

中欧量化动力混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：海通证券股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 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，并由董事长签发。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 03 月 02 日起至 2022 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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
§ 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	中欧量化动力混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化动力混合	
基金主代码	015006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	127,625,425.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
下属分级基金的交易代码	015006	015007
报告期末下属分级基金的份额总额	62,851,001.87 份	64,774,423.65 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，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金还可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。

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	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95553
传真	021-33830351	021-63410637
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

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 层	上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦
邮政编码	200120	200001
法定代表人	窦玉明	周杰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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 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	2022 年 03 月 02 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
和指标	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
本期已实现收益	4,006,746.50	1,015,721.99
本期利润	7,863,920.24	6,897,848.93
加权平均基金份额本期利润	0.0743	0.0398
本期加权平均净值利润率	7.51%	4.05%
本期基金份额净值增长率	10.52%	10.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,442,443.53	4,438,276.30
期末可供分配基金份额利润	0.0707	0.0685
期末基金资产净	69,461,107.61	71,443,051.95

值		
期末基金份额净值	1.1052	1.1030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.52%	10.30%

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、所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 2022 年 3 月 2 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。

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

中欧量化动力混合 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
过去一个月	11.74%	1.10%	7.44%	0.90%	4.30%	0.20%
过去三个月	10.73%	1.29%	3.76%	1.32%	6.97%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.52%	1.10%	-3.27%	1.43%	13.79%	-0.33%

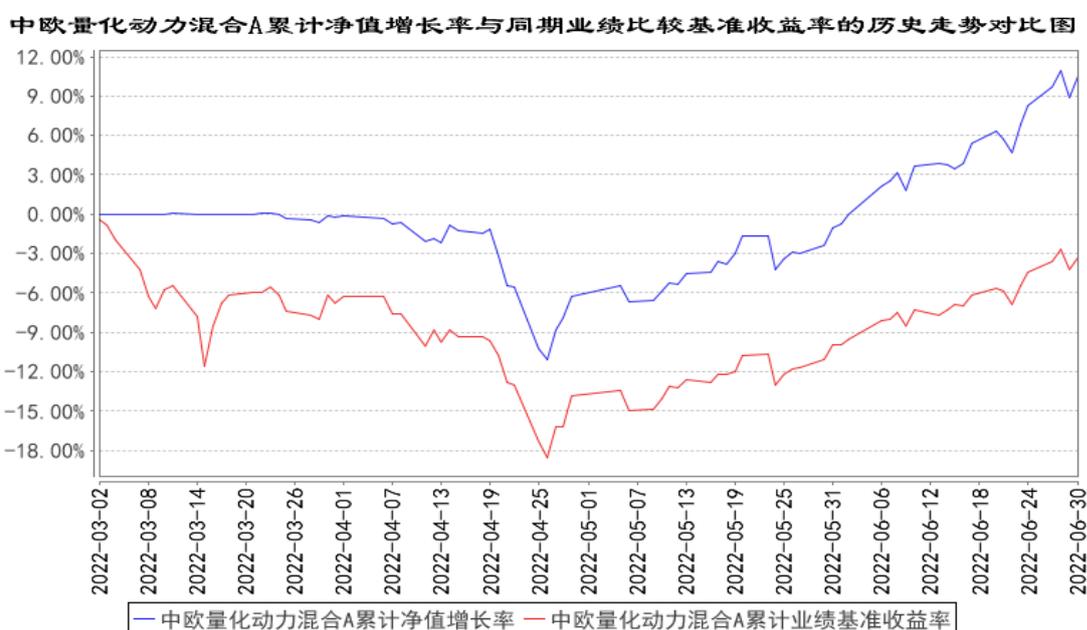
中欧量化动力混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.68%	1.10%	7.44%	0.90%	4.24%	0.20%

过去三个月	10.57%	1.29%	3.76%	1.32%	6.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.30%	1.10%	-3.27%	1.43%	13.57%	-0.33%

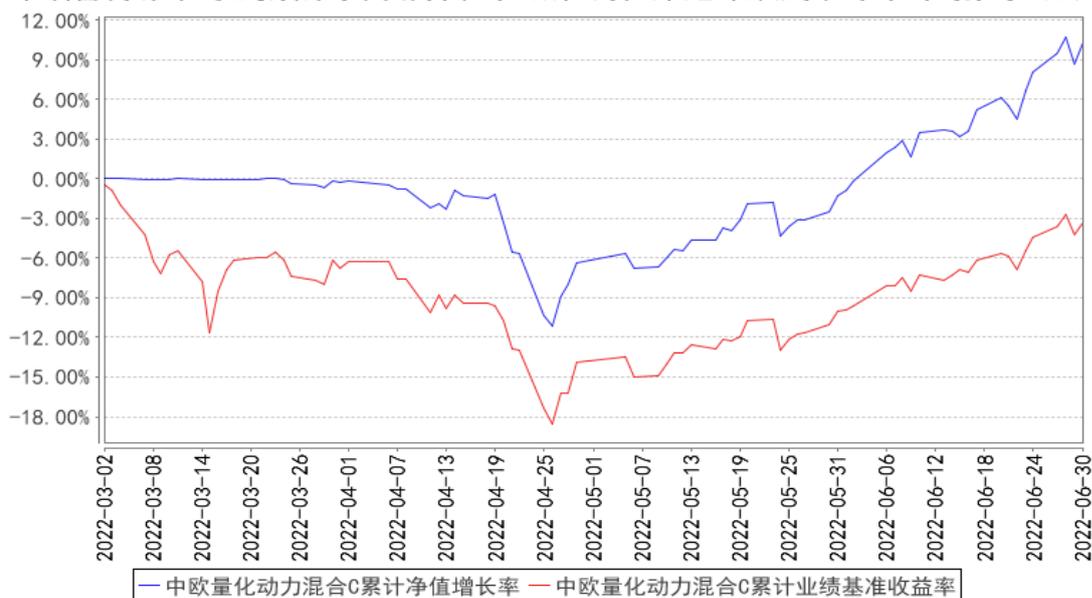
注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 2 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。

