

中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：国金证券股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	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	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	608,476,296.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧金安量化混合 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	529,441,769.09 份	79,034,527.54 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	028-86690232

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	基金管理人的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	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	-14,192,773.01	-2,122,259.78
本期利润	-26,228,425.35	-3,939,928.20
加权平均基金份额 本期利润	-0.0463	-0.0495
本期加权平均净 值利润率	-5.61%	-6.09%
本期基金份额净 值增长率	-5.34%	-5.72%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-103,763,971.55	-16,719,584.91
期末可供分配基	-0.1960	-0.2115

金份额利润		
期末基金资产净值	425,677,797.54	62,314,942.63
期末基金份额净值	0.8040	0.7885
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-19.60%	-21.15%

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
过去一个月	-6.12%	1.05%	-6.30%	0.86%	0.18%	0.19%
过去三个月	-4.73%	1.16%	-5.46%	1.05%	0.73%	0.11%
过去六个月	-5.34%	1.41%	-7.70%	1.48%	2.36%	-0.07%
过去一年	-12.69%	1.14%	-16.10%	1.18%	3.41%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-19.60%	1.11%	-28.36%	1.16%	8.76%	-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

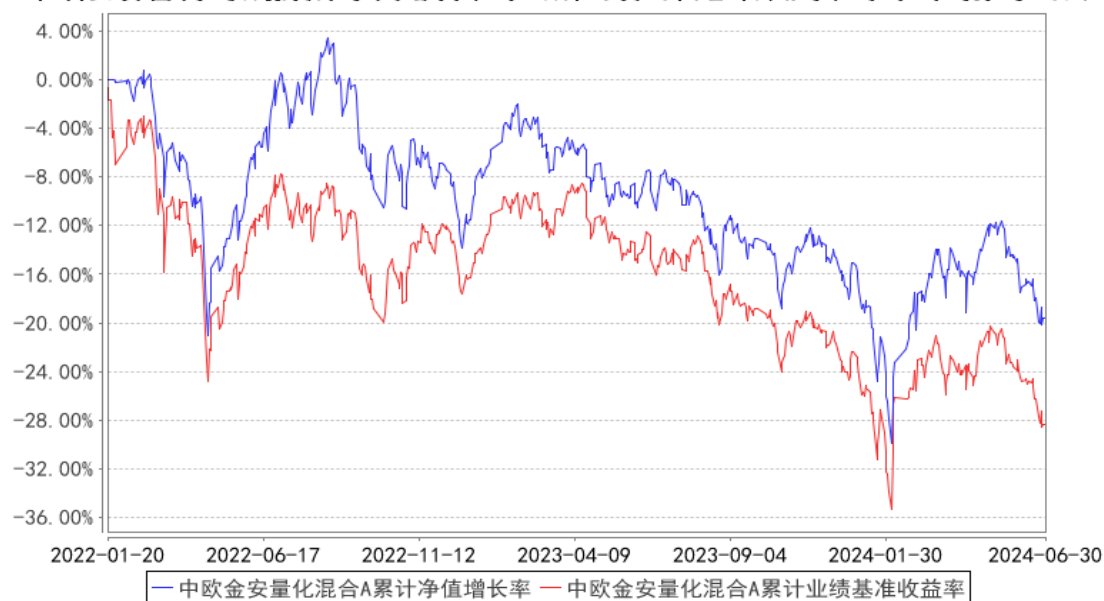
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-6.18%	1.05%	-6.30%	0.86%	0.12%	0.19%
过去三个月	-4.91%	1.16%	-5.46%	1.05%	0.55%	0.11%
过去六个月	-5.72%	1.41%	-7.70%	1.48%	1.98%	-0.07%
过去一年	-13.39%	1.14%	-16.10%	1.18%	2.71%	-0.04%
自基金合同生效起 至今	-21.15%	1.11%	-28.36%	1.16%	7.21%	-0.05%

