

中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度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。

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6 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	78
8.7 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	78
8.8 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	78
8.9 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	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.3 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	80
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议	81
11.2 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	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧金安量化混合型证券投资基金	
基金简称	中欧金安量化混合	
基金主代码	014135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 20 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国金证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	693,047,918.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
下属分级基金的交易代码	014135	014136
报告期末下属分级基金的份额总额	608,617,669.78 份	84,430,248.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金将参照以中证 500 指数为主要标准配置基金资产，对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+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）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，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	国金证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	陈俐洁
	联系电话	021-68609600	021-20527198-15217
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	chenlj@gjzq.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95310
传真		021-33830351	028-86690089

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	成都市青羊区东城根上街 95 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	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 13 楼资产托管部
邮政编码	200120	610015
法定代表人	窦玉明	冉云

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年 1 月 20 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
本期已实现收益	-36,126,584.03	-6,372,813.81	-69,748,288.88	-11,857,621.48
本期利润	-16,934,915.77	-2,726,037.92	-97,895,810.91	-16,517,931.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0242	-0.0260	-0.1190	-0.1385
本期加权平均净值利润率	-2.68%	-2.91%	-12.61%	-14.73%
本期基金份额净值增长率	-4.01%	-4.77%	-11.51%	-12.18%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分	-91,666,361.96	-13,823,901.41	-92,219,563.76	-14,940,916.30

配利润				
期末可供分配基金份额利润	-0.1506	-0.1637	-0.1151	-0.1218
期末基金资产净值	516,951,307.82	70,606,347.24	708,740,209.12	107,722,062.57
期末基金份额净值	0.8494	0.8363	0.8849	0.8782
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-15.06%	-16.37%	-11.51%	-12.18%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧金安量化混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.29%	0.81%	-4.36%	0.81%	2.07%	0.00%
过去六个月	-7.76%	0.82%	-9.10%	0.81%	1.34%	0.01%
过去一年	-4.01%	0.81%	-7.25%	0.78%	3.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	-15.06%	1.02%	-22.38%	1.07%	7.32%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+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)*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。

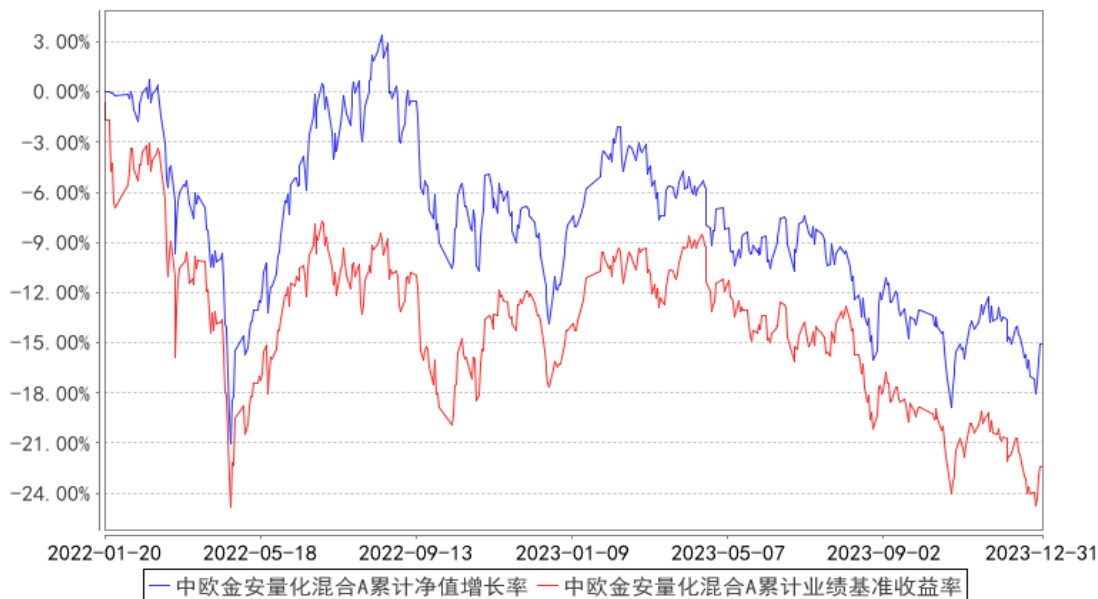
中欧金安量化混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.48%	0.81%	-4.36%	0.81%	1.88%	0.00%
过去六个月	-8.14%	0.82%	-9.10%	0.81%	0.96%	0.01%
过去一年	-4.77%	0.81%	-7.25%	0.78%	2.48%	0.03%
自基金合同生效 起至今	-16.37%	1.02%	-22.38%	1.07%	6.01%	-0.05%

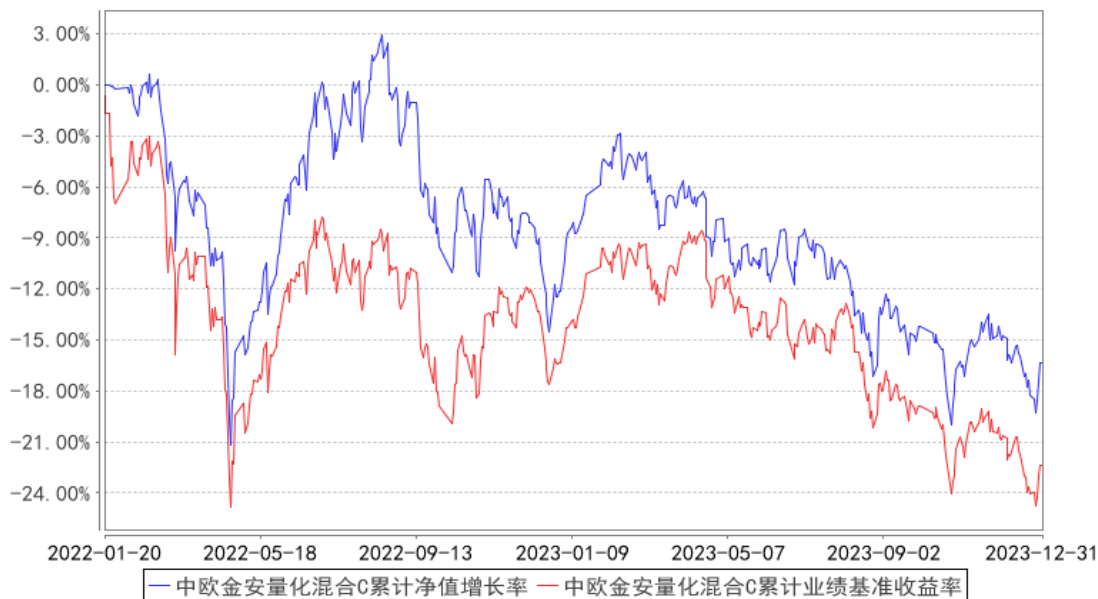
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧金安量化混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

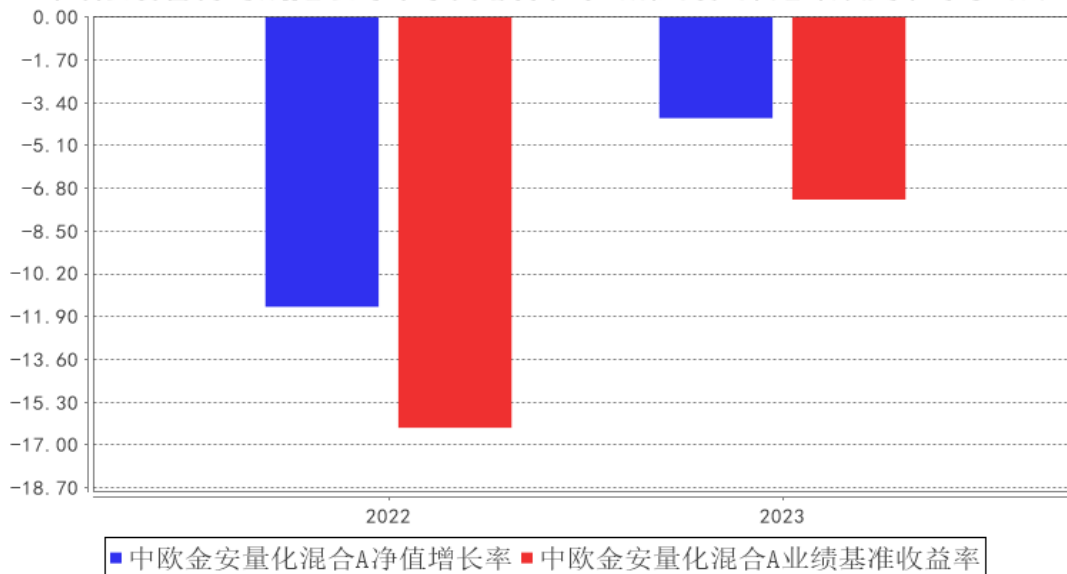


中欧金安量化混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

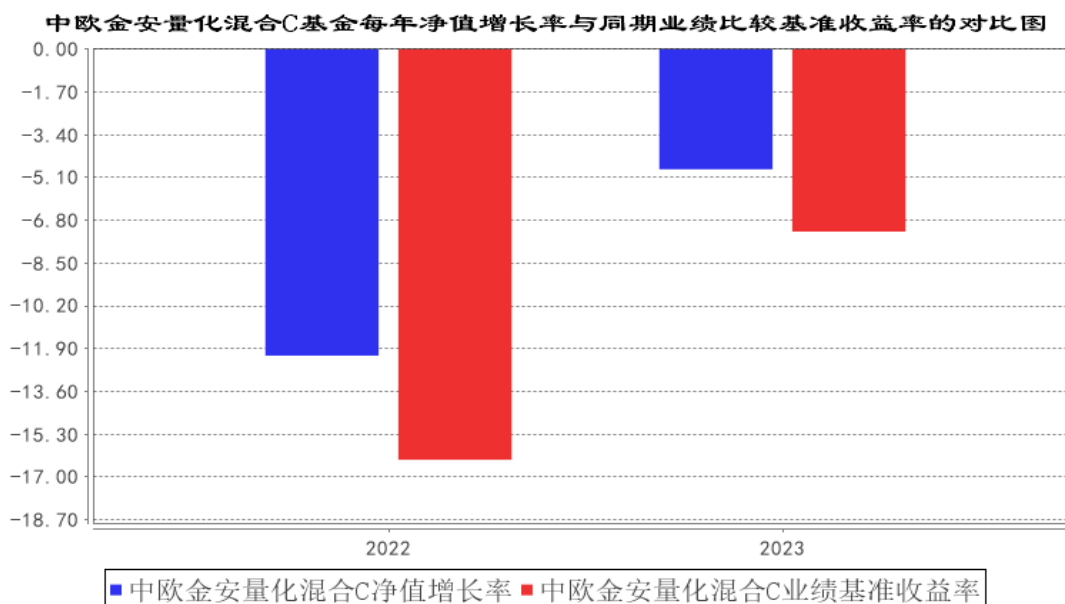


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧金安量化混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2022 年 1 月 20 日，2022 年度数据为 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 12 月 31 日数据。