中欧量化动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 2 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。股东为意大利意联银行股份有限公司、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）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、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和中欧基金国际有限公司。截至 2022 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 130 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		
曲径	本基金的基金经理	2022-03-02	-	15 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015/04/01 加入中欧基金管理有限公司。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《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》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	7	5,195,761,211.73	2016年1月13日
	私募资产管理计划	2	458,069,438.37	2021年12月14日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	5,653,830,650.10	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2022-01-04；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0只；离任时间：无。

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20次，为量化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

2022 年，市场经历了深 V 型震荡，在内部经济不确定性和外部国际环境的双重压力之下，A 股从年初一路下行。回顾来看，下跌分为了几个阶段，1 月的下跌主要为核心赛道高估值的自我纠偏，2 至 3 月受到了俄乌战争等外部环境的扰动，4 月市场的下跌更多是由于上海疫情发酵而产生了对经济的担忧。伴随中央政治局会议对稳增长的再次强调，多项稳增长政策持续加码，市场在 4 月迎来了较好的配置窗口，反弹幅度和强度都超过了市场的预期。

在市场在下跌中，由于避险情绪主导，高分红低估值的风格相对占优；具有成长属性且质地较优的股票下跌较多。而自 4 月底的反弹中，市场风险偏好修复，优质公司反弹幅度更大。除了超跌反弹的因素，估值泡沫充分去化后，这类优质的公司确实也比较便宜，进入兼具成长和价值属性的投资域。我们认为市场经历大幅的回撤和反弹，已经回到了正常的运行区间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 10.52%，同期业绩比较基准收益率为-3.27%；基金 C 类份额净值增长率为 10.30%，同期业绩比较基准收益率为-3.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们的观点是“谨慎乐观地去面对经济筑底时期的市场不确定性”。在对后市中长期保持乐观的前提下，短期仍有两个风险点值得关注：第一，科创板进入原始股解禁高峰，有可能对市场产生一定压力；第二，3 季度进入上市公司半年报披露期，前期受疫情影响较大的公司，业绩将面临较大的挑战，也可能对市场有一定影响。但是，中长期来看，当前经济下滑进入筑底阶段，配合稳增长而推出的积极财政政策，以及相对宽松的货币环境，市场中长期风险不大。我们认为在经济筑底的过程中，市场分化仍将持续，自下而上的择股以及行业高景气配置，会是收益的主要来源。

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验。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

本基金本报告期未进行利润分配，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，本基金托管人在中欧量化动力混合型证券投资基金的托管过程中，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，中欧量化动力混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化动力混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化动力混合型证券投资基金 2022 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，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：中欧量化动力混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	19,742,449.59
结算备付金		837,985.40
存出保证金		319,723.20
交易性金融资产	6.4.7.2	124,814,335.97
其中：股票投资		124,814,335.97
基金投资		-
债券投资		-
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		98,765.87
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		145,813,260.03
负债和净资产	附注号	本期末 2022 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		-
应付清算款		6,878.19
应付赎回款		4,517,666.48
应付管理人报酬		240,597.67
应付托管费		24,059.77
应付销售服务费		52,615.85
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	67,282.51
负债合计		4,909,100.47
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	127,625,425.52
其他综合收益	6.4.7.8	-
未分配利润	6.4.7.9	13,278,734.04
净资产合计		140,904,159.56
负债和净资产总计		145,813,260.03

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额为 127,625,425.52 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.1052 元，份额总额为 62,851,001.87 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.1030 元，份额总额为 64,774,423.65 份。（2）本基金基金合同于 2022 年 03 月 02 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：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,665,461.95
1. 利息收入		427,639.03
其中：存款利息收入	6.4.7.10	303,296.34
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		124,342.69
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,335,697.09
其中：股票投资收益	6.4.7.11	8,171,083.59
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-3,170,838.21
股利收益	6.4.7.15	1,335,451.71
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,739,300.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	162,825.15
减：二、营业总支出		1,903,692.78
1. 管理人报酬		1,367,185.61
2. 托管费		136,718.52
3. 销售服务费		339,480.85
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	60,307.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,761,769.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,761,769.17
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		14,761,769.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 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（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	324,069,096.67	-	-	324,069,096.67

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-196,443,671.15	-	13,278,734.04	-183,164,937.11
(一)、综合收益总额	-	-	14,761,769.17	14,761,769.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-196,443,671.15	-	-1,483,035.13	-197,926,706.28
其中:1.基金申购款	4,789,590.21	-	113,107.54	4,902,697.75
2.基金赎回款	-201,233,261.36	-	-1,596,142.67	-202,829,404.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	127,625,425.52	-	13,278,734.04	140,904,159.56

金净值)				
------	--	--	--	--

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>杨毅</u>	<u>王音然</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

中欧量化动力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]77 号文《关于准予中欧量化动力混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 324,023,694.26 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B18 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 324,069,096.67 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 45,402.41 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 115,946,789.67 份，包含认购利息折合 16,331.99 份；C 类基金的基金份额总额为 208,122,307.00 份，包含认购利息折合 29,070.42 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品（不含合约类信用衍生品）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期

权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×15%。

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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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 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要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 03 月 02 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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，且该种法定权利现在是可执行的，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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

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

(3) 同一类别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，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金

融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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暂行条例（2011 年修订）》、《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）及地方教育费附加。

4、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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 号文《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 号文《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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,810,061.48
等于：本金	4,808,295.65
加：应计利息	1,765.83
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	14,932,388.11
等于：本金	14,931,016.49
加：应计利息	1,371.62
减：坏账准备	-
合计	19,742,449.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	114,766,895.29	-	124,814,335.97	10,047,440.68
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	114,766,895.29	-	124,814,335.97	10,047,440.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	-2,356,220.00	-	-	
其中：股指 期货投资	-2,356,220.00	-	-	