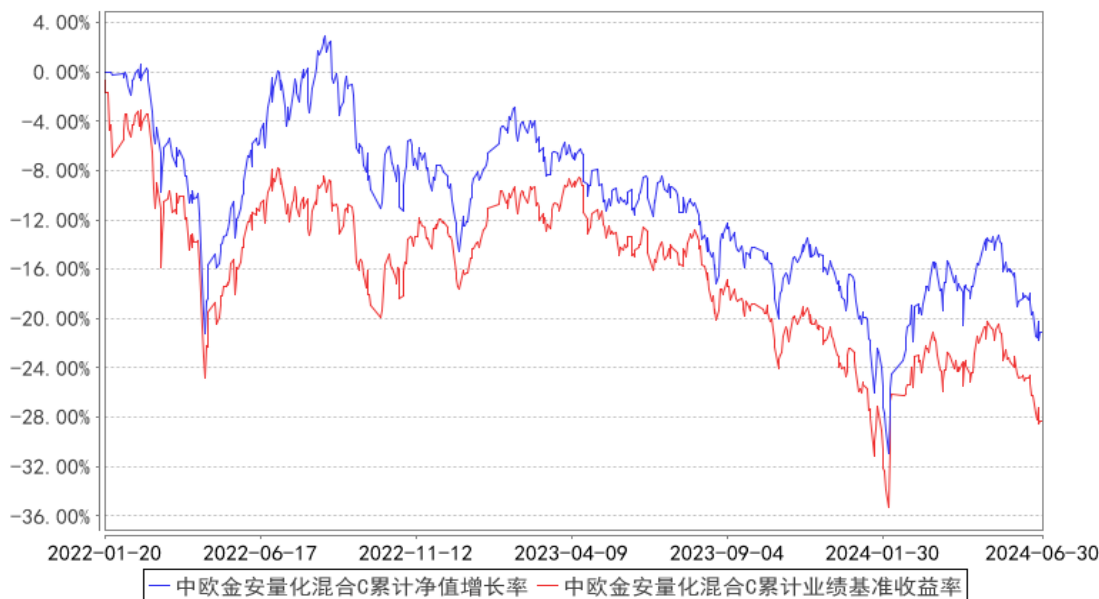
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 175 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	2 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-01-20	-	17 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	7	2,846,471,063.97	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,620,687,948.78	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,467,159,012.75	-

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：2024-05-31；

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 14 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

回顾上半年，A股市场呈现震荡趋势，上证指数于2月初下探至2020年以来的低点，随后在3月至5月有所反弹，但在半年末重新跌破3000点大关。市场整体表现较为疲软，尤其是消费和医药板块下跌较多，年初的微盘股释放风险，发生较大调整，也加剧了市场风险偏好收缩。对比来看，受益于低风险情绪的高股息板块，如银行、公共事业等，具有明显防守属性，受到资金青睐，成为上半年重要“避风港”。同时，出口占比较高的公司，受益于全球通胀和中国制造的优势，在上半年也有相对较好的表现。

从量化角度来看，基本面因子今年持续强势，有显著的超额收益。基本面因子中，表现最突出的是价值因子，其通常包括低市盈率、低市净率、高股息率等特点，倾向于选择估值便宜的股票。在宏观经济结构调整的大背景下，投资者更倾向于投资确定性更高的资产，因此低估值、高股息的价值风格表现相对较好。而传统的交易型量价因子在上半年表现不及预期。量价因子的表现与市场的交易活跃度有密切的关联，市场交易越活跃，量价因子就越有效。随着市场风险偏好下降，叠加对高频交易的逐步规范，市场成交量在上半年逐月下降，全A的成交量在6月底回落到7000亿以下，这也解释了量价因子近期表现较弱，而基本面类因子较强的原因。在报告期内，我们以中证500指数的量化特征作为抓手，保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中大盘的成长风格。操作上，高配部分模型预测的景气行业，在行业内采用基本面因子结合量价因子的多维度综合打分，对个股进行配置，构成基金投资组合，力争获取超越基准的回报。

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-5.34%，同期业绩比较基准收益率为-7.70%；基金C类份额净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为-7.70%。

