9,975,294.25
应付清算款		—
应付赎回款		4,617,971.16

应付管理人报酬		659,386.10
应付托管费		123,634.88
应付销售服务费		19,362.57
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	36,561.56
负债合计		15,432,210.52
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	801,214,217.08
未分配利润	6.4.7.8	24,358,872.94
净资产合计		825,573,090.02
负债和净资产总计		841,005,300.54

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 801,214,217.08 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0304 元，基金份额总额 704,239,588.33 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0301 元，基金份额总额 96,974,628.75 份。

2. 本基金基金合同于 2026 年 04 月 22 日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		53,556,513.69
1. 利息收入		158,481.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,532.60
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		100,949.04
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,330,275.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	41,909,025.89
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,747.95
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	6,418,501.18

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	4,833,077.70
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	234,679.33
减：二、营业总支出		2,279,288.60
1. 管理人报酬		1,830,289.21
2. 托管费		343,179.22
3. 销售服务费		64,821.23
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		429.21
其中：卖出回购金融资产支出		429.21
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		5.83
8. 其他费用	6.4.7.18	40,563.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,277,225.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,277,225.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		51,277,225.09

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,812,372,783.51	-	-	1,812,372,783.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,011,158,566.43	-	24,358,872.94	-986,799,693.49
（一）、综合收益总额	-	-	51,277,225.09	51,277,225.09
（二）、本期基金份额交易产生的	-1,011,158,566	-	-26,918,352.15	-1,038,076,918.5

净资产变动数 （净资产减少以 “-”号填列）	. 43			8
其中：1. 基金申 购款	401, 794, 286. 75	-	9, 240, 799. 87	411, 035, 086. 62
2. 基金赎 回款	-1, 412, 952, 853 . 18	-	-36, 159, 152. 02	-1, 449, 112, 005. 2 0
（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	801, 214, 217. 08	-	24, 358, 872. 94	825, 573, 090. 02

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
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

中欧中证 A500 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[2026]3 号《关于准予中欧中证 A500 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《中欧中证 A500 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 1,812,067,877.34 元，经向中国证监会备案，《中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,812,372,783.51 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 304,906.17 份基金份额。

本基金最新情况见 2. 基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）和其他相

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资

产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值原则如下：

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相

互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(2) 投资收益

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

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

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

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持

证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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

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

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益

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

(4) 信用减值损失

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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

(3) 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外, 同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2. 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复缴纳增值税;取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。

3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市

场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	13,433,661.69
等于：本金	13,431,814.29
加：应计利息	1,847.40
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	34,598,776.11
等于：本金	34,597,362.49
加：应计利息	1,413.62
减：坏账准备	—
合计	48,032,437.80

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		766,673,898.58	-	771,507,596.28	4,833,697.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,262,620.00	22,109.59	20,284,109.59	-620.00
	合计	20,262,620.00	22,109.59	20,284,109.59	-620.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		786,936,518.58	22,109.59	791,791,705.87	4,833,077.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	334.96
其中：交易所市场	-
银行间市场	334.96
应付利息	-

预提费用-信息披露费	24,803.10
预提费用-审计费	10,472.70
其他应付	950.80
合计	36,561.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 A500 指数量化增强 A

项目	本期	
	2026 年 4 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,464,763,355.03	1,464,763,355.03
本期申购	377,460,866.32	377,460,866.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,137,984,633.02	-1,137,984,633.02
本期末	704,239,588.33	704,239,588.33

中欧中证 A500 指数量化增强 C

项目	本期	
	2026 年 4 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	347,609,428.48	347,609,428.48
本期申购	24,333,420.43	24,333,420.43
本期赎回（以“-”号填列）	-274,968,220.16	-274,968,220.16
本期末	96,974,628.75	96,974,628.75

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同于 2026 年 04 月 22 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,812,372,783.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 304,906.17 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证 A500 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	39,832,063.91	4,441,814.97	44,273,878.88
本期基金份额交易产生的变动数	-10,231,582.99	-12,598,376.81	-22,829,959.80
其中：基金申购款	8,862,206.68	-172,535.90	8,689,670.78
基金赎回款	-19,093,789.67	-12,425,840.91	-31,519,630.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,600,480.92	-8,156,561.84	21,443,919.08

中欧中证 A500 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
基金合同生效日	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	6,612,083.48	391,262.73	7,003,346.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,573,972.39	-1,514,419.96	-4,088,392.35
其中：基金申购款	569,486.49	-18,357.40	551,129.09
基金赎回款	-3,143,458.88	-1,496,062.56	-4,639,521.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,038,111.09	-1,123,157.23	2,914,953.86

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,489.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	16,042.88
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	57,532.60

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 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,284,814,115.84
减：卖出股票成本总额	2,240,439,524.30
减：交易费用	2,465,565.65
买卖股票差价收入	41,909,025.89

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4月22日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,947.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-200.00
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	2,747.95

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4月22日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	-200.00

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4月22日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,418,501.18
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	6,418,501.18

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4月22日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	4,833,077.70
股票投资	4,833,697.70
债券投资	-620.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	4,833,077.70

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	234,678.81
基金转换费收入	0.52
合计	234,679.33

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 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	10,472.70
信息披露费	24,803.10
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,488.10
开户费	800.00
合计	40,563.90

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
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 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,830,289.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	647,719.76
应支付基金管理人的净管理费	1,182,569.45

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，自动在次月第 2 个工作日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 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	343,179.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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，自动在次月第 2 个工作日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

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 0.20%。
计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提。

- （1）基金管理人直销渠道：
- 对于基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。基金销售子公司销售母公司所管理基金的，按照本条要求执行。
- （2）其他销售机构：
- 对于投资者持续持有期限未超过一年（即 365 天，下同）的基金份额计提的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中按照指定的账户路径一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。对于持续持有期限超过一年的基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。其中，持续持有期限为基金合同生效日（针对募集期内认购的基金份额）或该笔份额申购、转入确认日与赎回、转出确认日或基金合同终止情形发生日下一工作日的间隔天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金各类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	13,433,661.69	41,489.72

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

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
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	2,474	1,582,588.41	2,175,957.22	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,975,294.25 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220208	22 国开 08	2026 年 7 月 7 日	101.42	105,000	10,649,157.53
合计				105,000	10,649,157.53

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理

措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制 在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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	48,032,437.80	-	-	-	48,032,437.80
交易性金融资产	20,284,109.59	-	-	-771,507,596.28	791,791,705.87
应收申购款	-	-	-	1,181,156.87	1,181,156.87
资产总计	68,316,547.39	-	-	-772,688,753.15	841,005,300.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,617,971.16	4,617,971.16
应付管理人报酬	-	-	-	659,386.10	659,386.10
应付托管费	-	-	-	123,634.88	123,634.88

卖出回购金融资产款	9,975,294.25	-	-	-	9,975,294.25
应付销售服务费	-	-	-	19,362.57	19,362.57
其他负债	-	-	-	36,561.56	36,561.56
负债总计	9,975,294.25	-	-	5,456,916.27	15,432,210.52
利率敏感度缺口	58,341,253.14	-	-	-767,231,836.88	825,573,090.02

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 2.46%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	771,507,596.28	93.45
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	771, 507, 596. 28	93. 45
----	-------------------	--------

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）
	业绩比较基准上升 5%	38, 273, 185. 06
	业绩比较基准下降 5%	-38, 273, 185. 06

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	769, 331, 639. 06
第二层次	22, 460, 066. 81
第三层次	-
合计	791, 791, 705. 87