其他衍生工具	-	-	-
合计	-2,356,220.00	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2209	IF2209	-1.00	-1,334,160.00	-146,440.00
IF2212	IF2212	-1.00	-1,330,200.00	-161,700.00
合计				-308,140.00
减：可抵销期货暂收款				-308,140.00
净额				0.00

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,120.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	654.50
预提费用-审计费	19,835.53
预提费用-信息披露费	39,672.27
合计	67,282.51

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

项目	本期 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日
----	-------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	115,946,789.67	115,946,789.67
本期申购	2,040,695.34	2,040,695.34
本期赎回（以“-”号填列）	-55,136,483.14	-55,136,483.14
本期末	62,851,001.87	62,851,001.87

中欧量化动力混合 C

项目	本期 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	208,122,307.00	208,122,307.00
本期申购	2,748,894.87	2,748,894.87
本期赎回（以“-”号填列）	-146,096,778.22	-146,096,778.22
本期末	64,774,423.65	64,774,423.65

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额、赎回份额含转出份额。

2、基金自 2022 年 2 月 14 日至 2022 年 2 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 324,023,694.26 元。其中 A 类 115,930,457.68 元，C 类 208,093,236.58 元。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 45,402.41 元（其中 A 类 16,331.99 元，C 类 29,070.42 元）在本基金成立后，折算为 45,402.41 份（其中 A 类 16,331.99 份，C 类 29,070.42 份）基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 其他综合收益

无。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

中欧量化动力混合 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	-	-	-
本期利润	4,006,746.50	3,857,173.74	7,863,920.24
本期基金份额交易产生的变动数	435,697.03	-1,689,511.53	-1,253,814.50
其中：基金申购款	-33,154.14	35,393.65	2,239.51
基金赎回款	468,851.17	-1,724,905.18	-1,256,054.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,442,443.53	2,167,662.21	6,610,105.74

中欧量化动力混合 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	-	-	-
本期利润	1,015,721.99	5,882,126.94	6,897,848.93
本期基金份额交易产生的变动数	3,422,554.31	-3,651,774.94	-229,220.63

其中：基金申购款	12,302.26	98,565.77	110,868.03
基金赎回款	3,410,252.05	-3,750,340.71	-340,088.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,438,276.30	2,230,352.00	6,668,628.30

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
活期存款利息收入		183,964.45
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		82,645.08
结算备付金利息收入		36,686.81
其他		-
合计		303,296.34

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		680,332,949.59
减：卖出股票成本总额		670,359,091.57
减：交易费用		1,802,774.43
买卖股票差价收入		8,171,083.59

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
----	--------

	2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-3,170,838.21

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,335,451.71
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	1,335,451.71

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,047,440.68
股票投资	10,047,440.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-308,140.00
权证投资	-
期货投资	-308,140.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	9,739,300.68

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	162,824.89
基金转换费收入	0.26
合计	162,825.15

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
审计费用		19,835.53
信息披露费		39,672.27
证券出借违约金		-
开户费		800.00
合计		60,307.80

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，未发生重大关联方关系变化的情况。

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
海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	965,362,721.45	65.88

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
海通证券	272,000,000.00	69.39

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	738,431.30	73.77	-	-

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 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	535,515.54

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误

后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金合同于 2022 年 3 月 2 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金合同于 2022 年 3 月 2 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券股份有限公司	-	319,299.96	319,299.96
中欧基金	-	75.74	75.74
合计	-	319,375.70	319,375.70

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金合同于 2022 年 3 月 2 日生效，故无上年度可比期间数据。

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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧量化动力混合 A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	100,024.11	0.16%

份额单位：份

中欧量化动力混合 C

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	0.00	0.00%

注：本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
海通证券	4,810,061.48	183,964.45

注：本基金的银行存款由基金托管人海通证券股份有限公司保管，按银行同业利率/约定利率计息。

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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	1,830	70,381.80	70,381.80	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月以上	新股流通受限	38.46	38.46	204	7,845.84	7,845.84	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2022 年 6 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 2022 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有

风险。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，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 2022 年 06 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,742,449.59	-	-	-	19,742,449.59
结算备付金	837,985.40	-	-	-	837,985.40
存出保证金	-	-	-	319,723.20	319,723.20
交易性金融资产	-	-	-	124,814,335.97	124,814,335.97
应收申购款	-	-	-	98,765.87	98,765.87
资产总计	20,580,434.99	-	-	125,232,825.04	145,813,260.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,517,666.48	4,517,666.48
应付管理人报酬	-	-	-	240,597.67	240,597.67
应付托管费	-	-	-	24,059.77	24,059.77
应付清算款	-	-	-	6,878.19	6,878.19
应付销售服务费	-	-	-	52,615.85	52,615.85
其他负债	-	-	-	67,282.51	67,282.51
负债总计	-	-	-	4,909,100.47	4,909,100.47
利率敏感度缺口	20,580,434.99	-	-	-120,323,724.57	140,904,159.56

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 2022 年 06 月 30 日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%，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。

6.4.13.4.3 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 2022 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	124,814,335.97	88.58
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	124,814,335.97	88.58

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	
	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 (2022 年 6 月 30 日)
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	4,114,639.28
	2. 业绩比较基准下降 5%	-4,114,639.28

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	124,736,108.33
第二层次	78,227.64

第三层次	—
合计	124,814,335.97

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券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贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。本财务报表已于 2022 年 8 月 30 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	124,814,335.97	85.60
	其中：股票	124,814,335.97	85.60
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	20,580,434.99	14.11
8	其他各项资产	418,489.07	0.29
9	合计	145,813,260.03	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	679,821.00	0.48
B	采矿业	6,007,865.00	4.26
C	制造业	81,528,842.83	57.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,736,790.00	1.23
E	建筑业	1,238,454.00	0.88
F	批发和零售业	1,619,277.20	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,437,119.00	3.15
H	住宿和餐饮业	473,680.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,515,954.14	3.91
J	金融业	3,535,388.00	2.51
K	房地产业	8,446,571.00	5.99
L	租赁和商务服务业	1,651,944.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	2,129,616.80	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	2,533,512.60	1.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,577,928.40	1.83
R	文化、体育和娱乐业	443,688.00	0.31
S	综合	257,884.00	0.18
	合计	124,814,335.97	88.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	207,400	2,787,456.00	1.98
2	600048	保利发展	155,100	2,708,046.00	1.92
3	300015	爱尔眼科	30,700	1,374,439.00	0.98
4	000002	万科 A	65,300	1,338,650.00	0.95
5	001979	招商蛇口	98,900	1,328,227.00	0.94
6	000733	振华科技	9,000	1,223,730.00	0.87
7	300751	迈为股份	2,480	1,217,432.00	0.86
8	002709	天赐材料	19,400	1,203,964.00	0.85