注：本基金合同生效日为 2022 年 1 月 20 日，2022 年度数据为 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 165 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	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-01-20	-	16 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《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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	4,252,875,183.55	2016-01-13
	私募资产管理计划	1	159,488,215.97	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,412,363,399.52	-

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，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1只，离任时间：2023-09-27。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息

进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 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 121 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

回顾 2023 年，市场指数呈现出先扬后抑的走势，同时市场风格的结构分化较大，上半年以通信、传媒、计算机为代表的 TMT 行业受益于全球 AI 技术爆发的催化，下半年高分红和价值风格具有相对收益，市场指数回调到历史估值的低位区间。但我们相信“均值回归”的规律依然存在。

从中证 500 指数的估值相对位置来看，无论是市盈率还是市净率，都在比较低位的区间。经济周期是驱动市场周期的内在动力，工业增加值和工业企业利润同比增速的拐点或已在 2023 年出现，同时，上市公司的盈利拐点（用整体法计算的净利润同比增速的拐点）也有望在 2023 年第 4 季度的财报中确认。其次，市场的情绪周期也在低位。投资者情绪就像钟摆，引发市场的估值从过高到过低两个端点来回摆动。每当钟摆接近极端点的时候，极度悲观或者乐观的情绪无以为继，钟摆的运动方向发生反转。此时的市场上，风险规避类的投资策略占优，对公司业绩预期过于谨慎，而周期反转的力量也蕴含其中，可以更加乐观起来。我国的经济处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会。当前，优质公司的基本面投资的安全边际更加坚实，展望未来，我们对权益市场保有信心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-4.01%，同期业绩比较基准收益率为-7.25%；基金 C 类份额净值增长率为-4.77%，同期业绩比较基准收益率为-7.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国的经济处于新旧产业逐步切换的过程中，在新能源、新材料、智能制造等产业链各环节中，有许多细分赛道存在国产或者渗透率提升的投资机会，经济整体处于向好趋势中。展望 2024 年初，新增社融符合市场预期，政府债融资同比明显改善。2024 年全国 GDP 目标增速或在 5%左右。在稳增长目标下，相信“三大工程”政策的持续推出，将对经济形成有效助力。证券市场方面，促进资本市场平稳健康发展政策频出，一方面是强调宏观政策取向一致性，加强了协调配合。二是推动中长期资金入市。三是提高上市公司质量和投资价值。同时，整体 A 股已经调整较长周期，优质公司的估值安全边际更加坚实，我们对权益市场保有信心。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2023 年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣

传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2023 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制订或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2023 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2023 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化反洗钱和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、培训宣传、风险评估等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门完成反洗钱自查工作，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，开发和完善了反洗钱系统各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据国家有关法律法规、基金合同的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告期内，由本基金管理人编制并经托管人复核的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

托管人提示投资者关注：因托管人获取信息有限，请投资者谨慎识别和判断风险，并及时向基金管理人获取本基金实际投资项目状况和风险状况等。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70028871_B89 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧金安量化混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧金安量化混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>不适用</p>
<p>其他事项</p>	<p>不适用</p>
<p>其他信息</p>	<p>中欧金安量化混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中欧金安量化混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中欧金安量化混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风</p>

	<p>险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧金安量化混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧金安量化混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 张亚旋
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024年3月28日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	50,808,752.85	23,630,781.40
结算备付金		3,489,990.13	19,809,503.79
存出保证金		1,039,603.20	-
交易性金融资产	7.4.7.2	532,757,281.96	775,734,741.70
其中：股票投资		532,757,281.96	734,856,381.43
基金投资		-	-

债券投资		-	40,878,360.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		521,498.23	297,414.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		588,617,126.37	819,472,441.75
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		236,369.85	1,542,582.34
应付管理人报酬		603,482.37	1,053,471.26
应付托管费		100,580.39	140,462.84
应付销售服务费		48,994.99	70,828.12
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	7.4.7.6	70,043.71	202,825.50
负债合计		1,059,471.31	3,010,170.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	693,047,918.43	923,622,751.75
未分配利润	7.4.7.8	-105,490,263.37	-107,160,480.06
净资产合计		587,557,655.06	816,462,271.69
负债和净资产总计		588,617,126.37	819,472,441.75

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 693,047,918.43 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8494 元，基金份额总额 608,617,669.78 份；下属 C 类基金份额净值为人民币

0.8363 元，基金份额总额 84,430,248.65 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 01 月 20 日生效，上年度可比期间自 2022 年 01 月 20 日至 2022 年 12 月 31 日，下同。

7.2 利润表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 20 日(基金合 同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-7,258,849.05	-99,017,271.06
1. 利息收入		645,266.90	2,318,647.99
其中：存款利息收入	7.4.7.9	199,307.21	1,468,995.79
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		445,959.69	849,652.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-31,483,940.48	-69,685,662.54
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-34,251,809.90	-86,877,158.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	486,630.73	92,011.71
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-5,265,105.61	9,117,055.81
股利收益	7.4.7.14	7,546,344.30	7,982,428.54
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.15	22,838,444.15	-32,807,832.49
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.16	741,380.38	1,157,575.98
减：二、营业总支出		12,402,104.64	15,396,471.79
1. 管理人报酬		9,983,455.47	12,622,364.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		1,455,691.25	1,682,981.99

3. 销售服务费		752,594.03	849,336.01
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,122.21	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,122.21	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,241.68	39,489.13
8. 其他费用	7.4.7.18	208,000.00	202,300.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,660,953.69	-114,413,742.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,660,953.69	-114,413,742.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,660,953.69	-114,413,742.85

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	923,622,751.75	-	-107,160,480.06	816,462,271.69
二、本期期初净资产	923,622,751.75	-	-107,160,480.06	816,462,271.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-230,574,833.32	-	1,670,216.69	-228,904,616.63
（一）、综合收益总额	-	-	-19,660,953.69	-19,660,953.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-230,574,833.32	-	21,331,170.38	-209,243,662.94
其中：1. 基金申购款	172,533,207.47	-	-12,398,759.90	160,134,447.57
2. 基金赎回款	-403,108,040.7	-	33,729,930.28	-369,378,110.51

	9			
(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	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06
项目	上年度可比期间			
	2022年1月20日(基金合同生效日)至2022年12月31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	1,032,840,253.50	-	-	1,032,840,253.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-109,217,501.75	-	-107,160,480.06	-216,377,981.81
(一)、综合收益总额	-	-	-114,413,742.85	-114,413,742.85
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-109,217,501.75	-	7,253,262.79	-101,964,238.96
其中：1. 基金申购款	344,368,921.32	-	-19,027,826.70	325,341,094.62
2. 基金赎回款	-453,586,423.07	-	26,281,089.49	-427,305,333.58
(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	923,622,751.75	-	-107,160,480.06	816,462,271.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧金安量化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[2021]3328 号文《关于准予中欧金安量化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《中欧金安量化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 1,032,691,612.76 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_B11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,032,840,253.50 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 148,640.74 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 893,269,013.78 份，包含认购利息折合 133,841.80 份；C 类基金的基金份额总额为 139,571,239.72 份，包含认购利息折合 14,798.94 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，基金托管人为国金证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化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（包括创业板股票、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、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、公开发行的次级债、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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投资比例不超过全部股票资产的 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%。如法律法规或中国证监会允许,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 500 指数收益率×90%+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)×5%。

7.4.2 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》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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合同利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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，具体收益分配安排详见

基金管理人届时公告；

(2) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.6.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	260,935.82	6,320,294.18
等于：本金	260,525.49	6,311,749.60
加：应计利息	410.33	8,544.58

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	50,547,817.03	17,310,487.22
等于：本金	50,545,015.04	17,304,648.63
加：应计利息	2,801.99	5,838.59
减：坏账准备	-	-
合计	50,808,752.85	23,630,781.40

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	542,727,670.30	-	532,757,281.96	-9,970,388.34	
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	542,727,670.30	-	532,757,281.96	-9,970,388.34	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	767,665,924.92	-	734,856,381.43	-32,809,543.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	40,521,149.00	355,500.27	40,878,360.27	1,711.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	40,521,149.00	355,500.27	40,878,360.27	1,711.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		0.00	0.00	0.00	0.00
	合计	808,187,073.92	355,500.27	775,734,741.70	-32,807,832.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	8,662,360.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	8,662,360.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	8,662,360.00	-	-	-	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

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

7.4.7.3.2 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
IC2403	IC2403	8.00	8,663,360.00	1,000.00
合计				1,000.00
减：可抵销期货 暂收款				1,000.00
净额				0.00

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	43.71	2,825.50
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	70,000.00	80,000.00
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
合计	70,043.71	202,825.50