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，市场仍处于修复期，地产政策放开的力度和影响还需观察。在结构调整，经济驱动力从传统行业向“新质生产力”转型的过程中，必然要经历低增速的一段转型期，市场难有一蹴而就的景气趋势投资机会。然而，我们认为依然有不少结构化的投资机会。其中我们最看好出口链相关的各类企业。海外高通胀环境，叠加二季度库存较低，欧美国家有回补存货的需要，相关公司或将享受较为景气的外部经营环境，受益行业包括部分轻工行业和家用电器；同时由于中国制造的竞争力持续提升，在制造端的低成本和产品端的高竞争力，也为一些企业创造了全球机会，典型行业为整车制造、工程机械、电力设备等。从量化角度来看，我们认为，经过3年的估值去化，很多经营稳健的公司进入了低估值、高分红、高增速的区间，呈现出较好的投资机会，

基本面类因子今年的强势或将持续。

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，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中经托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：中欧金安量化混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	36,093,965.27	50,808,752.85
结算备付金		4,543,705.82	3,489,990.13
存出保证金		814,473.60	1,039,603.20
交易性金融资产	6.4.7.2	448,103,064.86	532,757,281.96
其中：股票投资		448,103,064.86	532,757,281.96
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		5,710.33	521,498.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		489,560,919.88	588,617,126.37
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		844,243.64	236,369.85
应付管理人报酬		498,183.12	603,482.37
应付托管费		83,030.52	100,580.39
应付销售服务费		41,425.38	48,994.99
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	101,297.05	70,043.71
负债合计		1,568,179.71	1,059,471.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	608,476,296.63	693,047,918.43
未分配利润	6.4.7.8	-120,483,556.46	-105,490,263.37
净资产合计		487,992,740.17	587,557,655.06
负债和净资产总计		489,560,919.88	588,617,126.37

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 608,476,296.63 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8040 元，基金份额总额 529,441,769.09 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.7885 元，基金份额总额 79,034,527.54 份。

6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-26,099,771.71	43,544,084.89
1. 利息收入		93,589.72	304,332.56
其中：存款利息收入	6.4.7.9	93,589.72	73,873.97
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		-	230,458.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,402,971.79	8,560,504.87

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-21,216,098.32	1,820,060.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	378,503.24
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,223,902.66	134,279.93
股利收益	6.4.7.14	7,589,223.87	6,227,660.81
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-13,853,320.76	34,095,499.26
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	62,931.12	583,748.20
减：二、营业总支出		4,068,581.84	7,285,284.83
1. 管理人报酬		3,174,105.07	5,970,435.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		529,017.45	796,058.07
3. 销售服务费		256,975.54	409,003.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	367.50
其中：卖出回购金融资产 支出		-	367.50
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,002.12	1,241.68
8. 其他费用	6.4.7.18	103,481.66	108,178.95
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-30,168,353.55	36,258,800.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-30,168,353.55	36,258,800.06
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-30,168,353.55	36,258,800.06

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06
二、本期期初净资产	693,047,918.43	-	-105,490,263.37	587,557,655.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-84,571,621.80	-	-14,993,293.09	-99,564,914.89
(一)、综合收益总额	-	-	-30,168,353.55	-30,168,353.55
(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)	-84,571,621.80	-	15,175,060.46	-69,396,561.34
其中：1. 基金申购款	20,761,057.09	-	-3,572,921.82	17,188,135.27
2. 基金赎回款	-105,332,678.89	-	18,747,982.28	-86,584,696.61
(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	608,476,296.63	-	-120,483,556.46	487,992,740.17
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	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)	-110,061,049.00	-	41,728,761.81	-68,332,287.19
(一)、综合收益总额	-	-	36,258,800.06	36,258,800.06

（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）	-110,061,049.00	-	5,469,961.75	-104,591,087.25
其中：1. 基金申购款	139,606,183.04	-	-8,234,309.23	131,371,873.81
2. 基金赎回款	-249,667,232.04	-	13,704,270.98	-235,962,961.06
（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	813,561,702.75	-	-65,431,718.25	748,129,984.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》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 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的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财

务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,096,267.65
等于：本金	1,095,786.46
加：应计利息	481.19
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	34,997,697.62
等于：本金	34,995,630.80
加：应计利息	2,066.82