9	600233	圆通速递	54,200	1,105,138.00	0.78
10	603363	傲农生物	55,000	1,018,050.00	0.72
11	300037	新宙邦	18,400	967,104.00	0.69
12	600188	兖矿能源	22,600	892,248.00	0.63
13	601699	潞安环能	60,400	883,048.00	0.63
14	600256	广汇能源	81,700	861,118.00	0.61
15	600873	梅花生物	75,000	846,000.00	0.60
16	603185	上机数控	5,376	838,602.24	0.60
17	002129	TCL 中环	14,200	836,238.00	0.59
18	000977	浪潮信息	31,400	831,472.00	0.59
19	603112	华翔股份	53,300	794,703.00	0.56
20	300035	中科电气	28,400	793,780.00	0.56
21	603067	振华股份	63,000	789,390.00	0.56
22	600116	三峡水利	78,500	788,140.00	0.56
23	603259	药明康德	7,500	779,925.00	0.55
24	600884	杉杉股份	26,000	772,720.00	0.55
25	600438	通威股份	12,800	766,208.00	0.54
26	600690	海尔智家	27,900	766,134.00	0.54
27	300776	帝尔激光	4,260	736,128.00	0.52
28	600276	恒瑞医药	19,700	730,673.00	0.52
29	300763	锦浪科技	3,350	713,550.00	0.51
30	300357	我武生物	13,400	697,202.00	0.49
31	002352	顺丰控股	12,200	680,882.00	0.48
32	002714	牧原股份	12,300	679,821.00	0.48
33	603191	望变电气	29,800	679,440.00	0.48
34	601636	旗滨集团	52,300	666,825.00	0.47
35	002240	盛新锂能	10,900	657,924.00	0.47
36	000803	北清环能	42,040	657,505.60	0.47
37	000983	山西焦煤	49,000	656,110.00	0.47
38	300724	捷佳伟创	7,200	643,320.00	0.46
39	601012	隆基绿能	9,640	642,313.20	0.46
40	002371	北方华创	2,300	637,376.00	0.45
41	601898	中煤能源	60,800	631,104.00	0.45
42	002179	中航光电	9,940	629,400.80	0.45
43	002847	盐津铺子	7,100	624,374.00	0.44
44	002386	天原股份	52,800	581,856.00	0.41
45	300531	优博讯	41,800	581,020.00	0.41
46	603128	华贸物流	57,600	577,728.00	0.41
47	003019	宸展光电	22,850	576,734.00	0.41
48	301103	何氏眼科	16,790	571,867.40	0.41
49	603688	石英股份	4,200	556,962.00	0.40
50	688099	晶晨股份	5,500	555,500.00	0.39

51	300122	智飞生物	5,000	555,050.00	0.39
52	600809	山西汾酒	1,700	552,160.00	0.39
53	002597	金禾实业	12,600	545,958.00	0.39
54	002706	良信股份	32,900	543,837.00	0.39
55	000661	长春高新	2,300	536,866.00	0.38
56	601888	中国中免	2,300	535,739.00	0.38
57	600096	云天化	16,900	532,012.00	0.38
58	600499	科达制造	25,500	526,320.00	0.37
59	300487	蓝晓科技	8,600	524,600.00	0.37
60	300447	全信股份	25,500	519,435.00	0.37
61	002271	东方雨虹	10,000	514,700.00	0.37
62	300054	鼎龙股份	24,300	514,431.00	0.37
63	600160	巨化股份	39,100	514,165.00	0.36
64	603596	伯特利	6,400	513,152.00	0.36
65	002142	宁波银行	14,300	512,083.00	0.36
66	000902	新洋丰	30,300	511,767.00	0.36
67	603019	中科曙光	17,600	510,752.00	0.36
68	600522	中天科技	22,100	510,510.00	0.36
69	688521	芯原股份	10,303	508,968.20	0.36
70	300523	辰安科技	18,200	507,598.00	0.36
71	601838	成都银行	30,600	507,348.00	0.36
72	603338	浙江鼎力	10,000	507,000.00	0.36
73	688116	天奈科技	2,985	505,897.80	0.36
74	002756	永兴材料	3,300	502,293.00	0.36
75	002812	恩捷股份	2,000	500,900.00	0.36
76	002466	天齐锂业	4,000	499,200.00	0.35
77	300454	深信服	4,800	498,144.00	0.35
78	601166	兴业银行	25,000	497,500.00	0.35
79	300014	亿纬锂能	5,100	497,250.00	0.35
80	600309	万华化学	5,100	494,649.00	0.35
81	002459	晶澳科技	6,260	493,914.00	0.35
82	603619	中曼石油	24,000	493,680.00	0.35
83	601689	拓普集团	7,200	492,696.00	0.35
84	600702	舍得酒业	2,400	489,576.00	0.35
85	002120	韵达股份	28,500	486,210.00	0.35
86	300604	长川科技	10,600	478,590.00	0.34
87	600258	首旅酒店	19,100	473,680.00	0.34
88	002929	润建股份	13,000	466,700.00	0.33
89	002460	赣锋锂业	3,100	460,970.00	0.33
90	300801	泰和科技	17,700	460,554.00	0.33
91	002311	海大集团	7,600	456,076.00	0.32
92	000625	长安汽车	26,260	454,823.20	0.32