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	800,959,772.88	800,959,772.88
本期申购	149,938,906.01	149,938,906.01
本期赎回（以“-”号填列）	-342,281,009.11	-342,281,009.11
本期末	608,617,669.78	608,617,669.78

中欧金安量化混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	122,662,978.87	122,662,978.87
本期申购	22,594,301.46	22,594,301.46
本期赎回 (以“-”号填列)	-60,827,031.68	-60,827,031.68
本期末	84,430,248.65	84,430,248.65

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-59,309,756.68	-32,909,807.08	-92,219,563.76
本期期初	-59,309,756.68	-32,909,807.08	-92,219,563.76
本期利润	-36,126,584.03	19,191,668.26	-16,934,915.77
本期基金份额交易产生的变动数	15,341,161.92	2,146,955.65	17,488,117.57
其中：基金申购款	-10,694,938.03	100,180.30	-10,594,757.73
基金赎回款	26,036,099.95	2,046,775.35	28,082,875.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,095,178.79	-11,571,183.17	-91,666,361.96

中欧金安量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,934,944.94	-5,005,971.36	-14,940,916.30
本期期初	-9,934,944.94	-5,005,971.36	-14,940,916.30
本期利润	-6,372,813.81	3,646,775.89	-2,726,037.92
本期基金份额交易产生的变动数	4,076,386.61	-233,333.80	3,843,052.81
其中：基金申购款	-1,715,265.18	-88,736.99	-1,804,002.17
基金赎回款	5,791,651.79	-144,596.81	5,647,054.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,231,372.14	-1,592,529.27	-13,823,901.41

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	64,848.28
定期存款利息收入	-	95,277.78
其他存款利息收入	81,928.85	402,398.48
结算备付金利息收入	52,530.08	363,371.92

其他	-	-
合计	199,307.21	1,468,995.79

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,977,467,627.10	4,498,993,405.08
减：卖出股票成本总额	5,001,022,115.63	4,573,862,685.30
减：交易费用	10,697,321.37	12,007,878.38
买卖股票差价收入	-34,251,809.90	-86,877,158.60

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	407,779.73	92,011.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	78,851.00	-
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	486,630.73	92,011.71

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	41,363,280.00	-
减：卖出债券（债转股	40,521,149.00	-

及债券到期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	763,280.00	-
减: 交易费用	-	-
买卖债券差价收入	78,851.00	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月20日(基金合同生效日)至2022年12月31日
股指期货投资收益	-5,265,105.61	9,117,055.81

7.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月20日(基金合同生效日)至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,546,344.30	7,982,428.54
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	7,546,344.30	7,982,428.54

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月20日(基金合同生效日)至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	22,837,444.15	-32,807,832.49
股票投资	22,839,155.15	-32,809,543.49
债券投资	-1,711.00	1,711.00

资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	1,000.00	-
权证投资	-	-
期货投资	1,000.00	-
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	22,838,444.15	-32,807,832.49

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	740,968.44	1,156,141.82
基金转换费收入	411.94	1,434.16
合计	741,380.38	1,157,575.98

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	70,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	1,500.00
开户费	-	800.00
合计	208,000.00	202,300.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
国金证券股份有限公司 (“国金证券”)	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
WP Asia Pacific Asset Management LLC (“华平亚太资管”)	基金管理人的股东(自 2023 年 6 月 1 日起)
Unione di Banche Italiane S.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东(截止至 2023 年 5 月 31 日)
上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙) (“上海穆延合伙”)	基金管理人的股东(自 2023 年 5 月 11 日起)
万盛基业投资有限责任公司 (“万盛基业”)	基金管理人的股东(截止至 2023 年 5 月 10 日)
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙) (“上海睦亿合伙”)	基金管理人股东
自然人股东	基金管理人股东
上海中欧财富基金销售有限公司 (“中欧财富”)	基金管理人的控股子公司、基金销售机构
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 (“中欧盛世资管”)	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司 (“中欧基金国际”)	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
国金证券	1,432,459,973.29	14.72	1,859,989,366.56	18.93

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 20 日（基金合同生效日） 至 2022 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国金证券	-	-	9,040,648.82	22.17

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券	823,398,000.00	16.75	1,132,037,000.00	33.98

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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 (%)
国金证券	1,366,924.15	23.66	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31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 (%)
国金证券	1,496,596.42	22.41	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	9,983,455.47	12,622,364.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,836,762.06	4,762,839.83
应支付基金管理人的净管理费	6,146,693.41	7,859,524.83

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费率由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,455,691.25	1,682,981.99

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

7.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券	-	99,849.71	99,849.71

中欧财富	-	5,634.42	5,634.42
中欧基金	-	0.00	0.00
合计	-	105,484.13	105,484.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券	-	187,509.70	187,509.70
中欧财富	-	2,984.05	2,984.05
中欧基金	-	2,840.76	2,840.76
合计	-	193,334.51	193,334.51

注：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按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H = E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$ H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为该类基金份额前一日基金资产净值 C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

7.4.10.5.2 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

中欧金安量化混合 A

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	438,079.85	0.07%	107,032.07	0.01%

注：1、本报告期及上年度可比期间，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。

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

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022 年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国金证券股份有 限公司	3,000,325.27	84,204.41	14,848,318.25	751,135.75

注：本基金的银行存款由基金托管人国金证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永 达	2023 年12	6个月	新 股 流 通	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-

	股份	月4日		受限						
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-

	子									
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	403	22,439.04	15,144.74	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪	2023	6个月	新股	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-

	恩 汽 电	年6月 26日		流 通 受 限						
301489	思 泉 新 材	2023 年10 月16 日	6个月	新 股 流 通 受 限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维 科 精 密	2023 年7月 13日	6个月	新 股 流 通 受 限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞 南 资 源	2023 年9月 13日	6个月	新 股 流 通 受 限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏 州 规 划	2023 年7月 12日	6个月	新 股 流 通 受 限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民 生 健 康	2023 年8月 24日	6个月	新 股 流 通 受 限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中 机 认 检	2023 年11 月23 日	6个月	新 股 流 通 受 限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固 高 科 技	2023 年8月 4日	6个月	新 股 流 通 受 限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德 福 科 技	2023 年8月 8日	6个月	新 股 流 通 受 限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港 通 医 疗	2023 年7月 13日	6个月	新 股 流 通 受 限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中 远 通	2023 年12 月1日	6个月	新 股 流 通 受 限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕 西	2023 年10	6个月	新 股 流 通	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-

	华达	月9日		受限							
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	191	19,017.87	15,558.86	-	
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301555	惠柏新	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	

	材	日								
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	782	18,940.04	14,263.68	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	981	11,036.25	10,859.67	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-

	配	日								
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	332	26,825.60	25,813.00	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	2,951	29,126.37	37,625.25	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,002	20,730.36	32,376.18	-

688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	529	41,785.71	31,999.21	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	410	19,388.90	15,567.70	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

	信	日								
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锴威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	453	19,324.98	21,825.54	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 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
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大资产重组	8.48	2024年1月10日	9.33	50,320	456,349.80	426,713.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。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，将风险控制在可接受的范围内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 7.4.12 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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	50,808,752.85	-	-	-	50,808,752.85
结算备付金	3,489,990.13	-	-	-	3,489,990.13
存出保证金	-	-	-	1,039,603.20	1,039,603.20
交易性金融资产	-	-	-	532,757,281.96	532,757,281.96
应收申购款	-	-	-	521,498.23	521,498.23
资产总计	54,298,742.98	-	-	534,318,383.39	588,617,126.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	236,369.85	236,369.85
应付管理人报酬	-	-	-	603,482.37	603,482.37
应付托管费	-	-	-	100,580.39	100,580.39
应付销售服务费	-	-	-	48,994.99	48,994.99
其他负债	-	-	-	70,043.71	70,043.71
负债总计	-	-	-	1,059,471.31	1,059,471.31
利率敏感度缺口	54,298,742.98	-	-	533,258,912.08	587,557,655.06
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,630,781.40	-	-	-	23,630,781.40
结算备付金	19,809,503.79	-	-	-	19,809,503.79
交易性金融资产	40,878,360.27	-	-	734,856,381.43	775,734,741.70
应收申购款	-	-	-	297,414.86	297,414.86
资产总计	84,318,645.46	-	-	735,153,796.29	819,472,441.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,542,582.34	1,542,582.34

应付管理人报酬	-	-	-	1,053,471.26	1,053,471.26
应付托管费	-	-	-	140,462.84	140,462.84
应付销售服务费	-	-	-	70,828.12	70,828.12
其他负债	-	-	-	202,825.50	202,825.50
负债总计	-	-	-	3,010,170.06	3,010,170.06
利率敏感度缺口	84,318,645.46	-	-	-732,143,626.23	816,462,271.69

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 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%（2022 年 12 月 31 日：5.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	532,757,281.96	90.67	734,856,381.43	90.00
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	532,757,281.96	90.67	734,856,381.43	90.00

7.4.13.4.3.2 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，表格中本期与上期的数据均披露		
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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	27,677,292.49	40,318,961.21
	业绩比较基准下降5%	-27,677,292.49	-40,318,961.21

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	531,247,017.74	730,966,048.99
第二层次	426,713.60	40,878,360.27
第三层次	1,083,550.62	3,890,332.44
合计	532,757,281.96	775,734,741.70

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不

会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	3,890,332.44	3,890,332.44
当期购买	0.00	913,974.93	913,974.93
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	3,890,332.44	3,890,332.44
当期利得或损失总额	0.00	169,575.69	169,575.69
其中：计入损益的利得或损失	0.00	169,575.69	169,575.69
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	1,083,550.62	1,083,550.62
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	169,575.69	169,575.69
项目	上年度可比期间 2022年1月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	0.00	0.00
当期购买	0.00	3,562,127.35	3,562,127.35
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	0.00	0.00
当期利得或损失总额	0.00	328,205.09	328,205.09
其中：计入损益的利得或损失	0.00	328,205.09	328,205.09