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、

交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	771,507,596.28	91.74
	其中：股票	771,507,596.28	91.74
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,284,109.59	2.41
	其中：债券	20,284,109.59	2.41
	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	48,032,437.80	5.71
8	其他各项资产	1,181,156.87	0.14
9	合计	841,005,300.54	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	325,407.00	0.04
B	采矿业	31,372,752.80	3.80
C	制造业	415,326,811.19	50.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	22,253,277.00	2.70

	业		
E	建筑业	3,366,812.00	0.41
F	批发和零售业	11,023,718.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	20,615,034.76	2.50
H	住宿和餐饮业	315,588.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,564,338.07	3.70
J	金融业	107,959,976.63	13.08
K	房地产业	3,091,905.00	0.37
L	租赁和商务服务业	4,526,060.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	5,266,204.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	2,657,319.40	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,130.00	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,108,140.00	0.13
	合计	659,777,473.85	79.92

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	624,815.00	0.08
B	采矿业	1,442,489.00	0.17
C	制造业	79,336,443.03	9.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	527,905.00	0.06
E	建筑业	458,992.00	0.06
F	批发和零售业	4,955,951.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	395,670.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,020,165.15	0.73
J	金融业	5,578,231.00	0.68
K	房地产业	1,082,735.00	0.13
L	租赁和商务服务业	2,842,984.00	0.34

M	科学研究和技术服务业	3, 066, 533. 86	0. 37
N	水利、环境和公共设施管理业	1, 871, 156. 39	0. 23
O	居民服务、修理和其他服务业	623, 100. 00	0. 08
P	教育	953, 064. 00	0. 12
Q	卫生和社会工作	74, 144. 00	0. 01
R	文化、体育和娱乐业	1, 875, 744. 00	0. 23
S	综合	-	-
	合计	111, 730, 122. 43	13. 53

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	23, 200	29, 464, 000. 00	3. 57
2	600030	中信证券	737, 525	21, 189, 093. 25	2. 57
3	300750	宁德时代	45, 720	17, 968, 417. 20	2. 18
4	300502	新易盛	27, 973	16, 979, 611. 00	2. 06
5	601211	国泰海通	715, 400	13, 020, 280. 00	1. 58
6	600036	招商银行	338, 900	12, 030, 950. 00	1. 46
7	601988	中国银行	1, 626, 800	9, 305, 296. 00	1. 13
8	688256	寒武纪	5, 678	9, 059, 532. 90	1. 10
9	603986	兆易创新	10, 900	8, 883, 500. 00	1. 08
10	300059	东方财富	398, 101	8, 113, 298. 38	0. 98
11	601166	兴业银行	464, 500	7, 692, 120. 00	0. 93
12	600183	生益科技	42, 700	7, 404, 180. 00	0. 90
13	000001	平安银行	699, 400	7, 028, 970. 00	0. 85
14	688041	海光信息	18, 390	6, 809, 817. 00	0. 82
15	002475	立讯精密	95, 700	6, 737, 280. 00	0. 82
16	601899	紫金矿业	261, 400	6, 571, 596. 00	0. 80
17	601766	中国中车	1, 260, 700	6, 555, 640. 00	0. 79
18	601328	交通银行	1, 008, 500	6, 484, 655. 00	0. 79
19	002384	东山精密	24, 700	6, 480, 045. 00	0. 78
20	600900	长江电力	241, 800	6, 400, 446. 00	0. 78
21	600000	浦发银行	721, 600	6, 212, 976. 00	0. 75
22	300408	三环集团	36, 700	6, 125, 230. 00	0. 74
23	688981	中芯国际	38, 566	6, 125, 052. 12	0. 74

24	002371	北方华创	6,200	5,484,272.00	0.66
25	000100	TCL 科技	912,600	5,311,332.00	0.64
26	688012	中微公司	11,171	5,233,613.50	0.63
27	601985	中国核电	557,600	5,035,128.00	0.61
28	688008	澜起科技	15,868	4,917,493.20	0.60
29	600276	恒瑞医药	90,800	4,725,232.00	0.57
30	600487	亨通光电	40,500	4,428,270.00	0.54
31	603259	药明康德	34,400	4,283,144.00	0.52
32	600886	国投电力	319,200	4,248,552.00	0.51
33	600150	中国船舶	121,700	4,112,243.00	0.50
34	300274	阳光电源	25,800	4,102,716.00	0.50
35	688498	源杰科技	2,144	4,043,584.00	0.49
36	002049	紫光国微	45,300	4,020,375.00	0.49
37	300475	香农芯创	13,400	4,020,000.00	0.49
38	300476	胜宏科技	11,100	3,845,373.00	0.47
39	300857	协创数据	11,000	3,738,900.00	0.45
40	600029	南方航空	705,182	3,652,842.76	0.44
41	601318	中国平安	72,800	3,475,472.00	0.42
42	002916	深南电路	7,500	3,434,250.00	0.42
43	000338	潍柴动力	124,600	3,395,350.00	0.41
44	600008	首创环保	1,220,500	3,319,760.00	0.40
45	002463	沪电股份	21,300	3,254,640.00	0.39
46	000725	京东方 A	374,700	3,252,396.00	0.39
47	601628	中国人寿	91,800	3,245,130.00	0.39
48	002064	华峰化学	341,800	3,243,682.00	0.39
49	603799	华友钴业	66,700	3,218,942.00	0.39
50	600489	中金黄金	178,100	3,214,705.00	0.39
51	600176	中国巨石	44,100	3,214,008.00	0.39
52	601601	中国太保	112,600	3,211,352.00	0.39
53	300458	全志科技	80,100	3,160,746.00	0.38
54	601919	中远海控	237,400	3,147,924.00	0.38
55	300033	同花顺	12,900	3,108,900.00	0.38
56	002415	海康威视	90,500	3,095,100.00	0.37
57	600711	盛屯矿业	280,500	3,077,085.00	0.37
58	000425	徐工机械	380,200	3,075,818.00	0.37
59	002028	思源电气	17,700	3,062,100.00	0.37
60	300124	汇川技术	45,800	3,037,914.00	0.37
61	000938	紫光股份	100,600	2,903,316.00	0.35
62	000932	华菱钢铁	831,100	2,883,917.00	0.35
63	603993	洛阳钼业	162,500	2,851,875.00	0.35
64	002602	世纪华通	195,500	2,756,550.00	0.33
65	300014	亿纬锂能	42,100	2,737,763.00	0.33
66	600031	三一重工	156,000	2,695,680.00	0.33