减：坏账准备	-
合计	36,093,965.27

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	471,452,053.96	-	448,103,064.86	-23,348,989.10
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	471,452,053.96	-	448,103,064.86	-23,348,989.10

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 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	-
货币衍生 工具	-	-	-	-
权益衍生 工具	7,261,000.00	-	-	-
其中：股 指期货 投资	7,261,000.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	7,261,000.00	-	-	-

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
IC2409	IC2409	5.00	4,875,200.00	-373,880.00

IM2409	IM2409	2.00	1,912,080.00	-99,840.00
合计				-473,720.00
减：可抵销期货暂收款				-473,720.00
净额				0.00

注：1、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。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,184.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-审计费	34,809.32
其他应付	5,630.50
合计	101,297.05

6.4.7.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	608,617,669.78	608,617,669.78

本期申购	11,785,009.43	11,785,009.43
本期赎回（以“-”号填列）	-90,960,910.12	-90,960,910.12
本期末	529,441,769.09	529,441,769.09

中欧金安量化混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,430,248.65	84,430,248.65
本期申购	8,976,047.66	8,976,047.66
本期赎回（以“-”号填列）	-14,371,768.77	-14,371,768.77
本期末	79,034,527.54	79,034,527.54

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-80,095,178.79	-11,571,183.17	-91,666,361.96
本期期初	-80,095,178.79	-11,571,183.17	-91,666,361.96
本期利润	-14,192,773.01	-12,035,652.34	-26,228,425.35
本期基金份额交易产生的变动数	13,749,783.16	381,032.60	14,130,815.76
其中：基金申购款	-1,996,431.86	-757.12	-1,997,188.98
基金赎回款	15,746,215.02	381,789.72	16,128,004.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,538,168.64	-23,225,802.91	-103,763,971.55

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	-12,231,372.14	-1,592,529.27	-13,823,901.41
本期期初	-12,231,372.14	-1,592,529.27	-13,823,901.41
本期利润	-2,122,259.78	-1,817,668.42	-3,939,928.20
本期基金份额交易产生的变动数	1,046,641.30	-2,396.60	1,044,244.70
其中：基金申购款	-1,573,469.03	-2,263.81	-1,575,732.84
基金赎回款	2,620,110.33	-132.79	2,619,977.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,306,990.62	-3,412,594.29	-16,719,584.91

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	
定期存款利息收入		-

其他存款利息收入	43,298.14
结算备付金利息收入	37,719.16
其他	-
合计	93,589.72

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,967,286,606.05
减：卖出股票成本总额	2,983,332,580.09
减：交易费用	5,170,124.28
买卖股票差价收入	-21,216,098.32

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	1,223,902.66

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,589,223.87
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	7,589,223.87
----	--------------

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-13,378,600.76
股票投资	-13,378,600.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-474,720.00
权证投资	-
期货投资	-474,720.00
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	-13,853,320.76

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	62,349.13
基金转换费收入	581.99
合计	62,931.12

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	103,481.66

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

中欧基金管理有限公司已于 2024 年 4 月 9 日正式受让中欧私募基金管理（上海）有限公司全部股权，中欧私募基金管理（上海）有限公司已变更为中欧基金管理有限公司全资子公司。

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
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	211,363,983.58	3.60	927,461,633.36	18.29

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	-	427,398,000.00	17.99

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 2024年1月1日至2024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 (%)
国金证券	402,189.88	12.15	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
国金证券	736,686.27	24.71	-	-

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。

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,174,105.07
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,230,009.74	2,289,760.08
应支付基金管理人的净管理费	1,944,095.33	3,680,675.09

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	529,017.45	796,058.07

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。

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	0.00	25,225.43	25,225.43
中欧财富	0.00	1,870.67	1,870.67
合计	0.00	27,096.10	27,096.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	0.00	60,303.63	60,303.63
中欧财富	0.00	2,973.99	2,973.99
合计	0.00	63,277.62	63,277.62

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金各类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧金安量化混合 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	0.08%	438,079.85	0.07%

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各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度可比期期末，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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国金证券股份有限公司	3,218,078.63	19,700.16	17,890,202.26	29,907.14