93	300413	芒果超媒	13,300	443,688.00	0.31
94	300450	先导智能	6,800	429,624.00	0.30
95	300750	宁德时代	800	427,200.00	0.30
96	002801	微光股份	14,200	423,870.00	0.30
97	002572	索菲亚	15,400	423,500.00	0.30
98	600570	恒生电子	9,700	422,338.00	0.30
99	600745	闻泰科技	4,900	417,039.00	0.30
100	603556	海兴电力	27,200	413,984.00	0.29
101	000963	华东医药	9,100	410,956.00	0.29
102	300294	博雅生物	11,200	402,640.00	0.29
103	688005	容百科技	3,100	401,264.00	0.28
104	600763	通策医疗	2,300	401,212.00	0.28
105	603018	华设集团	42,000	401,100.00	0.28
106	002487	大金重工	9,600	400,608.00	0.28
107	002645	华宏科技	18,300	399,306.00	0.28
108	300401	花园生物	23,000	398,820.00	0.28
109	002291	星期六	20,000	395,200.00	0.28
110	002615	哈尔斯	63,300	393,726.00	0.28
111	300408	三环集团	13,000	391,300.00	0.28
112	002541	鸿路钢构	11,700	390,780.00	0.28
113	600566	济川药业	14,300	388,388.00	0.28
114	002463	沪电股份	25,800	380,808.00	0.27
115	603300	华铁应急	47,500	378,575.00	0.27
116	300712	永福股份	6,600	378,444.00	0.27
117	601318	中国平安	8,100	378,189.00	0.27
118	603098	森特股份	10,500	376,530.00	0.27
119	603816	顾家家居	6,550	370,926.50	0.26
120	601225	陕西煤业	17,400	368,532.00	0.26
121	002080	中材科技	13,400	368,500.00	0.26
122	000895	双汇发展	12,500	366,250.00	0.26
123	300196	长海股份	19,161	361,951.29	0.26
124	600516	方大炭素	47,500	361,000.00	0.26
125	601021	春秋航空	6,100	355,935.00	0.25
126	600536	中国软件	8,670	351,915.30	0.25
127	603916	苏博特	13,500	344,115.00	0.24
128	603920	世运电路	19,700	340,810.00	0.24
129	600210	紫江企业	53,300	340,587.00	0.24
130	002216	三全食品	17,200	336,948.00	0.24
131	600780	通宝能源	63,700	335,062.00	0.24
132	000683	远兴能源	31,200	327,912.00	0.23
133	688508	芯朋微	4,400	327,800.00	0.23
134	000553	安道麦 A	27,000	326,970.00	0.23

135	605016	百龙创园	7,700	323,554.00	0.23
136	600487	亨通光电	22,200	322,788.00	0.23
137	300911	亿田智能	4,200	322,770.00	0.23
138	300298	三诺生物	11,400	320,340.00	0.23
139	688696	极米科技	1,040	320,184.80	0.23
140	600486	扬农化工	2,400	319,872.00	0.23
141	603903	中持股份	32,100	315,222.00	0.22
142	601702	华峰铝业	23,800	314,160.00	0.22
143	601628	中国人寿	10,100	313,908.00	0.22
144	688568	中科星图	4,600	311,696.00	0.22
145	603078	江化微	10,800	308,556.00	0.22
146	002955	鸿合科技	14,100	306,957.00	0.22
147	600461	洪城环境	37,700	304,993.00	0.22
148	002057	中钢天源	26,300	303,765.00	0.22
149	603558	健盛集团	24,700	301,834.00	0.21
150	002009	天奇股份	16,200	299,700.00	0.21
151	601975	招商南油	74,200	299,026.00	0.21
152	688682	霍莱沃	3,600	298,908.00	0.21
153	688621	阳光诺和	2,732	298,880.80	0.21
154	603299	苏盐井神	23,800	298,214.00	0.21
155	002935	天奥电子	13,000	296,530.00	0.21
156	688050	爱博医疗	1,300	291,460.00	0.21
157	688529	豪森股份	9,500	291,460.00	0.21
158	002790	瑞尔特	37,100	290,493.00	0.21
159	000333	美的集团	4,800	289,872.00	0.21
160	002410	广联达	5,300	288,532.00	0.20
161	300218	安利股份	20,200	288,254.00	0.20
162	688560	明冠新材	8,400	287,616.00	0.20
163	300496	中科创达	2,200	287,056.00	0.20
164	603896	寿仙谷	7,400	286,972.00	0.20
165	002286	保龄宝	24,900	285,105.00	0.20
166	688601	力芯微	1,900	285,000.00	0.20
167	600162	香江控股	132,800	284,192.00	0.20
168	002549	凯美特气	15,700	284,170.00	0.20
169	300760	迈瑞医疗	900	281,880.00	0.20
170	003020	立方制药	9,560	281,255.20	0.20
171	603387	基蛋生物	19,700	280,922.00	0.20
172	603086	先达股份	28,880	280,136.00	0.20
173	600713	南京医药	57,300	279,051.00	0.20
174	002150	通润装备	41,800	278,806.00	0.20
175	600036	招商银行	6,600	278,520.00	0.20
176	300181	佐力药业	28,000	278,320.00	0.20