67	600115	中国东航	691,300	2,633,853.00	0.32
68	300604	长川科技	7,700	2,628,934.00	0.32
69	000519	中兵红箭	124,500	2,623,215.00	0.32
70	688521	芯原股份	7,045	2,614,681.30	0.32
71	688469	芯联集成	246,334	2,613,603.74	0.32
72	000792	盐湖股份	84,801	2,560,142.19	0.31
73	300223	北京君正	10,100	2,513,890.00	0.30
74	002273	水晶光电	70,200	2,490,696.00	0.30
75	002008	大族激光	16,200	2,431,782.00	0.29
76	000333	美的集团	32,100	2,424,513.00	0.29
77	002130	沃尔核材	126,100	2,390,856.00	0.29
78	300394	天孚通信	7,860	2,379,064.80	0.29
79	002353	杰瑞股份	15,500	2,363,750.00	0.29
80	000426	兴业银锡	71,600	2,359,936.00	0.29
81	000657	中钨高新	24,600	2,354,712.00	0.29
82	600998	九州通	501,900	2,353,911.00	0.29
83	601600	中国铝业	283,400	2,329,548.00	0.28
84	002436	兴森科技	45,500	2,318,225.00	0.28
85	600018	上港集团	486,300	2,295,336.00	0.28
86	600362	江西铜业	52,900	2,290,570.00	0.28
87	601111	中国国航	377,900	2,286,295.00	0.28
88	300568	星源材质	121,900	2,281,968.00	0.28
89	601168	西部矿业	83,100	2,255,334.00	0.27
90	601872	招商轮船	124,800	2,192,736.00	0.27
91	000630	铜陵有色	343,400	2,184,024.00	0.26
92	688072	拓荆科技	2,474	2,175,957.22	0.26
93	300418	昆仑万维	53,000	2,139,080.00	0.26
94	000683	博源化工	363,500	2,093,760.00	0.25
95	300017	网宿科技	157,800	2,052,978.00	0.25
96	300748	金力永磁	65,900	2,033,015.00	0.25
97	002493	荣盛石化	187,000	2,010,250.00	0.24
98	601225	陕西煤业	98,600	2,006,510.00	0.24
99	600549	厦门钨业	23,300	1,985,160.00	0.24
100	600535	天士力	149,200	1,973,916.00	0.24
101	600309	万华化学	28,500	1,949,685.00	0.24
102	002601	龙佰集团	117,101	1,929,824.48	0.23
103	002851	麦格米特	11,500	1,922,570.00	0.23
104	000831	中国稀土	34,600	1,919,954.00	0.23
105	000625	长安汽车	266,500	1,910,805.00	0.23
106	600153	建发股份	239,900	1,902,407.00	0.23
107	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	0.23
108	000032	深桑达 A	75,900	1,893,705.00	0.23
109	000878	云南铜业	118,100	1,875,428.00	0.23

110	002532	天山铝业	172,800	1,854,144.00	0.22
111	688525	佰维存储	3,741	1,850,784.93	0.22
112	600674	川投能源	129,700	1,837,849.00	0.22
113	300450	先导智能	45,100	1,836,472.00	0.22
114	600482	中国动力	55,500	1,820,400.00	0.22
115	600875	东方电气	62,500	1,798,125.00	0.22
116	002465	海格通信	140,600	1,795,462.00	0.22
117	000807	云铝股份	80,700	1,786,698.00	0.22
118	002155	湖南黄金	73,900	1,763,993.00	0.21
119	603885	吉祥航空	169,100	1,740,039.00	0.21
120	300118	东方日升	139,400	1,735,530.00	0.21
121	600352	浙江龙盛	141,700	1,715,987.00	0.21
122	300073	当升科技	35,500	1,705,420.00	0.21
123	688578	艾力斯	15,500	1,692,600.00	0.21
124	603939	益丰药房	93,800	1,686,524.00	0.20
125	000733	振华科技	29,400	1,665,216.00	0.20
126	300136	信维通信	13,700	1,633,725.00	0.20
127	002648	卫星化学	69,500	1,632,555.00	0.20
128	600019	宝钢股份	300,000	1,629,000.00	0.20
129	600989	宝丰能源	79,600	1,618,268.00	0.20
130	002738	中矿资源	27,200	1,604,528.00	0.19
131	601857	中国石油	180,800	1,569,344.00	0.19
132	002517	恺英网络	96,000	1,560,000.00	0.19
133	002414	高德红外	116,600	1,546,116.00	0.19
134	688617	惠泰医疗	8,480	1,539,628.80	0.19
135	600418	江淮汽车	59,600	1,539,468.00	0.19
136	688266	泽璟制药	13,190	1,538,745.40	0.19
137	600522	中天科技	25,300	1,535,204.00	0.19
138	002080	中材科技	16,900	1,521,000.00	0.18
139	002281	光迅科技	5,900	1,515,946.00	0.18
140	600588	用友网络	165,100	1,515,618.00	0.18
141	601658	邮储银行	305,400	1,505,622.00	0.18
142	300432	富临精工	74,100	1,488,669.00	0.18
143	002179	中航光电	31,700	1,464,540.00	0.18
144	600392	盛和资源	48,800	1,452,776.00	0.18
145	300454	深信服	15,100	1,452,620.00	0.18
146	600887	伊利股份	60,500	1,449,580.00	0.18
147	002176	江特电机	142,059	1,422,010.59	0.17
148	688396	华润微	14,560	1,420,328.00	0.17
149	688347	华虹宏力	4,207	1,414,814.10	0.17
150	000623	吉林敖东	76,500	1,356,345.00	0.16
151	600690	海尔智家	66,100	1,349,101.00	0.16
152	300661	圣邦股份	9,400	1,348,712.00	0.16

153	600011	华能国际	175,200	1,329,768.00	0.16
154	601799	星宇股份	14,600	1,323,052.00	0.16
155	002001	新 和 成	46,500	1,321,530.00	0.16
156	002600	领益智造	75,200	1,303,968.00	0.16
157	600346	恒力石化	72,500	1,283,975.00	0.16
158	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.15
159	300757	罗博特科	2,000	1,238,000.00	0.15
160	300803	指南针	13,500	1,237,545.00	0.15
161	600893	航发动力	32,100	1,230,714.00	0.15
162	002497	雅化集团	60,400	1,230,348.00	0.15
163	600166	福田汽车	422,500	1,229,475.00	0.15
164	002266	浙富控股	241,910	1,224,064.60	0.15
165	301358	湖南裕能	16,100	1,221,507.00	0.15
166	603766	隆鑫通用	101,800	1,214,474.00	0.15
167	002891	中宠股份	43,500	1,162,320.00	0.14
168	002120	韵达股份	181,600	1,154,976.00	0.14
169	601058	赛轮轮胎	100,100	1,154,153.00	0.14
170	002938	鹏鼎控股	10,800	1,138,104.00	0.14
171	000538	云南白药	23,900	1,132,143.00	0.14
172	600988	赤峰黄金	42,700	1,123,864.00	0.14
173	601117	中国化学	152,900	1,123,815.00	0.14
174	300054	鼎龙股份	10,600	1,123,282.00	0.14
175	600516	方大炭素	181,300	1,118,621.00	0.14
176	600028	中国石化	250,300	1,116,338.00	0.14
177	600673	东阳光	33,000	1,108,140.00	0.13
178	002126	银轮股份	22,200	1,105,560.00	0.13
179	301078	孩子王	162,200	1,096,472.00	0.13
180	300049	福瑞医科	27,800	1,080,864.00	0.13
181	688065	凯赛生物	22,497	1,076,481.45	0.13
182	002027	分众传媒	221,700	1,073,028.00	0.13
183	601233	桐昆股份	49,100	1,063,015.00	0.13
184	000933	神火股份	49,000	1,038,800.00	0.13
185	300438	鹏辉能源	12,500	1,035,625.00	0.13
186	300972	万辰集团	5,800	1,005,778.00	0.12
187	000408	藏格矿业	14,500	1,005,140.00	0.12
188	300115	长盈精密	35,800	1,000,252.00	0.12
189	002544	普天科技	54,300	989,346.00	0.12
190	300442	润泽科技	11,900	988,533.00	0.12
191	600050	中国联通	245,700	982,800.00	0.12
192	688180	君实生物	28,835	975,199.70	0.12
193	600938	中国海油	35,000	950,250.00	0.12
194	601360	三六零	108,000	938,520.00	0.11
195	300390	天华新能	9,900	925,749.00	0.11