计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	3,890,332.44	3,890,332.44
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	328,205.09	328,205.09

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,083,550.62	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,890,332.44	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	532,757,281.96	90.51
	其中：股票	532,757,281.96	90.51
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	54,298,742.98	9.22
8	其他各项资产	1,561,101.43	0.27
9	合计	588,617,126.37	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,987,370.00	0.34
B	采矿业	10,784,440.00	1.84
C	制造业	368,394,480.22	62.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,301,397.00	2.09
E	建筑业	13,078,606.00	2.23
F	批发和零售业	9,433,887.63	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	7,800,089.17	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,151,581.78	6.83
J	金融业	32,256,024.76	5.49
K	房地产业	7,202,351.48	1.23
L	租赁和商务服务业	4,583,342.10	0.78
M	科学研究和技术服务业	7,769,831.30	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	4,605,101.52	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	772,585.00	0.13
P	教育	1,276,225.00	0.22

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,213,487.00	1.57
S	综合	1,146,482.00	0.20
	合计	532,757,281.96	90.67

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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	600155	华创云信	889,800	7,420,932.00	1.26
2	601136	首创证券	355,863	6,035,436.48	1.03
3	002670	国盛金控	597,404	5,567,805.28	0.95
4	301391	卡莱特	32,700	3,743,496.00	0.64
5	000932	华菱钢铁	689,900	3,552,985.00	0.60
6	002997	瑞鹄模具	103,300	3,441,956.00	0.59
7	002541	鸿路钢构	158,100	3,435,513.00	0.58
8	300418	昆仑万维	84,400	3,156,560.00	0.54
9	688120	华海清科	16,643	3,123,891.10	0.53
10	688072	拓荆科技	13,311	3,078,834.30	0.52
11	603516	淳中科技	134,200	3,015,474.00	0.51
12	600373	中文传媒	226,900	2,990,542.00	0.51
13	600316	洪都航空	137,800	2,917,226.00	0.50
14	000568	泸州老窖	15,100	2,709,242.00	0.46
15	688019	安集科技	16,777	2,680,293.52	0.46
16	600039	四川路桥	351,200	2,630,488.00	0.45
17	688558	国盛智科	85,842	2,437,912.80	0.41
18	600566	济川药业	73,700	2,316,391.00	0.39
19	300213	佳讯飞鸿	312,900	2,252,880.00	0.38
20	000725	京东方 A	575,100	2,242,890.00	0.38
21	688012	中微公司	14,524	2,230,886.40	0.38
22	688258	卓易信息	44,700	2,212,650.00	0.38
23	600519	贵州茅台	1,200	2,071,200.00	0.35
24	603267	鸿远电子	41,100	2,063,220.00	0.35
25	002022	科华生物	180,700	2,056,366.00	0.35
26	000333	美的集团	37,600	2,054,088.00	0.35
27	688078	龙软科技	48,031	1,936,609.92	0.33
28	600582	天地科技	355,900	1,936,096.00	0.33
29	603383	顶点软件	38,600	1,902,980.00	0.32
30	301129	瑞纳智能	70,500	1,877,415.00	0.32
31	600529	山东药玻	73,300	1,876,480.00	0.32
32	603826	坤彩科技	31,700	1,871,251.00	0.32

33	603868	飞科电器	36,900	1,863,450.00	0.32
34	603658	安图生物	32,600	1,858,526.00	0.32
35	000893	亚钾国际	70,100	1,839,424.00	0.31
36	688167	炬光科技	16,060	1,830,840.00	0.31
37	688687	凯因科技	52,406	1,826,873.16	0.31
38	601168	西部矿业	126,300	1,802,301.00	0.31
39	002244	滨江集团	246,400	1,791,328.00	0.30
40	601233	桐昆股份	118,000	1,785,340.00	0.30
41	601636	旗滨集团	256,800	1,756,512.00	0.30
42	002810	山东赫达	82,100	1,739,699.00	0.30
43	002415	海康威视	49,900	1,732,528.00	0.29
44	603327	福蓉科技	128,700	1,715,571.00	0.29
45	600941	中国移动	17,200	1,711,056.00	0.29
46	688209	英集芯	94,423	1,686,394.78	0.29
47	688981	中芯国际	31,539	1,672,197.78	0.28
48	002092	中泰化学	268,900	1,640,290.00	0.28
49	001314	亿道信息	22,600	1,625,618.00	0.28
50	600900	长江电力	68,000	1,587,120.00	0.27
51	300315	掌趣科技	307,200	1,582,080.00	0.27
52	002126	银轮股份	84,300	1,573,881.00	0.27
53	300996	普联软件	68,500	1,568,650.00	0.27
54	002028	思源电气	30,100	1,566,404.00	0.27
55	688362	甬矽电子	59,730	1,564,328.70	0.27
56	000661	长春高新	10,600	1,545,480.00	0.26
57	002463	沪电股份	68,500	1,515,220.00	0.26
58	000933	神火股份	89,500	1,503,600.00	0.26
59	300687	赛意信息	68,800	1,498,464.00	0.26
60	300873	海晨股份	62,600	1,490,506.00	0.25
61	301272	英华特	26,900	1,461,208.00	0.25
62	301117	佳缘科技	26,800	1,460,868.00	0.25
63	600064	南京高科	236,612	1,429,136.48	0.24
64	300729	乐歌股份	79,741	1,428,161.31	0.24
65	603500	祥和实业	116,300	1,424,675.00	0.24
66	002568	百润股份	57,500	1,415,075.00	0.24
67	600028	中国石化	252,300	1,407,834.00	0.24
68	002508	老板电器	64,300	1,400,454.00	0.24
69	688529	豪森智能	60,561	1,397,142.27	0.24
70	600642	申能股份	215,700	1,384,794.00	0.24
71	300335	迪森股份	244,900	1,371,440.00	0.23
72	301312	智立方	12,600	1,365,084.00	0.23
73	600379	宝光股份	134,900	1,355,745.00	0.23
74	300583	赛托生物	67,200	1,329,216.00	0.23
75	002444	巨星科技	59,000	1,328,680.00	0.23

76	000090	天健集团	287,500	1,322,500.00	0.23
77	688613	奥精医疗	59,000	1,313,340.00	0.22
78	300803	指南针	21,700	1,307,642.00	0.22
79	688048	长光华芯	20,837	1,305,854.79	0.22
80	600323	瀚蓝环境	74,890	1,297,843.70	0.22
81	300556	丝路视觉	35,200	1,297,120.00	0.22
82	600588	用友网络	72,837	1,295,770.23	0.22
83	688772	珠海冠宇	58,800	1,294,188.00	0.22
84	300604	长川科技	34,000	1,291,660.00	0.22
85	600961	株冶集团	154,300	1,289,948.00	0.22
86	688157	松井股份	23,880	1,288,087.20	0.22
87	605287	德才股份	75,800	1,286,326.00	0.22
88	600435	北方导航	109,200	1,282,008.00	0.22
89	600847	万里股份	107,400	1,280,208.00	0.22
90	002730	电光科技	134,700	1,276,956.00	0.22
91	603596	伯特利	18,400	1,275,120.00	0.22
92	603589	口子窖	28,100	1,272,930.00	0.22
93	600101	明星电力	150,800	1,268,228.00	0.22
94	688093	世华科技	69,500	1,265,595.00	0.22
95	601985	中国核电	168,700	1,265,250.00	0.22
96	688169	石头科技	4,447	1,258,278.65	0.21
97	001218	丽臣实业	58,200	1,257,702.00	0.21
98	600104	上汽集团	92,200	1,247,466.00	0.21
99	600795	国电电力	298,300	1,240,928.00	0.21
100	000157	中联重科	189,700	1,238,741.00	0.21
101	601113	华鼎股份	361,100	1,238,573.00	0.21
102	300411	金盾股份	177,100	1,237,929.00	0.21
103	688468	科美诊断	114,500	1,235,455.00	0.21
104	603233	大参林	49,500	1,232,550.00	0.21
105	000581	威孚高科	81,700	1,231,219.00	0.21
106	603439	贵州三力	64,300	1,213,984.00	0.21
107	300582	英飞特	101,000	1,213,010.00	0.21
108	688550	瑞联新材	30,493	1,209,962.24	0.21
109	300239	东宝生物	193,700	1,206,751.00	0.21
110	000619	海螺新材	174,100	1,204,772.00	0.21
111	688499	利元亨	31,600	1,203,328.00	0.20
112	002236	大华股份	65,100	1,201,095.00	0.20
113	300981	中红医疗	74,430	1,192,368.60	0.20
114	002831	裕同科技	43,100	1,185,681.00	0.20
115	000533	顺钠股份	252,700	1,185,163.00	0.20
116	688707	振华新材	57,800	1,184,900.00	0.20
117	300838	浙江力诺	72,400	1,184,464.00	0.20
118	605399	晨光新材	87,300	1,183,788.00	0.20