177	002815	崇达技术	21,700	277,977.00	0.20
178	300982	苏文电能	5,900	277,064.00	0.20
179	300813	泰林生物	6,800	276,692.00	0.20
180	002540	亚太科技	41,100	276,192.00	0.20
181	603339	四方科技	24,100	275,704.00	0.20
182	002975	博杰股份	7,200	275,400.00	0.20
183	300713	英可瑞	18,000	275,400.00	0.20
184	603578	三星新材	20,780	274,711.60	0.19
185	002796	世嘉科技	35,400	274,704.00	0.19
186	688310	迈得医疗	12,329	274,566.83	0.19
187	300059	东方财富	10,800	274,320.00	0.19
188	603909	建发合诚	19,900	274,023.00	0.19
189	603948	建业股份	9,700	273,055.00	0.19
190	000731	四川美丰	30,000	273,000.00	0.19
191	600030	中信证券	12,600	272,916.00	0.19
192	300805	电声股份	34,300	272,685.00	0.19
193	300696	爱乐达	6,200	272,490.00	0.19
194	300669	沪宁股份	28,850	272,344.00	0.19
195	300522	世名科技	22,600	272,104.00	0.19
196	000552	靖远煤电	63,100	271,961.00	0.19
197	688418	震有科技	28,900	271,660.00	0.19
198	688466	金科环境	17,300	271,610.00	0.19
199	688569	铁科轨道	14,800	271,580.00	0.19
200	600965	福成股份	37,700	271,440.00	0.19
201	603822	嘉澳环保	5,800	271,382.00	0.19
202	002282	博深股份	35,800	271,006.00	0.19
203	002947	恒铭达	14,700	270,480.00	0.19
204	300281	金明精机	48,300	270,480.00	0.19
205	002136	安纳达	17,700	270,456.00	0.19
206	000567	海德股份	18,265	270,322.00	0.19
207	600180	瑞茂通	35,000	270,200.00	0.19
208	300103	达刚控股	33,100	270,096.00	0.19
209	300864	南大环境	12,860	270,060.00	0.19
210	300417	南华仪器	27,400	269,890.00	0.19
211	300154	瑞凌股份	46,100	269,685.00	0.19
212	000565	渝三峡 A	41,600	268,736.00	0.19
213	300410	正业科技	31,600	268,600.00	0.19
214	603585	苏利股份	13,800	268,134.00	0.19
215	003043	华亚智能	4,500	267,930.00	0.19
216	600367	红星发展	12,200	267,668.00	0.19
217	605399	晨光新材	6,280	267,214.00	0.19
218	002594	比亚迪	800	266,792.00	0.19

219	300652	雷迪克	10,900	266,723.00	0.19
220	300126	锐奇股份	44,000	266,640.00	0.19
221	002167	东方锆业	36,400	266,448.00	0.19
222	300040	九洲集团	36,900	266,418.00	0.19
223	688360	德马科技	9,999	266,173.38	0.19
224	002932	明德生物	3,874	265,601.44	0.19
225	600529	山东药玻	9,500	265,525.00	0.19
226	688257	新锐股份	6,700	265,454.00	0.19
227	002455	百川股份	21,800	264,434.00	0.19
228	603679	华体科技	24,100	264,136.00	0.19
229	300512	中亚股份	32,200	264,040.00	0.19
230	300176	派生科技	48,700	262,493.00	0.19
231	300771	智莱科技	19,550	261,970.00	0.19
232	603867	新化股份	7,700	261,569.00	0.19
233	688077	大地熊	3,100	261,361.00	0.19
234	688557	兰剑智能	8,100	260,577.00	0.18
235	688335	复洁环保	9,003	258,476.13	0.18
236	300912	凯龙高科	14,500	257,955.00	0.18
237	300130	新国都	21,000	257,460.00	0.18
238	300687	赛意信息	11,100	254,967.00	0.18
239	688628	优利德	8,620	253,341.80	0.18
240	605117	德业股份	900	251,901.00	0.18
241	002791	坚朗五金	1,900	246,468.00	0.17
242	600988	赤峰黄金	15,400	245,630.00	0.17
243	600167	联美控股	32,500	243,425.00	0.17
244	601001	晋控煤业	13,500	239,625.00	0.17
245	688677	海泰新光	2,598	238,990.02	0.17
246	600847	万里股份	13,400	237,180.00	0.17
247	600029	南方航空	32,400	236,844.00	0.17
248	300557	理工光科	8,700	236,640.00	0.17
249	300577	开润股份	14,500	235,625.00	0.17
250	002881	美格智能	7,330	234,999.80	0.17
251	601156	东航物流	11,800	233,640.00	0.17
252	603713	密尔克卫	1,700	232,390.00	0.16
253	300019	硅宝科技	10,400	231,192.00	0.16
254	601009	南京银行	22,100	230,282.00	0.16
255	600026	中远海能	22,200	229,326.00	0.16
256	688105	诺唯赞	2,700	229,230.00	0.16
257	002050	三花智控	8,300	228,084.00	0.16
258	000063	中兴通讯	8,900	227,217.00	0.16
259	600521	华海药业	9,900	224,730.00	0.16
260	688536	思瑞浦	400	224,636.00	0.16

261	600826	兰生股份	27,000	221,940.00	0.16
262	000568	泸州老窖	900	221,886.00	0.16
263	002007	华兰生物	9,700	221,160.00	0.16
264	603345	安井食品	1,300	218,231.00	0.15
265	000703	恒逸石化	20,700	217,557.00	0.15
266	000890	法尔胜	50,900	215,307.00	0.15
267	603986	兆易创新	1,500	213,315.00	0.15
268	603826	坤彩科技	3,600	211,896.00	0.15
269	002918	蒙娜丽莎	11,300	211,536.00	0.15
270	300521	爱司凯	18,600	208,878.00	0.15
271	601899	紫金矿业	22,300	208,059.00	0.15
272	603568	伟明环保	6,200	206,894.00	0.15
273	301190	善水科技	8,700	206,451.00	0.15
274	601668	中国建筑	38,800	206,416.00	0.15
275	601233	桐昆股份	12,900	204,852.00	0.15
276	600603	广汇物流	29,900	192,257.00	0.14
277	002655	共达电声	13,000	192,140.00	0.14
278	688019	安集科技	900	191,628.00	0.14
279	301155	海力风电	2,100	191,100.00	0.14
280	002943	宇晶股份	3,700	190,550.00	0.14
281	603129	春风动力	1,600	181,952.00	0.13
282	600415	小商品城	31,500	175,455.00	0.12
283	603501	韦尔股份	1,000	173,030.00	0.12
284	603939	益丰药房	3,200	169,056.00	0.12
285	603882	金域医学	2,000	165,100.00	0.12
286	601966	玲珑轮胎	5,900	149,683.00	0.11
287	300405	科隆股份	25,300	147,752.00	0.10
288	300928	华安鑫创	2,600	146,458.00	0.10
289	600436	片仔癀	400	142,692.00	0.10
290	600392	盛和资源	6,300	142,380.00	0.10
291	601615	明阳智能	4,200	141,960.00	0.10
292	603987	康德莱	7,100	141,503.00	0.10
293	601607	上海医药	7,800	141,024.00	0.10
294	002916	深南电路	1,500	140,565.00	0.10
295	603876	鼎胜新材	3,000	135,600.00	0.10
296	600596	新安股份	6,220	134,663.00	0.10
297	300398	飞凯材料	5,830	133,273.80	0.09
298	002938	鹏鼎控股	4,400	132,924.00	0.09
299	603529	爱玛科技	2,520	131,997.60	0.09
300	688575	亚辉龙	6,280	131,377.60	0.09
301	002396	星网锐捷	5,700	129,048.00	0.09
302	600508	上海能源	7,100	128,439.00	0.09