196	000830	鲁西化工	77,100	925,200.00	0.11
197	002025	航天电器	11,600	884,152.00	0.11
198	002603	以岭药业	58,000	870,000.00	0.11
199	002558	巨人网络	30,800	848,848.00	0.10
200	600316	洪都航空	30,300	846,582.00	0.10
201	600862	中航高科	46,800	843,804.00	0.10
202	000967	盈峰环境	79,200	833,976.00	0.10
203	601728	中国电信	158,900	824,691.00	0.10
204	300751	迈为股份	2,900	819,134.00	0.10
205	300759	康龙化成	27,800	804,254.00	0.10
206	688120	华海清科	2,452	789,985.36	0.10
207	000975	山金国际	46,400	788,800.00	0.10
208	601100	恒立液压	7,300	785,188.00	0.10
209	000034	神州数码	27,580	765,345.00	0.09
210	300058	蓝色光标	55,600	765,056.00	0.09
211	603568	伟明环保	49,560	762,232.80	0.09
212	688009	中国通号	159,856	760,914.56	0.09
213	300866	安克创新	7,100	741,950.00	0.09
214	002756	永兴材料	13,000	736,320.00	0.09
215	688213	思特威	6,781	726,041.67	0.09
216	603659	璞泰来	24,500	708,785.00	0.09
217	300457	赢合科技	33,600	708,288.00	0.09
218	600515	海南机场	258,100	707,194.00	0.09
219	601816	京沪高铁	156,000	706,680.00	0.09
220	688002	睿创微纳	4,534	701,364.46	0.08
221	601615	明阳智能	59,700	690,729.00	0.08
222	605117	德业股份	6,500	690,170.00	0.08
223	688166	博瑞医药	19,640	687,596.40	0.08
224	688005	容百科技	22,419	686,021.40	0.08
225	002432	九安医疗	9,700	685,596.00	0.08
226	600547	山东黄金	29,620	683,925.80	0.08
227	600584	长电科技	6,600	683,430.00	0.08
228	688472	阿特斯	62,246	673,501.72	0.08
229	000977	浪潮信息	9,500	665,000.00	0.08
230	300724	捷佳伟创	9,200	649,520.00	0.08
231	000738	航发控制	34,900	638,321.00	0.08
232	000035	中国天楹	130,400	629,832.00	0.08
233	688331	荣昌生物	4,767	620,949.42	0.08
234	000988	华工科技	3,300	609,213.00	0.07
235	600026	中远海能	33,200	595,608.00	0.07
236	603650	彤程新材	6,000	587,880.00	0.07
237	600208	衢州发展	206,400	584,112.00	0.07
238	000157	中联重科	83,800	584,086.00	0.07

239	000786	北新建材	31,800	575,262.00	0.07
240	603806	福斯特	33,900	569,181.00	0.07
241	601319	中国人保	82,700	559,052.00	0.07
242	601216	君正集团	122,100	544,566.00	0.07
243	001979	招商蛇口	84,500	543,335.00	0.07
244	000568	泸州老窖	7,000	542,640.00	0.07
245	300567	精测电子	1,700	539,920.00	0.07
246	002078	太阳纸业	42,200	527,078.00	0.06
247	601677	明泰铝业	30,400	504,640.00	0.06
248	002555	三七互娱	26,300	496,281.00	0.06
249	600426	华鲁恒升	20,500	490,360.00	0.06
250	600196	复星医药	21,500	483,105.00	0.06
251	688599	天合光能	34,121	481,788.52	0.06
252	300433	蓝思科技	8,800	472,208.00	0.06
253	300763	锦浪科技	5,100	460,785.00	0.06
254	600521	华海药业	31,900	459,360.00	0.06
255	600177	雅戈尔	60,900	458,577.00	0.06
256	300573	兴齐眼药	11,200	456,512.00	0.06
257	002050	三花智控	10,400	455,832.00	0.06
258	601155	新城控股	44,200	453,492.00	0.05
259	603979	金诚信	7,500	442,725.00	0.05
260	000039	中集集团	54,400	441,184.00	0.05
261	600741	华域汽车	27,900	433,008.00	0.05
262	300919	中伟新材	9,700	424,375.00	0.05
263	601567	三星电气	28,200	421,308.00	0.05
264	002821	凯莱英	2,600	421,200.00	0.05
265	600415	小商品城	40,900	415,544.00	0.05
266	002244	滨江集团	54,500	414,200.00	0.05
267	601088	中国神华	10,600	413,824.00	0.05
268	300395	菲利华	3,000	401,190.00	0.05
269	600499	科达制造	28,900	398,820.00	0.05
270	002185	华天科技	17,400	388,194.00	0.05
271	688676	金盘科技	4,513	381,980.32	0.05
272	002131	利欧股份	77,900	370,025.00	0.04
273	600839	四川长虹	52,500	366,450.00	0.04
274	002460	赣锋锂业	5,600	366,240.00	0.04
275	301550	斯菱智驱	4,000	365,720.00	0.04
276	600219	南山铝业	90,800	362,292.00	0.04
277	600089	特变电工	16,100	362,250.00	0.04
278	000960	锡业股份	8,300	354,327.00	0.04
279	300782	卓胜微	3,200	350,656.00	0.04
280	600039	四川路桥	44,500	347,990.00	0.04
281	000002	万科 A	115,700	342,472.00	0.04

282	002714	牧原股份	9,300	325,407.00	0.04
283	688777	中控技术	2,723	319,952.50	0.04
284	300558	贝达药业	4,900	318,843.00	0.04
285	600258	首旅酒店	28,900	315,588.00	0.04
286	002812	恩捷股份	4,600	307,786.00	0.04
287	000400	许继电气	14,000	303,800.00	0.04
288	002271	东方雨虹	25,300	300,311.00	0.04
289	600486	扬农化工	5,600	283,920.00	0.03
290	601288	农业银行	46,500	282,255.00	0.03
291	002085	万丰奥威	25,000	277,250.00	0.03
292	600096	云天化	9,100	276,640.00	0.03
293	002340	格林美	38,900	257,129.00	0.03
294	000617	中油资本	39,000	257,010.00	0.03
295	300677	英科医疗	6,100	238,937.00	0.03
296	002422	科伦药业	5,700	219,564.00	0.03
297	601000	唐山港	50,300	208,745.00	0.03
298	601127	赛力斯	3,400	208,250.00	0.03
299	300207	欣旺达	10,500	199,395.00	0.02
300	002128	电投能源	7,900	182,648.00	0.02
301	300676	华大基因	5,100	178,806.00	0.02
302	002294	信立泰	5,600	178,584.00	0.02
303	002065	东华软件	22,600	161,364.00	0.02
304	688047	龙芯中科	975	150,803.25	0.02
305	002831	裕同科技	4,000	142,240.00	0.02
306	002595	豪迈科技	3,050	142,130.00	0.02
307	688099	晶晨股份	1,293	133,049.70	0.02
308	688390	固德威	1,152	125,003.52	0.02
309	603605	珀莱雅	1,900	113,848.00	0.01
310	688017	绿的谐波	223	93,182.78	0.01
311	000963	华东医药	3,300	92,796.00	0.01
312	002625	光启技术	3,000	90,960.00	0.01
313	300346	南大光电	900	83,385.00	0.01
314	605090	九丰能源	2,200	81,774.00	0.01
315	002318	久立特材	3,300	78,870.00	0.01
316	000423	东阿阿胶	1,600	72,576.00	0.01
317	002074	国轩高科	1,900	52,269.00	0.01
318	600663	陆家嘴	7,500	47,100.00	0.01
319	600323	瀚蓝环境	1,500	41,190.00	0.00
320	002292	奥飞娱乐	5,300	34,768.00	0.00
321	300409	道氏技术	1,400	27,902.00	0.00
322	600143	金发科技	1,700	26,265.00	0.00
323	688063	派能科技	378	20,136.06	0.00
324	002129	TCL 中环	1,400	16,828.00	0.00