119	688269	凯立新材	31,924	1,181,507.24	0.20
120	600461	洪城环境	128,800	1,177,232.00	0.20
121	300586	美联新材	145,500	1,177,095.00	0.20
122	603071	物产环能	77,400	1,176,480.00	0.20
123	601728	中国电信	217,300	1,175,593.00	0.20
124	601098	中南传媒	115,500	1,174,635.00	0.20
125	002376	新北洋	153,800	1,171,956.00	0.20
126	688682	霍莱沃	24,563	1,171,900.73	0.20
127	002110	三钢闽光	289,100	1,170,855.00	0.20
128	688768	容知日新	31,800	1,170,558.00	0.20
129	300371	汇中股份	95,640	1,165,851.60	0.20
130	601717	郑煤机	91,900	1,162,535.00	0.20
131	600741	华域汽车	71,400	1,162,392.00	0.20
132	600690	海尔智家	55,300	1,161,300.00	0.20
133	603787	新日股份	92,700	1,159,677.00	0.20
134	600967	内蒙一机	140,300	1,158,878.00	0.20
135	688676	金盘科技	32,300	1,157,309.00	0.20
136	002572	索菲亚	72,400	1,154,780.00	0.20
137	688308	欧科亿	41,300	1,152,270.00	0.20
138	000030	富奥股份	215,700	1,151,838.00	0.20
139	605080	浙江自然	54,400	1,151,648.00	0.20
140	601088	中国神华	36,700	1,150,545.00	0.20
141	600901	江苏金租	237,500	1,149,500.00	0.20
142	600499	科达制造	108,900	1,148,895.00	0.20
143	603977	国泰集团	110,400	1,148,160.00	0.20
144	601288	农业银行	315,300	1,147,692.00	0.20
145	301199	迈赫股份	43,700	1,147,125.00	0.20
146	601398	工商银行	239,900	1,146,722.00	0.20
147	000906	浙商中拓	156,600	1,144,746.00	0.19
148	601988	中国银行	286,900	1,144,731.00	0.19
149	600790	轻纺城	288,300	1,144,551.00	0.19
150	000789	万年青	166,800	1,144,248.00	0.19
151	600820	隧道股份	198,600	1,143,936.00	0.19
152	603707	健友股份	76,200	1,143,000.00	0.19
153	000930	中粮科技	172,100	1,142,744.00	0.19
154	603511	爱慕股份	73,800	1,142,424.00	0.19
155	002030	达安基因	117,942	1,141,678.56	0.19
156	601857	中国石油	161,700	1,141,602.00	0.19
157	600262	北方股份	59,300	1,141,525.00	0.19
158	300062	中能电气	183,200	1,141,336.00	0.19
159	002068	黑猫股份	98,200	1,139,120.00	0.19
160	601998	中信银行	215,300	1,138,937.00	0.19
161	688148	芳源股份	148,100	1,135,927.00	0.19

162	601633	长城汽车	45,000	1,134,900.00	0.19
163	300901	中胤时尚	110,800	1,134,592.00	0.19
164	300969	恒帅股份	12,600	1,132,362.00	0.19
165	600662	外服控股	235,000	1,128,000.00	0.19
166	601229	上海银行	188,700	1,126,539.00	0.19
167	300743	天地数码	81,100	1,125,668.00	0.19
168	603098	森特股份	82,700	1,125,547.00	0.19
169	300349	金卡智能	90,500	1,124,010.00	0.19
170	300789	唐源电气	49,800	1,122,492.00	0.19
171	601658	邮储银行	257,300	1,119,255.00	0.19
172	603319	湘油泵	63,600	1,115,544.00	0.19
173	002225	濮耐股份	294,000	1,111,320.00	0.19
174	300963	中洲特材	84,500	1,108,640.00	0.19
175	688260	昀冢科技	36,307	1,100,102.10	0.19
176	688077	大地熊	46,100	1,099,485.00	0.19
177	300779	惠城环保	21,300	1,099,080.00	0.19
178	300494	盛天网络	69,300	1,095,633.00	0.19
179	688720	艾森股份	18,207	1,095,434.52	0.19
180	688028	沃尔德	43,900	1,092,671.00	0.19
181	300117	嘉寓股份	376,100	1,090,690.00	0.19
182	002061	浙江交科	298,500	1,089,525.00	0.19
183	600886	国投电力	82,600	1,088,668.00	0.19
184	600938	中国海油	51,300	1,075,761.00	0.18
185	300871	回盛生物	73,400	1,061,364.00	0.18
186	000423	东阿阿胶	21,500	1,060,380.00	0.18
187	688401	路维光电	34,516	1,060,331.52	0.18
188	300274	阳光电源	12,100	1,059,839.00	0.18
189	603339	四方科技	89,100	1,059,399.00	0.18
190	688699	明微电子	25,900	1,045,065.00	0.18
191	300092	科新机电	78,100	1,040,292.00	0.18
192	600421	华嵘控股	93,300	1,038,429.00	0.18
193	300700	岱勒新材	60,900	1,033,473.00	0.18
194	300462	华铭智能	87,300	1,029,267.00	0.18
195	002150	通润装备	58,000	1,028,920.00	0.18
196	601598	中国外运	196,100	1,027,564.00	0.17
197	600079	人福医药	41,100	1,021,746.00	0.17
198	600356	恒丰纸业	127,300	1,015,854.00	0.17
199	300161	华中数控	28,200	1,012,380.00	0.17
200	002852	道道全	93,100	1,007,342.00	0.17
201	000977	浪潮信息	30,300	1,005,960.00	0.17
202	600166	福田汽车	364,500	995,085.00	0.17
203	688728	格科微	48,600	994,842.00	0.17
204	600755	厦门国贸	141,900	989,043.00	0.17

205	603666	亿嘉和	31,500	988,785.00	0.17
206	600475	华光环能	95,000	988,000.00	0.17
207	300778	新城市	71,900	977,840.00	0.17
208	688278	特宝生物	18,618	974,652.30	0.17
209	603369	今世缘	19,900	970,125.00	0.17
210	601369	陕鼓动力	121,300	967,974.00	0.16
211	603200	上海洗霸	45,400	966,566.00	0.16
212	002540	亚太科技	145,900	964,399.00	0.16
213	003000	劲仔食品	78,900	964,158.00	0.16
214	688577	浙海德曼	10,200	960,840.00	0.16
215	601966	玲珑轮胎	49,700	955,731.00	0.16
216	600985	淮北矿业	57,400	954,562.00	0.16
217	000810	创维数字	60,400	948,884.00	0.16
218	600398	海澜之家	127,700	947,534.00	0.16
219	002446	盛路通信	114,000	946,200.00	0.16
220	300782	卓胜微	6,700	944,700.00	0.16
221	002035	华帝股份	150,800	936,468.00	0.16
222	601100	恒立液压	17,100	935,028.00	0.16
223	002034	旺能环境	60,800	927,200.00	0.16
224	600416	湘电股份	58,200	924,216.00	0.16
225	001309	德明利	9,700	920,433.00	0.16
226	001306	夏厦精密	10,164	920,388.04	0.16
227	600546	山煤国际	52,500	919,275.00	0.16
228	300415	伊之密	51,700	911,471.00	0.16
229	002273	水晶光电	67,200	909,888.00	0.15
230	600482	中国动力	50,300	905,903.00	0.15
231	300419	浩丰科技	151,200	892,080.00	0.15
232	688313	仕佳光子	70,000	889,700.00	0.15
233	688150	莱特光电	41,141	888,234.19	0.15
234	002558	巨人网络	79,700	887,858.00	0.15
235	300203	聚光科技	55,900	886,015.00	0.15
236	688357	建龙微纳	17,101	883,950.69	0.15
237	600353	旭光电子	96,700	883,838.00	0.15
238	002085	万丰奥威	178,900	883,766.00	0.15
239	300548	博创科技	32,700	881,919.00	0.15
240	601009	南京银行	119,200	879,696.00	0.15
241	603379	三美股份	25,800	877,200.00	0.15
242	601058	赛轮轮胎	74,500	875,375.00	0.15
243	000998	隆平高科	61,800	871,380.00	0.15
244	600895	张江高科	45,100	870,430.00	0.15
245	002738	中矿资源	23,300	869,323.00	0.15
246	000830	鲁西化工	86,500	867,595.00	0.15
247	600399	抚顺特钢	89,000	865,080.00	0.15

248	003023	彩虹集团	42,500	861,050.00	0.15
249	600325	华发股份	119,100	858,711.00	0.15
250	000975	银泰黄金	57,200	858,000.00	0.15
251	688097	博众精工	25,400	853,440.00	0.15
252	688596	正帆科技	21,385	847,487.55	0.14
253	002452	长高电新	119,300	847,030.00	0.14
254	300833	浩洋股份	9,400	846,940.00	0.14
255	001965	招商公路	86,200	842,174.00	0.14
256	000630	铜陵有色	255,800	839,024.00	0.14
257	601318	中国平安	20,800	838,240.00	0.14
258	688361	中科飞测	11,225	835,476.75	0.14
259	002422	科伦药业	28,700	833,735.00	0.14
260	601138	工业富联	54,900	830,088.00	0.14
261	688330	宏力达	29,190	829,287.90	0.14
262	600160	巨化股份	50,000	824,500.00	0.14
263	600057	厦门象屿	122,300	820,633.00	0.14
264	603408	建霖家居	63,800	819,192.00	0.14
265	002600	领益智造	118,600	801,736.00	0.14
266	600377	宁沪高速	78,200	801,550.00	0.14
267	301349	信德新材	17,000	800,360.00	0.14
268	600761	安徽合力	43,800	797,598.00	0.14
269	000902	新洋丰	70,000	797,300.00	0.14
270	603096	新经典	40,400	795,072.00	0.14
271	688041	海光信息	11,200	794,976.00	0.14
272	300251	光线传媒	97,500	794,625.00	0.14
273	603328	依顿电子	97,300	792,995.00	0.13
274	600633	浙数文化	71,300	788,578.00	0.13
275	002152	广电运通	64,300	788,318.00	0.13
276	002557	洽洽食品	22,600	786,932.00	0.13
277	601801	皖新传媒	113,200	786,740.00	0.13
278	300476	胜宏科技	42,600	785,970.00	0.13
279	603927	中科软	26,200	785,476.00	0.13
280	301177	迪阿股份	26,631	785,348.19	0.13
281	688503	聚和材料	14,639	784,650.40	0.13
282	000551	创元科技	74,800	783,156.00	0.13
283	002983	芯瑞达	25,330	781,683.80	0.13
284	000700	模塑科技	111,500	780,500.00	0.13
285	603859	能科科技	20,600	777,238.00	0.13
286	002701	奥瑞金	187,700	777,078.00	0.13
287	688636	智明达	11,900	775,880.00	0.13
288	002966	苏州银行	119,700	773,262.00	0.13
289	300736	百邦科技	60,500	772,585.00	0.13
290	600535	天士力	45,300	771,006.00	0.13