303	600063	皖维高新	16,900	128,102.00	0.09
304	301139	元道通信	2,034	78,227.64	0.06
305	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.05
306	605123	派克新材	500	70,360.00	0.05
307	300363	博腾股份	900	70,191.00	0.05
308	002497	雅化集团	2,100	68,565.00	0.05
309	300170	汉得信息	7,600	68,476.00	0.05
310	002407	多氟多	1,400	68,474.00	0.05
311	688303	大全能源	1,000	68,320.00	0.05
312	688110	东芯股份	1,800	68,256.00	0.05
313	600888	新疆众和	7,400	68,080.00	0.05
314	002832	比音勒芬	2,700	68,040.00	0.05
315	002419	天虹股份	9,500	67,735.00	0.05
316	002182	云海金属	2,700	67,716.00	0.05
317	000970	中科三环	3,600	67,608.00	0.05
318	002878	元隆雅图	3,500	67,550.00	0.05
319	600273	嘉化能源	6,200	67,332.00	0.05
320	300481	濮阳惠成	2,800	65,800.00	0.05
321	600673	东阳光	7,300	65,627.00	0.05
322	002436	兴森科技	5,800	65,366.00	0.05
323	300244	迪安诊断	2,100	65,310.00	0.05
324	601985	中国核电	9,500	65,170.00	0.05
325	002315	焦点科技	4,600	64,492.00	0.05
326	000937	冀中能源	8,600	64,156.00	0.05
327	600123	兰花科创	3,900	64,155.00	0.05
328	300373	扬杰科技	900	64,125.00	0.05
329	300890	翔丰华	1,100	60,852.00	0.04
330	688196	卓越新能	500	38,500.00	0.03
331	688598	金博股份	100	29,470.00	0.02

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	600048	保利发展	14,150,221.00	10.04
2	600116	三峡水利	10,517,257.00	7.46
3	001979	招商蛇口	9,549,052.00	6.78
4	000002	万科 A	9,194,047.00	6.53
5	600383	金地集团	9,057,382.00	6.43
6	601225	陕西煤业	9,051,351.00	6.42
7	001914	招商积余	8,568,222.00	6.08
8	600256	广汇能源	8,522,106.00	6.05

9	600801	华新水泥	8,441,095.00	5.99
10	603737	三棵树	8,433,126.64	5.99
11	002709	天赐材料	8,278,792.00	5.88
12	600096	云天化	7,966,084.00	5.65
13	300014	亿纬锂能	7,402,317.27	5.25
14	601699	潞安环能	7,020,497.00	4.98
15	300196	长海股份	6,869,894.02	4.88
16	002557	洽洽食品	6,680,443.00	4.74
17	002714	牧原股份	6,575,485.00	4.67
18	000683	远兴能源	6,411,233.00	4.55
19	002244	滨江集团	5,812,214.00	4.12
20	600519	贵州茅台	5,665,221.71	4.02
21	300316	晶盛机电	5,216,048.00	3.70
22	002216	三全食品	5,206,438.00	3.70
23	603259	药明康德	5,149,910.00	3.65
24	600487	亨通光电	5,066,396.00	3.60
25	600809	山西汾酒	5,058,151.00	3.59
26	002120	韵达股份	5,008,486.00	3.55
27	300750	宁德时代	4,811,470.00	3.41
28	300776	帝尔激光	4,809,154.00	3.41
29	600546	山煤国际	4,747,644.93	3.37
30	300751	迈为股份	4,641,871.78	3.29
31	002043	兔宝宝	4,586,977.00	3.26
32	688180	君实生物	4,331,184.57	3.07
33	688777	中控技术	4,321,195.39	3.07
34	000848	承德露露	4,220,320.00	3.00
35	300450	先导智能	4,200,857.00	2.98
36	600863	内蒙华电	4,124,754.00	2.93
37	600887	伊利股份	4,021,199.00	2.85
38	600188	兖矿能源	4,003,607.67	2.84
39	000661	长春高新	3,962,659.00	2.81
40	002643	万润股份	3,923,893.00	2.78
41	603185	上机数控	3,872,210.20	2.75
42	000893	亚钾国际	3,859,552.00	2.74
43	603187	海容冷链	3,756,060.00	2.67
44	601012	隆基绿能	3,729,457.00	2.65
45	600720	祁连山	3,716,065.00	2.64
46	002271	东方雨虹	3,671,818.00	2.61
47	601668	中国建筑	3,559,500.00	2.53
48	002705	新宝股份	3,545,750.17	2.52
49	688303	大全能源	3,467,992.16	2.46
50	600233	圆通速递	3,438,655.00	2.44