325	600398	海澜之家	1,500	7,845.00	0.00
326	002223	鱼跃医疗	300	7,698.00	0.00
327	600529	山东药玻	300	5,535.00	0.00
328	300015	爱尔眼科	500	4,130.00	0.00
329	300339	润和软件	100	3,851.00	0.00
330	002091	江苏国泰	400	2,892.00	0.00
331	601668	中国建筑	300	1,302.00	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	601688	华泰证券	139,400	2,874,428.00	0.35
2	000607	华媒控股	719,100	2,207,637.00	0.27
3	600999	招商证券	68,900	1,453,790.00	0.18
4	688582	芯动联科	21,145	1,374,425.00	0.17
5	002197	证通电子	235,200	1,350,048.00	0.16
6	002913	奥士康	19,200	1,227,648.00	0.15
7	605218	伟时电子	69,800	1,153,794.00	0.14
8	000776	广发证券	44,900	1,050,660.00	0.13
9	301108	洁雅股份	44,300	1,045,037.00	0.13
10	300134	大富科技	122,100	1,043,955.00	0.13
11	603126	中材节能	159,800	1,006,740.00	0.12
12	000626	远大控股	157,700	998,241.00	0.12
13	300424	航新科技	61,800	972,732.00	0.12
14	300615	欣天科技	95,300	955,859.00	0.12
15	600455	博通股份	43,400	953,064.00	0.12
16	688329	艾隆科技	46,833	946,494.93	0.11
17	300939	秋田微	12,600	871,920.00	0.11
18	002645	华宏科技	31,600	869,316.00	0.11
19	301099	雅创电子	9,100	869,050.00	0.11
20	600336	澳柯玛	137,600	857,248.00	0.10
21	002885	京泉华	20,200	825,372.00	0.10
22	603999	读者传媒	162,100	810,500.00	0.10
23	300933	中辰股份	128,500	781,280.00	0.09
24	301085	亚康股份	12,800	775,808.00	0.09
25	601579	会稽山	52,300	768,287.00	0.09
26	000060	中金岭南	100,400	760,028.00	0.09
27	300120	经纬辉开	65,300	739,849.00	0.09
28	300128	锦富技术	124,400	736,448.00	0.09
29	003042	中农联合	60,300	732,645.00	0.09
30	001287	中电港	23,300	725,795.00	0.09
31	601700	风范股份	165,900	723,324.00	0.09
32	600356	恒丰纸业	97,100	719,511.00	0.09
33	300843	胜蓝股份	4,500	703,125.00	0.09

34	301391	卡莱特	12,300	702,330.00	0.09
35	301176	逸豪新材	10,000	680,000.00	0.08
36	603626	科森科技	35,900	664,150.00	0.08
37	603341	龙旗科技	15,600	662,844.00	0.08
38	605180	华生科技	54,700	648,195.00	0.08
39	688668	鼎通科技	1,716	640,582.80	0.08
40	601666	平煤股份	89,100	637,065.00	0.08
41	301177	迪阿股份	22,900	631,353.00	0.08
42	688062	迈威生物	22,342	631,161.50	0.08
43	300736	百邦科技	20,100	623,100.00	0.08
44	002755	奥赛康	45,400	618,348.00	0.07
45	603289	泰瑞机器	75,500	609,285.00	0.07
46	603332	苏州龙杰	59,700	603,567.00	0.07
47	002513	蓝丰生化	125,800	601,324.00	0.07
48	002299	圣农发展	38,900	589,724.00	0.07
49	688718	唯赛勃	36,913	589,500.61	0.07
50	002584	西陇科学	62,000	587,760.00	0.07
51	002443	金洲管道	61,500	586,095.00	0.07
52	300655	晶瑞电材	27,200	582,624.00	0.07
53	688110	东芯股份	2,764	563,026.80	0.07
54	301123	奕东电子	4,600	555,312.00	0.07
55	301012	扬电科技	23,600	554,364.00	0.07
56	688689	银河微电	8,390	543,000.80	0.07
57	300077	国民技术	17,200	539,220.00	0.07
58	600847	万里股份	38,500	519,365.00	0.06
59	002949	华阳国际	52,300	517,247.00	0.06
60	688226	威腾电气	11,488	492,031.04	0.06
61	000070	特发信息	23,400	487,656.00	0.06
62	300291	百纳千成	100,100	483,483.00	0.06
63	300552	万集科技	21,100	482,135.00	0.06
64	603519	立霸股份	31,500	481,950.00	0.06
65	002861	瀛通通讯	21,200	472,336.00	0.06
66	688701	卓锦股份	62,333	469,367.49	0.06
67	688257	新锐股份	4,530	461,607.00	0.06
68	002545	东方铁塔	28,400	460,648.00	0.06
69	688175	高凌信息	18,279	459,716.85	0.06
70	300270	中威电子	34,200	444,942.00	0.05
71	002809	红墙股份	59,600	443,424.00	0.05
72	300691	联合光电	27,800	439,518.00	0.05
73	688678	福立旺	18,143	438,516.31	0.05
74	300322	硕贝德	17,400	438,480.00	0.05
75	301189	奥尼电子	7,400	436,082.00	0.05
76	002897	意华股份	4,900	431,102.00	0.05

77	300579	数字认证	20,800	430,560.00	0.05
78	600353	旭光电子	9,400	428,640.00	0.05
79	301536	星宸科技	3,300	424,743.00	0.05
80	300363	博腾股份	25,900	420,616.00	0.05
81	001696	宗申动力	20,200	420,362.00	0.05
82	002824	和胜股份	12,100	418,418.00	0.05
83	002993	奥海科技	5,800	415,338.00	0.05
84	002888	惠威科技	18,700	411,026.00	0.05
85	688148	芳源股份	47,769	409,858.02	0.05
86	300797	钢研纳克	30,900	409,734.00	0.05
87	605007	五洲特纸	30,200	404,378.00	0.05
88	002715	登云股份	30,400	402,800.00	0.05
89	300894	火星人	31,700	398,152.00	0.05
90	301002	崧盛股份	10,300	397,580.00	0.05
91	688382	益方生物	21,868	393,624.00	0.05
92	688275	万润新能	3,065	390,940.75	0.05
93	600785	新华百货	39,800	390,040.00	0.05
94	300277	汽轮科技	25,600	385,024.00	0.05
95	000949	新乡化纤	60,300	382,302.00	0.05
96	002238	天威视讯	70,100	378,540.00	0.05
97	300323	华灿光电	18,500	377,400.00	0.05
98	603331	百达精工	34,800	370,968.00	0.04
99	603697	有友食品	38,500	369,215.00	0.04
100	300061	旗天科技	52,800	369,072.00	0.04
101	603345	安井食品	4,600	368,874.00	0.04
102	688365	光云科技	23,338	368,040.26	0.04
103	002290	禾盛新材	4,000	367,480.00	0.04
104	003029	吉大正元	22,800	365,256.00	0.04
105	002811	郑中设计	32,600	364,794.00	0.04
106	603320	迪贝电气	20,900	364,705.00	0.04
107	000509	华塑控股	96,900	361,437.00	0.04
108	002345	潮宏基	39,000	357,630.00	0.04
109	000020	深华发 A	32,500	354,250.00	0.04
110	300755	华致酒行	30,600	348,534.00	0.04
111	605088	冠盛股份	12,300	346,614.00	0.04
112	300761	立华股份	21,100	346,251.00	0.04
113	600955	维远股份	23,500	345,920.00	0.04
114	688262	国芯科技	7,996	345,667.08	0.04
115	300885	海昌新材	14,500	344,665.00	0.04
116	603958	哈森股份	20,200	342,188.00	0.04
117	603615	茶花股份	21,000	339,150.00	0.04
118	603326	我乐家居	54,800	337,568.00	0.04
119	300961	深水海纳	25,900	332,815.00	0.04