291	000338	潍柴动力	56,400	769,860.00	0.13
292	002960	青鸟消防	55,600	769,504.00	0.13
293	002048	宁波华翔	59,100	768,891.00	0.13
294	600210	紫江企业	163,000	766,100.00	0.13
295	603322	超讯通信	20,300	765,513.00	0.13
296	600153	建发股份	79,349	764,130.87	0.13
297	601038	一拖股份	52,400	763,468.00	0.13
298	300727	润禾材料	26,500	762,935.00	0.13
299	300682	朗新集团	46,500	762,135.00	0.13
300	002517	恺英网络	67,800	757,326.00	0.13
301	300254	仟源医药	78,300	754,029.00	0.13
302	600383	金地集团	172,200	750,792.00	0.13
303	000997	新大陆	38,200	749,102.00	0.13
304	300228	富瑞特装	105,500	749,050.00	0.13
305	605098	行动教育	19,400	747,870.00	0.13
306	000786	北新建材	32,000	747,520.00	0.13
307	002338	奥普光电	21,800	733,570.00	0.12
308	603778	国晟科技	131,000	728,360.00	0.12
309	688305	科德数控	9,521	727,880.45	0.12
310	300206	理邦仪器	71,000	724,910.00	0.12
311	002843	泰嘉股份	27,300	723,450.00	0.12
312	300280	紫天科技	16,900	722,137.00	0.12
313	600988	赤峰黄金	51,500	721,515.00	0.12
314	300054	鼎龙股份	29,700	718,740.00	0.12
315	601699	潞安环能	32,600	714,266.00	0.12
316	002779	中坚科技	28,700	713,769.00	0.12
317	603611	诺力股份	37,500	709,875.00	0.12
318	300260	新莱应材	23,200	705,976.00	0.12
319	688378	奥来德	14,900	705,366.00	0.12
320	300970	华绿生物	40,800	704,208.00	0.12
321	600415	小商品城	95,900	701,988.00	0.12
322	601766	中国中车	132,200	695,372.00	0.12
323	301235	华康医疗	26,700	684,321.00	0.12
324	603909	建发合诚	60,100	682,736.00	0.12
325	301383	天键股份	10,500	682,500.00	0.12
326	002409	雅克科技	12,200	679,906.00	0.12
327	600867	通化东宝	62,700	679,041.00	0.12
328	002262	恩华药业	25,000	678,000.00	0.12
329	600528	中铁工业	90,980	676,891.20	0.12
330	688153	唯捷创芯	10,300	674,650.00	0.11
331	601127	赛力斯	8,800	670,560.00	0.11
332	301313	凡拓数创	18,500	667,110.00	0.11
333	002430	杭氧股份	22,800	665,988.00	0.11

334	600801	华新水泥	52,900	657,547.00	0.11
335	000807	云铝股份	53,500	653,770.00	0.11
336	688601	力芯微	12,446	652,045.94	0.11
337	688127	蓝特光学	27,891	649,581.39	0.11
338	002920	德赛西威	5,000	647,550.00	0.11
339	601137	博威合金	41,600	646,048.00	0.11
340	002947	恒铭达	19,900	640,382.00	0.11
341	603308	应流股份	44,600	639,118.00	0.11
342	002903	宇环数控	24,800	633,640.00	0.11
343	688698	伟创电气	17,400	632,142.00	0.11
344	603901	永创智能	52,800	628,320.00	0.11
345	688518	联赢激光	30,451	623,636.48	0.11
346	603725	天安新材	55,900	622,167.00	0.11
347	688513	苑东生物	9,682	617,517.96	0.11
348	300384	三联虹普	38,500	614,460.00	0.10
349	688103	国力股份	12,227	603,769.26	0.10
350	300181	佐力药业	56,000	596,960.00	0.10
351	300042	朗科科技	17,000	595,000.00	0.10
352	300145	中金环境	196,900	594,638.00	0.10
353	301004	嘉益股份	13,000	590,850.00	0.10
354	603507	振江股份	22,800	590,748.00	0.10
355	002472	双环传动	22,700	590,654.00	0.10
356	002875	安奈儿	39,500	588,155.00	0.10
357	601928	凤凰传媒	66,500	585,865.00	0.10
358	688035	德邦科技	10,908	582,050.88	0.10
359	688589	力合微	14,500	578,695.00	0.10
360	002749	国光股份	48,100	576,238.00	0.10
361	600997	开滦股份	75,500	576,065.00	0.10
362	601600	中国铝业	101,500	572,460.00	0.10
363	002789	建艺集团	41,600	572,416.00	0.10
364	301050	雷电微力	9,800	570,948.00	0.10
365	301046	能辉科技	21,000	569,520.00	0.10
366	603167	渤海轮渡	64,100	569,208.00	0.10
367	603688	石英股份	6,500	564,720.00	0.10
368	002669	康达新材	47,300	563,816.00	0.10
369	300611	美力科技	49,000	563,010.00	0.10
370	603600	永艺股份	50,700	559,728.00	0.10
371	603556	海兴电力	19,200	557,376.00	0.09
372	601019	山东出版	59,300	556,234.00	0.09
373	300308	中际旭创	4,900	553,259.00	0.09
374	003002	壶化股份	36,400	552,916.00	0.09
375	300545	联得装备	16,000	552,800.00	0.09
376	300425	中建环能	117,900	551,772.00	0.09

377	603856	东宏股份	47,200	550,824.00	0.09
378	300124	汇川技术	8,700	549,318.00	0.09
379	301000	肇民科技	25,600	546,816.00	0.09
380	002929	润建股份	13,100	546,663.00	0.09
381	605289	罗曼股份	9,500	546,250.00	0.09
382	605128	上海沿浦	9,400	545,670.00	0.09
383	688218	江苏北人	27,406	544,557.22	0.09
384	300270	中威电子	70,400	543,488.00	0.09
385	000880	潍柴重机	51,100	543,193.00	0.09
386	002074	国轩高科	24,996	537,414.00	0.09
387	002015	协鑫能科	43,400	537,292.00	0.09
388	301345	涛涛车业	8,766	533,849.40	0.09
389	301158	德石股份	33,000	530,970.00	0.09
390	603915	国茂股份	32,100	529,008.00	0.09
391	603377	东方时尚	125,500	528,355.00	0.09
392	600011	华能国际	68,300	525,910.00	0.09
393	301156	美农生物	27,700	522,422.00	0.09
394	300394	天孚通信	5,700	521,664.00	0.09
395	000039	中集集团	67,500	516,375.00	0.09
396	688631	莱斯信息	14,500	511,125.00	0.09
397	600809	山西汾酒	2,200	507,606.00	0.09
398	002851	麦格米特	20,500	504,300.00	0.09
399	000019	深粮控股	66,500	501,410.00	0.09
400	688533	上声电子	13,100	499,372.00	0.08
401	600150	中国船舶	16,900	497,536.00	0.08
402	603300	华铁应急	76,904	492,185.60	0.08
403	688053	思科瑞	9,736	486,215.84	0.08
404	688132	邦彦技术	22,510	482,389.30	0.08
405	600757	长江传媒	64,200	478,290.00	0.08
406	603297	永新光学	4,800	476,880.00	0.08
407	000063	中兴通讯	17,800	471,344.00	0.08
408	605333	沪光股份	23,200	461,680.00	0.08
409	300592	华凯易佰	18,400	455,768.00	0.08
410	688652	京仪装备	7,616	455,536.00	0.08
411	300539	横河精密	36,700	455,447.00	0.08
412	688621	阳光诺和	6,400	446,400.00	0.08
413	300033	同花顺	2,800	439,236.00	0.07
414	603239	浙江仙通	28,700	438,249.00	0.07
415	601975	招商南油	155,800	436,240.00	0.07
416	688008	澜起科技	7,400	434,824.00	0.07
417	688472	阿特斯	34,402	434,497.26	0.07
418	300141	和顺电气	41,500	433,260.00	0.07
419	301188	力诺特玻	24,000	429,360.00	0.07

420	300567	精测电子	4,900	429,338.00	0.07
421	000400	许继电气	19,500	428,220.00	0.07
422	000657	中钨高新	50,320	426,713.60	0.07
423	605319	无锡振华	18,500	425,870.00	0.07
424	688356	键凯科技	4,000	425,600.00	0.07
425	000921	海信家电	20,800	424,320.00	0.07
426	601126	四方股份	29,900	423,384.00	0.07
427	002459	晶澳科技	20,400	422,688.00	0.07
428	603806	福斯特	17,300	419,871.00	0.07
429	002123	梦网科技	37,600	419,240.00	0.07
430	688200	华峰测控	3,400	417,520.00	0.07
431	603236	移远通信	7,700	413,875.00	0.07
432	002949	华阳国际	29,500	412,115.00	0.07
433	301061	匠心家居	8,280	411,930.00	0.07
434	605296	神农集团	13,400	411,782.00	0.07
435	600933	爱柯迪	18,700	410,278.00	0.07
436	000708	中信特钢	29,200	409,968.00	0.07
437	002011	盾安环境	29,800	409,750.00	0.07
438	002014	永新股份	49,020	409,317.00	0.07
439	688099	晶晨股份	6,500	407,095.00	0.07
440	688611	杭州柯林	12,300	403,194.00	0.07
441	688433	华曙高科	12,900	403,125.00	0.07
442	002847	盐津铺子	5,800	402,984.00	0.07
443	300818	耐普矿机	12,200	402,722.00	0.07
444	688320	禾川科技	9,800	401,800.00	0.07
445	605016	百龙创园	14,120	400,866.80	0.07
446	300757	罗博特科	4,900	398,811.00	0.07
447	601512	中新集团	51,700	398,607.00	0.07
448	300218	安利股份	29,400	398,370.00	0.07
449	688323	瑞华泰	18,497	397,130.59	0.07
450	301096	百诚医药	6,100	397,110.00	0.07
451	002256	兆新股份	144,800	396,752.00	0.07
452	600036	招商银行	14,200	395,044.00	0.07
453	300502	新易盛	8,000	394,560.00	0.07
454	600872	中炬高新	14,000	393,400.00	0.07
455	688627	精智达	4,400	392,392.00	0.07
456	002777	久远银海	15,600	391,716.00	0.07
457	002215	诺普信	47,200	389,872.00	0.07
458	603009	北特科技	26,100	387,063.00	0.07
459	002156	通富微电	16,700	386,104.00	0.07
460	000651	格力电器	12,000	386,040.00	0.07
461	300158	振东制药	57,000	384,750.00	0.07
461	603606	东方电缆	9,000	384,750.00	0.07