51	000733	振华科技	3,432,660.00	2.44
52	002507	涪陵榨菜	3,418,566.00	2.43
53	601919	中远海控	3,339,578.00	2.37
54	002812	恩捷股份	3,291,852.00	2.34
55	002918	蒙娜丽莎	3,265,343.00	2.32
56	300408	三环集团	3,220,544.00	2.29
57	603363	傲农生物	3,197,252.00	2.27
58	002352	顺丰控股	3,175,108.00	2.25
59	002847	盐津铺子	3,169,009.61	2.25
60	002129	TCL 中环	3,145,218.00	2.23
61	002128	电投能源	3,140,749.00	2.23
62	002371	北方华创	3,127,210.00	2.22
63	002881	美格智能	3,041,772.98	2.16
64	688019	安集科技	2,963,017.60	2.10
65	600702	舍得酒业	2,937,531.00	2.08
66	600795	国电电力	2,922,262.00	2.07
67	603826	坤彩科技	2,905,174.00	2.06

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	600048	保利发展	11,025,243.00	7.82
2	600116	三峡水利	9,437,209.77	6.70
3	601225	陕西煤业	8,929,606.00	6.34
4	600801	华新水泥	8,891,257.56	6.31
5	001914	招商积余	8,527,223.47	6.05
6	603737	三棵树	8,397,894.32	5.96
7	001979	招商蛇口	7,926,927.00	5.63
8	600256	广汇能源	7,792,714.00	5.53
9	000002	万科 A	7,392,342.00	5.25
10	600096	云天化	7,365,555.00	5.23
11	002709	天赐材料	7,313,880.00	5.19
12	300014	亿纬锂能	7,056,887.61	5.01
13	300196	长海股份	6,757,218.00	4.80
14	002557	洽洽食品	6,481,392.70	4.60
15	002244	滨江集团	6,211,911.00	4.41
16	601699	潞安环能	6,117,120.00	4.34
17	000683	远兴能源	6,010,645.00	4.27
18	002714	牧原股份	5,939,769.00	4.22
19	600383	金地集团	5,872,644.00	4.17
20	600519	贵州茅台	5,805,368.00	4.12

21	002216	三全食品	5,421,793.90	3.85
22	300316	晶盛机电	5,359,132.00	3.80
23	600546	山煤国际	5,297,628.00	3.76
24	300750	宁德时代	5,077,376.00	3.60
25	600809	山西汾酒	4,896,652.60	3.48
26	002120	韵达股份	4,607,591.00	3.27
27	688180	君实生物	4,506,093.20	3.20
28	600863	内蒙华电	4,478,592.00	3.18
29	300751	迈为股份	4,425,525.52	3.14
30	600720	祁连山	4,424,330.00	3.14
31	300776	帝尔激光	4,401,082.60	3.12
32	600487	亨通光电	4,399,118.00	3.12
33	603259	药明康德	4,310,233.00	3.06
34	002043	兔宝宝	4,265,455.00	3.03
35	688777	中控技术	4,099,544.00	2.91
36	600887	伊利股份	4,098,338.00	2.91
37	000661	长春高新	4,013,321.00	2.85
38	000848	承德露露	3,992,731.00	2.83
39	603187	海容冷链	3,844,683.68	2.73
40	002705	新宝股份	3,813,806.00	2.71
41	300450	先导智能	3,794,138.00	2.69
42	002643	万润股份	3,689,062.00	2.62
43	000893	亚钾国际	3,646,187.13	2.59
44	603185	上机数控	3,594,071.80	2.55
45	601012	隆基绿能	3,476,345.00	2.47
46	688303	大全能源	3,474,871.49	2.47
47	600795	国电电力	3,439,895.00	2.44
48	601919	中远海控	3,310,019.00	2.35
49	600188	兖矿能源	3,278,234.00	2.33
50	601668	中国建筑	3,276,113.00	2.33
51	002271	东方雨虹	3,227,838.00	2.29
52	002128	电投能源	3,176,950.00	2.25
53	002507	涪陵榨菜	3,136,749.00	2.23
54	600702	舍得酒业	3,071,719.00	2.18
55	002918	蒙娜丽莎	3,023,662.00	2.15
56	002812	恩捷股份	2,946,770.00	2.09
57	002847	盐津铺子	2,909,171.00	2.06
58	300573	兴齐眼药	2,874,966.00	2.04
59	688019	安集科技	2,870,617.23	2.04
60	300408	三环集团	2,834,509.00	2.01

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	785,125,986.86
卖出股票收入（成交）总额	680,332,949.59

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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规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	319,723.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	98,765.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	418,489.07

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
中欧量化 动力混合 A	1,921	32,717.86	222,914.06	0.35%	62,628,087.81	99.65%
中欧量化 动力混合 C	1,736	37,312.46	8,201,888.89	12.66%	56,572,534.76	87.34%
合计	3,657	34,898.94	8,424,802.95	6.60%	119,200,622.57	93.40%

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	中欧量化动力混合 A	100,024.11	0.16%
	中欧量化动力混合 C	-	-
	合计	100,024.11	0.08%

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	中欧量化动力混合 A	10~50
	中欧量化动力混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	10~50
	中欧量化动力混合 C	-
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 2 日) 基金份额总额	115,946,789.67	208,122,307.00
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	2,040,695.34	2,748,894.87
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	55,136,483.14	146,096,778.22
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	62,851,001.87	64,774,423.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额、总赎回份额含转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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 (%)	
海通证券	2	965,362,721.45	65.88	738,431.30	73.77	-
方正证券	2	500,017,987.36	34.12	262,522.54	26.23	-

注：1. 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、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用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 (%)
海通证券	-	-	272,000,000.00	69.39	-	-
方正证券	-	-	120,000,000.00	30.61	-	-

注：1. 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、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

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	中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2022-01-26
2	中欧量化动力混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2022-01-26
3	中欧量化动力混合型证券投资基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2022-01-26
4	中欧量化动力混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2022-01-26
5	中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2022-01-26
6	中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同及招募说明提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-01-26
7	中欧基金管理有限公司关于中欧量化动力混合型证券投资基金调整募集期限的公告	中国证监会指定媒介	2022-02-11
8	中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2022-03-03
9	中欧量化动力混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2022-05-07

§ 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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧量化动力混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化动力混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、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

基金管理人及基金托管人的住所

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及基金托管人的住所免费查阅。

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

2022 年 8 月 31 日