120	301285	鸿日达	3,000	330,990.00	0.04
121	002057	中钢天源	26,600	330,638.00	0.04
122	002412	汉森制药	59,800	328,900.00	0.04
123	002285	世联行	160,300	328,615.00	0.04
124	000697	炼石航空	31,600	328,008.00	0.04
125	002440	闰土股份	32,000	328,000.00	0.04
126	300817	双飞集团	21,000	327,600.00	0.04
127	300331	苏大维格	4,600	327,106.00	0.04
128	002159	三特索道	26,300	325,331.00	0.04
129	300672	国科微	1,100	324,500.00	0.04
130	002578	闽发铝业	101,000	318,150.00	0.04
131	300490	华自科技	24,000	317,520.00	0.04
132	603172	万丰股份	19,300	317,099.00	0.04
133	603127	昭衍新药	8,200	313,404.00	0.04
134	002655	共达电声	6,800	312,800.00	0.04
135	603268	松发股份	2,200	306,416.00	0.04
136	688221	前沿生物	13,623	305,155.20	0.04
137	603826	坤彩科技	11,900	304,164.00	0.04
138	688202	美迪西	3,766	303,953.86	0.04
139	000952	广济药业	55,600	301,352.00	0.04
140	301321	翰博高新	6,800	300,220.00	0.04
141	001360	南矿集团	16,800	297,192.00	0.04
142	002174	游族网络	23,500	296,335.00	0.04
143	300570	太辰光	1,200	296,052.00	0.04
144	601858	中国科传	17,100	296,001.00	0.04
145	002855	捷荣技术	31,100	295,450.00	0.04
146	600345	长江通信	4,500	294,795.00	0.04
147	600577	精达股份	30,000	293,400.00	0.04
148	301337	亚华电子	10,400	289,120.00	0.04
149	600714	金瑞矿业	14,000	287,420.00	0.03
150	001366	播恩集团	26,500	287,260.00	0.03
151	603042	华脉科技	19,930	286,992.00	0.03
152	600563	法拉电子	1,500	286,200.00	0.03
153	688416	恒烁股份	2,019	282,660.00	0.03
154	601121	宝地矿业	49,400	278,616.00	0.03
155	301025	读客文化	35,900	278,584.00	0.03
156	688793	倍轻松	17,284	278,445.24	0.03
157	000050	深天马 A	28,000	277,480.00	0.03
158	600280	中央商场	105,300	276,939.00	0.03
159	603166	福达股份	20,600	275,422.00	0.03
160	605066	天正电气	40,500	274,995.00	0.03
161	603968	醋化股份	29,200	270,392.00	0.03
162	605388	均瑶健康	55,200	266,616.00	0.03

163	603738	泰晶科技	4,400	264,220.00	0.03
164	601116	三江购物	26,600	262,542.00	0.03
165	600768	宁波富邦	17,500	262,150.00	0.03
166	300715	凯伦股份	15,900	261,714.00	0.03
167	603915	国茂股份	18,400	261,096.00	0.03
168	002793	罗欣药业	66,600	255,744.00	0.03
169	001260	坤泰股份	16,200	253,530.00	0.03
170	300373	扬杰科技	1,600	251,568.00	0.03
171	688367	工大高科	7,527	250,649.10	0.03
172	600773	西藏城投	19,400	249,678.00	0.03
173	300629	新劲刚	11,500	246,790.00	0.03
174	603182	嘉华股份	21,400	243,960.00	0.03
175	603588	高能环境	12,700	243,840.00	0.03
176	300709	精研科技	4,300	241,875.00	0.03
177	600683	京投发展	20,700	238,050.00	0.03
178	301116	益客食品	27,400	234,544.00	0.03
179	301205	联特科技	700	233,870.00	0.03
180	003023	彩虹集团	11,999	233,260.56	0.03
181	002623	亚玛顿	14,700	229,614.00	0.03
182	001230	劲旅环境	14,840	227,942.40	0.03
183	301246	宏源药业	8,400	225,960.00	0.03
184	301198	喜悦智行	16,500	221,100.00	0.03
185	603258	电魂网络	18,400	220,616.00	0.03
186	002484	江海股份	2,100	220,500.00	0.03
187	300882	万胜智能	13,200	218,856.00	0.03
188	600333	长春燃气	42,900	215,358.00	0.03
189	600149	廊坊发展	46,300	207,887.00	0.03
190	300987	川网传媒	16,700	205,410.00	0.02
191	002998	优彩资源	31,500	205,065.00	0.02
192	688553	汇宇制药	19,211	204,212.93	0.02
193	603755	日辰股份	9,000	204,210.00	0.02
194	600359	新农开发	37,800	204,120.00	0.02
195	603897	长城科技	6,200	201,252.00	0.02
196	300480	光力科技	4,700	200,596.00	0.02
197	600490	鹏欣资源	34,400	200,208.00	0.02
198	603711	香飘飘	17,800	197,758.00	0.02
199	301448	开创电气	4,300	195,134.00	0.02
200	300481	濮阳惠成	10,200	194,004.00	0.02
201	300623	捷捷微电	4,300	193,457.00	0.02
202	600498	烽火通信	2,600	191,360.00	0.02
203	002449	国星光电	24,600	190,650.00	0.02
204	605177	东亚药业	10,900	186,499.00	0.02
205	300808	久量股份	8,400	186,144.00	0.02