462	002291	遥望科技	41,000	384,580.00	0.07
463	603330	天洋新材	50,700	384,306.00	0.07
464	601028	玉龙股份	35,800	383,418.00	0.07
465	300693	盛弘股份	12,800	382,848.00	0.07
466	300606	金太阳	11,200	382,592.00	0.07
467	601689	拓普集团	5,200	382,200.00	0.07
468	600737	中粮糖业	46,000	379,040.00	0.06
469	688115	思林杰	10,900	377,903.00	0.06
470	688059	华锐精密	4,800	377,808.00	0.06
471	600406	国电南瑞	16,900	377,208.00	0.06
472	002402	和而泰	26,300	375,827.00	0.06
473	603179	新泉股份	7,400	375,254.00	0.06
474	603230	内蒙新华	24,200	375,100.00	0.06
475	002078	太阳纸业	30,800	374,836.00	0.06
476	603195	公牛集团	3,900	373,035.00	0.06
477	688228	开普云	5,700	372,951.00	0.06
478	002151	北斗星通	11,800	372,644.00	0.06
479	600684	珠江股份	107,300	372,331.00	0.06
480	002917	金奥博	37,600	371,112.00	0.06
481	002674	兴业科技	30,400	369,968.00	0.06
482	002544	普天科技	18,200	369,824.00	0.06
483	300928	华安鑫创	7,300	368,212.00	0.06
484	300654	世纪天鸿	32,600	367,728.00	0.06
485	600376	首开股份	120,700	366,928.00	0.06
486	002149	西部材料	23,200	364,704.00	0.06
487	688136	科兴制药	18,000	364,500.00	0.06
488	002208	合肥城建	56,800	364,088.00	0.06
489	002891	中宠股份	13,800	363,630.00	0.06
490	600603	广汇物流	46,700	363,326.00	0.06
491	603558	健盛集团	37,400	362,406.00	0.06
492	002901	大博医疗	8,900	361,251.00	0.06
493	300522	世名科技	26,600	359,100.00	0.06
494	001380	华纬科技	10,300	358,852.00	0.06
495	603059	倍加洁	15,900	358,704.00	0.06
496	688498	源杰科技	2,400	357,552.00	0.06
497	300926	博俊科技	12,100	354,893.00	0.06
498	002154	报喜鸟	62,100	352,728.00	0.06
499	600571	信雅达	25,500	350,625.00	0.06
500	300458	全志科技	15,300	347,157.00	0.06
501	688239	航宇科技	7,200	343,944.00	0.06
502	600699	均胜电子	19,100	343,036.00	0.06
503	002249	大洋电机	69,000	342,930.00	0.06
504	002421	达实智能	106,300	342,286.00	0.06

505	688311	盟升电子	6,700	341,767.00	0.06
506	688380	中微半导	14,300	341,198.00	0.06
507	600285	羚锐制药	19,900	340,489.00	0.06
508	603388	元成股份	37,600	339,904.00	0.06
509	603010	万盛股份	31,400	338,806.00	0.06
510	002727	一心堂	14,600	338,136.00	0.06
511	688595	芯海科技	7,804	337,913.20	0.06
512	002226	江南化工	77,100	337,698.00	0.06
513	688429	时创能源	15,849	335,840.31	0.06
514	600955	维远股份	18,600	333,870.00	0.06
515	002775	文科股份	83,200	332,800.00	0.06
516	300295	三六五网	26,900	331,677.00	0.06
517	002096	易普力	32,000	331,520.00	0.06
518	600309	万华化学	4,300	330,326.00	0.06
519	688018	乐鑫科技	3,137	322,954.15	0.05
520	603890	春秋电子	28,100	321,745.00	0.05
521	688037	芯源微	2,406	321,465.66	0.05
522	300795	米奥会展	8,650	318,925.50	0.05
523	002091	江苏国泰	40,700	318,681.00	0.05
524	603997	继峰股份	23,500	316,545.00	0.05
525	603530	神马电力	15,200	315,248.00	0.05
526	688009	中国通号	71,956	315,167.28	0.05
527	002190	成飞集成	16,600	314,902.00	0.05
528	688668	鼎通科技	5,671	313,719.72	0.05
529	600403	大有能源	82,400	313,120.00	0.05
530	300997	欢乐家	22,400	312,928.00	0.05
531	688383	新益昌	2,969	311,121.51	0.05
532	601921	浙版传媒	40,400	308,656.00	0.05
533	300389	艾比森	17,500	303,450.00	0.05
534	601601	中国太保	12,700	302,006.00	0.05
535	688328	深科达	6,700	300,495.00	0.05
536	603305	旭升集团	15,200	299,896.00	0.05
537	688036	传音控股	2,157	298,528.80	0.05
538	688182	灿勤科技	16,708	297,068.24	0.05
539	603129	春风动力	2,900	296,496.00	0.05
540	688196	卓越新能	8,800	295,416.00	0.05
541	001696	宗申动力	44,500	295,035.00	0.05
542	600579	克劳斯	40,200	291,852.00	0.05
543	688271	联影医疗	2,100	287,721.00	0.05
544	688519	南亚新材	11,100	285,936.00	0.05
545	002353	杰瑞股份	10,100	283,911.00	0.05
546	601665	齐鲁银行	72,300	282,693.00	0.05
547	300122	智飞生物	4,600	281,106.00	0.05

548	688326	经纬恒润	2,400	278,520.00	0.05
549	688603	天承科技	3,700	277,426.00	0.05
550	002046	国机精工	23,700	273,735.00	0.05
551	600066	宇通客车	20,500	271,625.00	0.05
552	300223	北京君正	4,200	271,530.00	0.05
553	600575	淮河能源	111,700	269,197.00	0.05
554	600073	上海梅林	39,500	268,995.00	0.05
555	603885	吉祥航空	22,400	268,800.00	0.05
556	600572	康恩贝	53,200	268,660.00	0.05
557	000901	航天科技	28,800	268,416.00	0.05
558	600019	宝钢股份	45,000	266,850.00	0.05
559	002275	桂林三金	18,400	266,616.00	0.05
560	300323	华灿光电	36,300	265,716.00	0.05
561	603296	华勤技术	3,332	265,483.00	0.05
562	601668	中国建筑	54,900	264,069.00	0.04
563	002646	天佑德酒	18,900	257,229.00	0.04
564	688289	圣湘生物	12,900	252,195.00	0.04
565	002320	海峡股份	42,750	249,232.50	0.04
566	301193	家联科技	14,600	247,908.00	0.04
567	688660	电气风电	47,400	243,636.00	0.04
568	000016	深康佳 A	58,000	241,860.00	0.04
569	301168	通灵股份	5,200	240,032.00	0.04
570	002993	奥海科技	6,300	240,030.00	0.04
571	002239	奥特佳	73,300	238,225.00	0.04
572	600273	嘉化能源	27,700	237,943.00	0.04
573	600711	盛屯矿业	54,700	237,398.00	0.04
574	605222	起帆电缆	12,300	237,144.00	0.04
575	600017	日照港	86,200	237,050.00	0.04
576	601609	金田股份	35,000	236,950.00	0.04
577	000881	中广核技	32,600	236,350.00	0.04
578	300085	银之杰	16,500	236,280.00	0.04
579	300401	花园生物	20,000	236,200.00	0.04
580	600717	天津港	57,400	235,914.00	0.04
581	002838	道恩股份	18,300	234,423.00	0.04
582	600903	贵州燃气	29,500	232,755.00	0.04
583	688001	华兴源创	6,593	230,425.35	0.04
584	002023	海特高新	25,300	230,230.00	0.04
585	002079	苏州固锝	20,400	230,112.00	0.04
586	600110	诺德股份	40,700	229,548.00	0.04
587	601011	宝泰隆	65,200	228,200.00	0.04
588	300517	海波重科	16,100	227,815.00	0.04
589	688166	博瑞医药	6,494	227,290.00	0.04
590	301200	大族数控	6,000	226,620.00	0.04