206	002766	索菱股份	52,300	184,619.00	0.02
207	605287	德才股份	4,400	182,556.00	0.02
208	002760	凤形股份	11,000	180,620.00	0.02
209	300576	容大感光	3,500	179,270.00	0.02
210	301163	宏德股份	7,900	175,222.00	0.02
211	301389	隆扬电子	2,000	173,580.00	0.02
212	001373	翔腾新材	5,700	171,855.00	0.02
213	603808	歌力思	22,600	171,082.00	0.02
214	301373	凌玮科技	1,100	171,050.00	0.02
215	688766	普冉股份	223	170,951.80	0.02
216	301132	满坤科技	3,200	168,064.00	0.02
217	603507	振江股份	5,100	167,739.00	0.02
218	600513	联环药业	11,200	162,848.00	0.02
219	301028	鼎熔岩	10,200	162,792.00	0.02
220	300448	浩云科技	28,100	161,856.00	0.02
221	000586	汇源通信	12,100	159,841.00	0.02
222	300955	嘉亨家化	4,400	158,796.00	0.02
223	002012	凯恩股份	23,900	153,199.00	0.02
224	300539	横河精密	7,500	152,775.00	0.02
225	688273	麦澜德	3,936	152,480.64	0.02
226	300745	欣锐科技	3,600	151,992.00	0.02
227	300263	隆华科技	9,200	149,960.00	0.02
228	605080	浙江自然	7,700	148,302.00	0.02
229	603090	宏盛股份	2,900	148,074.00	0.02
230	600232	金鹰股份	23,100	145,530.00	0.02
231	301287	康力源	4,500	145,305.00	0.02
232	688021	奥福科技	7,435	143,941.60	0.02
233	300726	宏达电子	1,700	143,769.00	0.02
234	301026	浩通科技	7,000	141,540.00	0.02
235	300688	创业黑马	5,200	140,920.00	0.02
236	001387	雪祺电气	11,000	140,470.00	0.02
237	300787	海能实业	15,100	137,712.00	0.02
238	688779	五矿新能	16,891	136,986.01	0.02
239	600919	江苏银行	12,600	135,828.00	0.02
240	002265	建设工业	7,800	135,720.00	0.02
241	600188	兖矿能源	7,500	133,275.00	0.02
242	600256	广汇能源	26,800	132,392.00	0.02
243	002702	海欣食品	29,600	131,720.00	0.02
244	003027	同兴科技	7,550	131,596.50	0.02
245	300319	麦捷科技	4,400	130,372.00	0.02
246	688539	高华科技	4,030	128,476.40	0.02
247	300606	金太阳	3,000	127,680.00	0.02
248	001337	四川黄金	3,400	124,644.00	0.02

248	601086	国芳集团	18,800	124,644.00	0.02
249	688061	灿瑞科技	2,504	124,373.68	0.02
250	002099	海翔药业	23,300	123,024.00	0.01
251	002800	天顺股份	9,400	122,106.00	0.01
252	688339	亿华通	6,452	120,652.40	0.01
253	300679	电连技术	2,000	119,980.00	0.01
254	300610	晨化股份	12,300	119,925.00	0.01
255	301098	金埔园林	14,600	119,720.00	0.01
256	000546	金圆股份	24,200	117,612.00	0.01
257	600246	万通发展	6,100	115,900.00	0.01
258	301032	新柴股份	12,400	115,320.00	0.01
259	300616	尚品宅配	11,000	114,620.00	0.01
260	301227	森鹰窗业	4,500	113,445.00	0.01
261	301136	招标股份	10,300	113,094.00	0.01
262	001282	三联锻造	5,500	112,090.00	0.01
263	002406	远东传动	17,000	111,520.00	0.01
264	002907	华森制药	8,400	111,468.00	0.01
265	600561	江西长运	22,400	110,880.00	0.01
266	300921	南凌科技	5,400	109,674.00	0.01
267	601566	九牧王	13,400	108,942.00	0.01
268	000695	滨海能源	8,600	107,500.00	0.01
269	002367	康力电梯	15,400	106,414.00	0.01
270	002228	合兴包装	36,100	106,134.00	0.01
271	600475	华光环能	6,800	103,700.00	0.01
272	000679	大连友谊	16,800	103,656.00	0.01
273	002796	世嘉科技	2,500	101,950.00	0.01
274	002826	易明医药	6,700	100,701.00	0.01
275	601231	环旭电子	3,100	100,440.00	0.01
276	301439	泓淋电力	6,300	99,036.00	0.01
277	002488	金固股份	11,000	98,010.00	0.01
278	000520	凤凰航运	25,200	93,996.00	0.01
279	002593	日上集团	23,100	92,169.00	0.01
280	600241	时代万恒	14,200	92,158.00	0.01
281	000863	三湘印象	21,900	91,980.00	0.01
282	688038	中科通达	5,410	90,996.20	0.01
283	002763	汇洁股份	13,400	90,986.00	0.01
284	603029	天鹅股份	6,400	89,984.00	0.01
285	002972	科安达	4,600	89,976.00	0.01
286	301515	港通医疗	5,000	87,650.00	0.01
287	002491	通鼎互联	2,700	87,480.00	0.01
288	300233	金城医药	6,600	81,840.00	0.01
289	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.01
290	000962	东方钽业	900	81,540.00	0.01

291	603703	盛洋科技	7,300	81,030.00	0.01
292	301500	飞南资源	3,100	80,755.00	0.01
293	688700	东威科技	876	78,314.40	0.01
294	002857	三晖电气	4,400	77,308.00	0.01
295	301212	联盛化学	3,300	77,055.00	0.01
296	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.01
297	000506	招金黄金	6,500	76,180.00	0.01
298	601061	中信金属	7,000	75,390.00	0.01
299	003001	中岩大地	5,800	75,110.00	0.01
300	605258	协和电子	2,200	74,536.00	0.01
301	300511	雪榕生物	14,800	74,444.00	0.01
302	688658	悦康药业	5,769	74,189.34	0.01
303	002524	光正眼科	22,400	74,144.00	0.01
304	002927	泰永长征	3,800	73,910.00	0.01
305	002862	实丰文化	5,600	71,848.00	0.01
306	002712	思美传媒	17,300	71,795.00	0.01
307	300834	星辉环材	1,700	71,060.00	0.01
308	000599	青岛双星	16,700	70,474.00	0.01
309	002866	传艺科技	4,300	70,305.00	0.01
310	001376	百通能源	6,700	69,680.00	0.01
311	002802	洪汇新材	6,600	69,432.00	0.01
312	603020	爱普股份	4,900	69,090.00	0.01
313	300317	珈伟新能	17,100	68,742.00	0.01
314	300839	博汇股份	5,800	67,918.00	0.01
315	001368	通达创智	3,300	67,881.00	0.01
316	301020	密封科技	3,100	67,704.00	0.01
317	301408	华人健康	4,700	67,586.00	0.01
318	000811	冰轮环境	1,200	67,464.00	0.01
319	301568	思泰克	600	66,960.00	0.01
320	603093	南华期货	3,500	63,525.00	0.01
321	600493	凤竹纺织	12,100	63,404.00	0.01
322	603989	艾华集团	1,200	63,000.00	0.01
323	300106	西部牧业	6,400	62,976.00	0.01
324	603536	惠发食品	7,600	59,204.00	0.01
325	300917	特发服务	2,400	58,512.00	0.01
326	001313	粤海饲料	8,200	58,138.00	0.01
327	002591	恒大高新	9,300	56,916.00	0.01
328	000968	蓝焰控股	9,500	56,905.00	0.01
329	002686	亿利达	11,000	56,650.00	0.01
330	300302	同有科技	1,100	56,287.00	0.01
331	600130	波导股份	12,700	56,261.00	0.01
332	301056	森赫股份	5,000	56,000.00	0.01
333	002115	三维通信	5,200	53,560.00	0.01