591	000791	甘肃能源	40,400	225,028.00	0.04
592	002204	大连重工	49,200	224,844.00	0.04
593	688486	龙迅股份	1,887	224,118.99	0.04
594	002626	金达威	13,600	222,088.00	0.04
595	600276	恒瑞医药	4,900	221,627.00	0.04
596	300741	华宝股份	10,300	220,523.00	0.04
597	300352	北信源	46,000	218,500.00	0.04
598	600420	国药现代	22,300	218,317.00	0.04
599	300608	思特奇	12,800	216,960.00	0.04
600	301175	中科环保	43,300	216,067.00	0.04
601	000761	本钢板材	60,400	215,628.00	0.04
602	002183	怡亚通	47,800	214,144.00	0.04
603	605369	拱东医疗	3,800	212,116.00	0.04
604	600217	中再资环	47,300	207,174.00	0.04
605	300792	壹网壹创	8,500	203,745.00	0.03
606	603992	松霖科技	11,200	203,168.00	0.03
607	002971	和远气体	7,300	202,356.00	0.03
608	300129	泰胜风能	18,700	201,399.00	0.03
609	000534	万泽股份	15,300	200,277.00	0.03
610	688590	新致软件	8,800	199,056.00	0.03
611	301360	荣旗科技	2,100	196,560.00	0.03
612	600502	安徽建工	42,100	195,765.00	0.03
613	603255	鼎际得	5,200	193,960.00	0.03
614	002965	祥鑫科技	4,700	193,499.00	0.03
615	603112	华翔股份	15,900	193,185.00	0.03
616	688393	安必平	7,713	192,593.61	0.03
617	300977	深圳瑞捷	10,300	192,507.00	0.03
618	688580	伟思医疗	3,000	191,790.00	0.03
619	603099	长白山	12,800	191,744.00	0.03
620	002009	天奇股份	12,700	191,643.00	0.03
621	002327	富安娜	21,200	189,740.00	0.03
622	301368	丰立智能	4,000	188,560.00	0.03
623	300783	三只松鼠	10,400	187,720.00	0.03
624	600188	兖矿能源	9,400	186,214.00	0.03
625	002933	新兴装备	5,100	185,895.00	0.03
626	601500	通用股份	44,900	185,886.00	0.03
627	688656	浩欧博	5,300	184,228.00	0.03
628	688108	赛诺医疗	14,600	183,230.00	0.03
629	603108	润达医疗	9,000	183,150.00	0.03
630	605388	均瑶健康	14,600	183,084.00	0.03
631	603163	圣晖集成	5,500	182,215.00	0.03
632	301377	鼎泰高科	7,700	182,105.00	0.03
633	603378	亚士创能	20,900	176,814.00	0.03

634	688321	微芯生物	8,000	175,600.00	0.03
635	301220	亚香股份	5,300	175,165.00	0.03
636	300529	健帆生物	7,872	174,994.56	0.03
637	688159	有方科技	4,600	173,190.00	0.03
638	300615	欣天科技	10,800	170,748.00	0.03
639	600812	华北制药	29,600	168,720.00	0.03
640	300662	科锐国际	6,000	165,720.00	0.03
641	300366	创意信息	12,500	164,000.00	0.03
642	605001	威奥股份	21,600	144,504.00	0.02
643	603020	爱普股份	17,100	142,956.00	0.02
644	600548	深高速	15,200	136,648.00	0.02
645	002516	旷达科技	27,000	133,110.00	0.02
646	301210	金杨股份	2,801	127,389.48	0.02
647	603016	新宏泰	5,700	126,483.00	0.02
648	000937	冀中能源	17,700	126,378.00	0.02
649	301357	北方长龙	1,900	95,912.00	0.02
650	600123	兰花科创	8,600	94,944.00	0.02
651	600845	宝信软件	1,900	92,720.00	0.02
652	601006	大秦铁路	12,000	86,520.00	0.01
653	603667	五洲新春	3,300	77,220.00	0.01
654	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
655	601319	中国人保	8,400	40,656.00	0.01
656	688548	广钢气体	2,951	37,625.25	0.01
657	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
658	301358	湖南裕能	993	33,712.35	0.01
659	688549	中巨芯	4,002	32,376.18	0.01
660	688563	航材股份	529	31,999.21	0.01
661	300770	新媒股份	800	30,944.00	0.01
662	301260	格力博	1,600	27,808.00	0.00
663	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
664	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
665	301246	宏源药业	931	24,187.38	0.00
666	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
667	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
668	688702	盛科通信	453	21,825.54	0.00
669	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
670	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
671	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
672	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
673	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
674	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
675	688096	京源环保	1,800	16,866.00	0.00
676	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00

677	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
678	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
679	688612	威迈斯	410	15,567.70	0.00
680	301525	儒竞科技	191	15,558.86	0.00
681	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
682	301371	敷尔佳	403	15,144.74	0.00
683	301559	中集环科	782	14,263.68	0.00
684	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
685	301408	华人健康	879	14,020.05	0.00
686	301439	泓淋电力	949	13,874.38	0.00
687	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
688	301277	新天地	658	13,692.98	0.00
689	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
690	301550	斯菱股份	301	13,229.78	0.00
691	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
692	301419	阿莱德	330	12,243.00	0.00
693	301141	中科磁业	262	12,193.48	0.00
694	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
695	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
696	301281	科源制药	337	11,471.48	0.00
697	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
698	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
699	601083	锦江航运	981	10,859.67	0.00
700	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
701	000557	西部创业	2,200	10,626.00	0.00
702	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
703	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
704	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
705	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
706	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
707	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
708	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
709	301386	未来电器	378	9,612.54	0.00
710	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
711	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
712	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
713	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
714	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
715	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
716	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
717	301203	国泰环保	225	8,748.00	0.00
718	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
719	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00

720	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
721	301373	凌玮科技	277	8,213.05	0.00
722	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
723	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
724	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
725	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
726	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
727	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
728	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
729	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
730	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
731	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
732	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
733	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
734	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
735	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
736	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
737	301157	华塑科技	150	6,420.00	0.00
738	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
739	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
740	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
741	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
742	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
743	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
744	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
745	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
746	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
747	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
748	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
749	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
750	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
751	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
752	301376	致欧科技	26	621.92	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601702	华峰铝业	25,567,755.46	3.13
2	000932	华菱钢铁	25,034,803.25	3.07
3	600309	万华化学	18,001,730.00	2.20
4	603477	巨星农牧	16,034,505.00	1.96
5	002389	航天彩虹	15,858,323.00	1.94

6	300059	东方财富	15,811,692.00	1.94
7	002179	中航光电	15,502,591.00	1.90
8	002517	恺英网络	15,423,642.00	1.89
9	600039	四川路桥	15,389,089.00	1.88
10	601567	三星医疗	15,345,376.00	1.88
11	300034	钢研高纳	15,063,888.64	1.85
12	600886	国投电力	15,053,919.22	1.84
13	601208	东材科技	15,053,016.00	1.84
14	000661	长春高新	14,893,453.00	1.82
15	000921	海信家电	14,615,930.24	1.79
16	300418	昆仑万维	14,494,504.76	1.78
17	601699	潞安环能	12,904,260.00	1.58
18	601318	中国平安	12,881,775.00	1.58
19	600566	济川药业	12,679,481.16	1.55
20	600129	太极集团	12,513,808.55	1.53

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601702	华峰铝业	25,974,023.84	3.18
2	000932	华菱钢铁	21,049,936.64	2.58
3	002179	中航光电	21,045,774.56	2.58
4	600309	万华化学	17,902,403.00	2.19
5	601318	中国平安	17,077,812.00	2.09
6	002389	航天彩虹	16,932,349.40	2.07
7	002517	恺英网络	16,918,154.00	2.07
8	603477	巨星农牧	15,714,116.00	1.92
9	601567	三星医疗	15,402,997.00	1.89
10	601208	东材科技	15,347,895.00	1.88
11	601601	中国太保	15,006,462.00	1.84
12	600886	国投电力	14,776,445.00	1.81
13	600566	济川药业	14,771,055.24	1.81
14	002371	北方华创	14,631,092.30	1.79
15	300015	爱尔眼科	14,513,387.57	1.78
16	300059	东方财富	14,451,020.23	1.77
17	000921	海信家电	14,447,623.00	1.77
18	601628	中国人寿	14,405,332.00	1.76
19	300034	钢研高纳	14,368,061.78	1.76
20	600039	四川路桥	14,239,781.00	1.74

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,776,083,861.01
卖出股票收入（成交）总额	4,977,467,627.10

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。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，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,039,603.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	521,498.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,561,101.43

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
中欧金安量化混合A	5,417	112,353.27	5,434,879.56	0.89%	603,182,790.22	99.11%
中欧金安量化混合C	854	98,864.46	3,047,053.07	3.61%	81,383,195.58	96.39%

合计	6,271	110,516.33	8,481,932.63	1.22%	684,565,985.80	98.78%
----	-------	------------	--------------	-------	----------------	--------

9.2 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	中欧金安量化混合 A	438,139.84	0.07%
	中欧金安量化混合 C	0.00	0.00%
	合计	438,139.84	0.06%

9.3 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	中欧金安量化混合 A	0
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧金安量化混合 A	10~50
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	10~50

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
曲径	公募基金	>100
	私募资产管理计划	-
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 20 日) 基金份额总额	893,269,013.78	139,571,239.72
本报告期期初基金份额总额	800,959,772.88	122,662,978.87
本报告期基金总申购份额	149,938,906.01	22,594,301.46
减：本报告期基金总	342,281,009.11	60,827,031.68

赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	608,617,669.78	84,430,248.65

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 70,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
中国中金财富证券	3	8,301,597,631.37	85.28	4,411,058.52	76.34	-
国金证券	3	1,432,459,973.29	14.72	1,366,924.15	23.66	-

注：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。

11.7.2 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 (%)
中国中金财富证券	-	-	4,092,729,000.00	83.25	-	-
国金证券	-	-	823,398,000.00	16.75	-	-

注：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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧基金安量化混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧基金安量化混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
7	中欧基金安量化混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司关于公司股权	中国证监会指定媒介	2023-06-03

	变更的公告		
9	中欧金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29
10	中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2023-07-08
11	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 7 月）	中国证监会指定媒介	2023-07-08
12	中欧金安量化混合型证券投资基金基金托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2023-07-08
13	中欧金安量化混合型证券投资基金基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2023-07-08
14	中欧金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-07-13
15	中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
16	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
17	中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
18	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
19	中欧金安量化混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
20	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
21	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20
22	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 12 月）	中国证监会指定媒介	2023-12-20

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中欧金安量化混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》

- 3、《中欧金安量化混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧金安量化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

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 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

2024年3月29日