334	300637	扬帆新材	5,100	52,938.00	0.01
335	603719	良品铺子	5,900	51,035.00	0.01
336	603985	恒润股份	2,100	50,442.00	0.01
337	301383	天键股份	2,100	50,190.00	0.01
338	300547	川环科技	1,500	50,085.00	0.01
339	000045	深纺织 A	4,400	46,376.00	0.01
340	600189	泉阳泉	6,000	45,180.00	0.01
341	603179	新泉股份	900	44,685.00	0.01
342	002682	龙洲股份	10,200	43,248.00	0.01
343	600135	乐凯胶片	5,400	43,146.00	0.01
344	603960	克来机电	2,400	41,784.00	0.01
345	603286	日盈电子	900	41,067.00	0.00
346	600319	亚星化学	6,500	40,495.00	0.00
347	605567	春雪食品	4,800	38,352.00	0.00
348	603228	景旺电子	500	36,205.00	0.00
349	003003	天元股份	3,500	34,825.00	0.00
350	301193	家联科技	1,800	33,372.00	0.00
351	300523	辰安科技	1,800	33,084.00	0.00
352	002678	珠江钢琴	7,800	32,994.00	0.00
353	301507	民生健康	2,700	32,481.00	0.00
354	688028	沃尔德	200	31,174.00	0.00
355	600828	茂业商业	8,700	31,146.00	0.00
356	603886	元祖股份	2,300	29,394.00	0.00
357	300909	汇创达	500	29,110.00	0.00
358	300901	中胤时尚	1,900	28,063.00	0.00
359	002627	三峡旅游	4,900	27,979.00	0.00
360	600792	云煤能源	8,400	26,628.00	0.00
361	001278	一彬科技	1,700	26,146.00	0.00
362	300916	朗特智能	1,100	25,707.00	0.00
363	603324	盛剑科技	500	25,630.00	0.00
364	603569	长久物流	4,800	25,440.00	0.00
365	002692	远程股份	6,300	23,751.00	0.00
366	688335	复洁科技	915	21,996.60	0.00
367	603073	彩蝶实业	1,400	20,874.00	0.00
368	300766	每日互动	800	17,120.00	0.00
369	002745	木林森	1,100	13,805.00	0.00
370	002053	云南能投	1,400	13,762.00	0.00
371	600201	生物股份	1,100	12,815.00	0.00
372	002868	绿康生化	500	11,045.00	0.00
373	605028	世茂能源	500	10,650.00	0.00
374	002877	智能自控	1,400	9,856.00	0.00
375	300711	广哈通信	600	9,840.00	0.00
376	002301	齐心集团	1,300	9,399.00	0.00

377	002795	永和智控	1,400	9,366.00	0.00
378	000822	山东海化	2,300	9,246.00	0.00
379	002743	富煌钢构	2,300	8,878.00	0.00
380	300187	永清环保	1,700	8,585.00	0.00
381	688565	力源科技	776	7,333.20	0.00
382	601999	出版传媒	1,300	7,176.00	0.00
383	605222	起帆电缆	300	6,996.00	0.00
384	603110	东方材料	300	6,951.00	0.00
385	002250	联化科技	500	6,835.00	0.00
386	603916	苏博特	500	6,830.00	0.00
387	002397	梦洁股份	1,700	6,494.00	0.00
388	688619	罗普特	391	6,345.93	0.00
389	600969	郴电国际	800	6,104.00	0.00
390	300738	奥飞数据	300	6,066.00	0.00
391	603879	永悦科技	1,300	5,876.00	0.00
392	300658	延江股份	500	5,715.00	0.00
393	001332	锡装股份	140	5,497.80	0.00
394	301505	苏州规划	300	4,830.00	0.00
395	000779	甘咨询	600	4,674.00	0.00
396	000421	南京公用	900	4,464.00	0.00
397	301316	慧博云通	100	3,938.00	0.00
398	603727	博迈科	200	3,412.00	0.00
399	002107	沃华医药	500	2,845.00	0.00
400	300434	金石亚药	200	2,246.00	0.00
401	301081	严牌股份	100	1,368.00	0.00
402	002454	松芝股份	280	1,338.40	0.00
403	000995	皇台酒业	100	950.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	51,460,647.00	6.23
2	600030	中信证券	46,816,719.91	5.67
3	300750	宁德时代	42,224,051.80	5.11
4	600036	招商银行	35,316,237.00	4.28
5	300502	新易盛	27,995,746.00	3.39
6	601318	中国平安	23,248,990.00	2.82
7	601899	紫金矿业	21,933,521.28	2.66
8	300059	东方财富	21,896,573.89	2.65
9	601166	兴业银行	21,195,333.00	2.57
10	002475	立讯精密	20,778,596.00	2.52
11	601211	国泰海通	20,016,476.12	2.42
12	600900	长江电力	19,201,044.90	2.33

13	601988	中国银行	18,732,271.00	2.27
14	601168	西部矿业	18,267,334.00	2.21
15	600519	贵州茅台	17,943,211.00	2.17
16	601328	交通银行	17,681,736.00	2.14
17	688256	寒武纪	17,006,907.70	2.06
18	000333	美的集团	16,719,860.00	2.03
19	600000	浦发银行	16,114,447.00	1.95
20	000651	格力电器	16,096,886.60	1.95

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	31,933,431.00	3.87
2	600030	中信证券	26,547,590.00	3.22
3	300750	宁德时代	22,484,513.00	2.72
4	600036	招商银行	21,319,418.00	2.58
5	300502	新易盛	17,966,753.11	2.18
6	601318	中国平安	17,104,167.00	2.07
7	601168	西部矿业	16,205,245.00	1.96
8	688008	澜起科技	16,085,147.94	1.95
9	600519	贵州茅台	15,007,590.44	1.82
10	000651	格力电器	14,925,373.94	1.81
11	002475	立讯精密	14,878,680.00	1.80
12	600460	士兰微	14,751,436.00	1.79
13	000333	美的集团	14,364,160.00	1.74
14	300059	东方财富	14,073,935.00	1.70
15	002245	蔚蓝锂芯	13,985,643.80	1.69
16	688256	寒武纪	13,711,353.09	1.66
17	000725	京东方 A	13,059,529.00	1.58
18	600900	长江电力	12,560,923.00	1.52
19	601899	紫金矿业	12,499,660.72	1.51
20	601166	兴业银行	12,470,895.00	1.51

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	3,007,113,422.88
卖出股票收入（成交）总额	2,284,814,115.84

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,284,109.59	2.46
	其中：政策性金融债	20,284,109.59	2.46
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	20,284,109.59	2.46

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	220208	22 国开 08	200,000	20,284,109.59	2.46

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，适度参与国债期货投资。

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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,181,156.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,181,156.87

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
中欧中证 A500 指数 量化增强 A	4,013	175,489.56	3,017,650.33	0.43%	701,221,938.00	99.57%
中欧中证 A500 指数 量化增强 C	2,510	38,635.31	1,780,090.91	1.84%	95,194,537.84	98.16%
合计	6,523	122,829.10	4,797,741.24	0.60%	796,416,475.84	99.40%

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	中欧中证 A500 指数量化增强 A	3,284,316.03	0.47%
	中欧中证 A500 指数量化增强 C	0.00	0.00%
	合计	3,284,316.03	0.41%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责人 持有本开放式 基金	中欧中证 A500 指数量化增 强 A	0
	中欧中证 A500 指数量化增 强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧中证 A500 指数量化增 强 A	0
	中欧中证 A500 指数量化增 强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 A500 指数量化增强 A	中欧中证 A500 指数量化增强 C
基金合同生效日 (2026 年 4 月 22 日) 基金份额总额	1, 464, 763, 355. 03	347, 609, 428. 48
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	377, 460, 866. 32	24, 333, 420. 43
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	1, 137, 984, 633. 02	274, 968, 220. 16
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	704, 239, 588. 33	96, 974, 628. 75

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 (%)	
招商证券	3	5,291,927,538.72	100.00	984,513.44	100.00	-
华福证券	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 (%)
招商证券	-	-	710,000,000.0	100.00	-	-

			0			
华福证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2026-03-16
2	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2026-03-16
3	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2026-03-16
4	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-16
5	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2026-03-16
6	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2026-03-16
7	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
8	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2026-04-23
9	中欧中证 A500 指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-04-27
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