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。

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（2024 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成	2024 年 5 月	6 个月	新股流通	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

	真空	月 28 日		受限						
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	40.09	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	70.48	188.01	1,208	85,143.19	227,116.08	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴	2024 年 1	6 个月	新股流通	16.20	15.96	762	12,344.40	12,161.52	-

	股份	月 11 日		受限						
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	270	7,020.00	10,122.30	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	776	17,584.16	12,330.64	-
688691	灿芯	2024 年 4 月	6 个月	新股流通	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

	股份	月 2 日		受限						
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	969	15,203.61	18,207.51	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例

要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	36,093,965.27	-	-	-	36,093,965.27
结算备付金	4,543,705.82	-	-	-	4,543,705.82
存出保证金	-	-	-	814,473.60	814,473.60
交易性金融资产	-	-	-	-448,103,064.86	448,103,064.86
应收申购款	-	-	-	5,710.33	5,710.33
资产总计	40,637,671.09	-	-	-448,923,248.79	489,560,919.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	844,243.64	844,243.64
应付管理人报酬	-	-	-	498,183.12	498,183.12
应付托管费	-	-	-	83,030.52	83,030.52
应付销售服务费	-	-	-	41,425.38	41,425.38
其他负债	-	-	-	101,297.05	101,297.05
负债总计	-	-	-	1,568,179.71	1,568,179.71
利率敏感度缺口	40,637,671.09	-	-	-447,355,069.08	487,992,740.17
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2023 年 12 月 31 日：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（2023 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	448,103,064.86	91.83	532,757,281.96	90.67
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	448,103,064.86	91.83	532,757,281.96	90.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	21,420,302.19	27,677,292.49
	业绩比较基准下降	-21,420,302.19	-27,677,292.49

	5%		
--	----	--	--

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	447,618,792.87	531,247,017.74
第二层次	24,002.55	426,713.60
第三层次	460,269.44	1,083,550.62
合计	448,103,064.86	532,757,281.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 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	448,103,064.86	91.53
	其中：股票	448,103,064.86	91.53
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	40,637,671.09	8.30
8	其他各项资产	820,183.93	0.17
9	合计	489,560,919.88	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	3,731,911.00	0.76
B	采矿业	17,695,750.00	3.63
C	制造业	317,828,671.54	65.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,784,460.50	3.23
E	建筑业	9,883,310.75	2.03
F	批发和零售业	14,456,650.30	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	5,093,522.00	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	25,173,524.29	5.16

业			
J	金融业	20,136,017.00	4.13
K	房地产业	2,953,767.00	0.61
L	租赁和商务服务业	2,147,310.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	2,563,322.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	3,322,291.48	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	924,854.00	0.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,559,885.00	1.14
S	综合	847,818.00	0.17
	合计	448,103,064.86	91.83

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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300413	芒果超媒	167,000	3,490,300.00	0.72
2	600970	中材国际	251,100	3,028,266.00	0.62
3	601636	旗滨集团	449,900	2,901,855.00	0.59
4	002601	龙佰集团	142,500	2,646,225.00	0.54
5	600694	大商股份	140,660	2,364,494.60	0.48
6	600066	宇通客车	90,600	2,337,480.00	0.48
7	600038	中直股份	56,500	2,322,715.00	0.48
8	600435	北方导航	267,400	2,304,988.00	0.47
9	000423	东阿阿胶	36,200	2,266,120.00	0.46
10	000883	湖北能源	360,600	2,167,206.00	0.44
11	605166	聚合顺	204,000	2,139,960.00	0.44
12	300251	光线传媒	250,800	2,109,228.00	0.43
13	002273	水晶光电	122,100	2,073,258.00	0.42
14	601601	中国太保	72,000	2,005,920.00	0.41
15	600489	中金黄金	132,000	1,953,600.00	0.40
16	688408	中信博	20,965	1,930,457.20	0.40
17	601137	博威合金	125,000	1,905,000.00	0.39
18	601899	紫金矿业	107,100	1,881,747.00	0.39
19	603198	迎驾贡酒	32,100	1,845,750.00	0.38
20	300973	立高食品	65,300	1,834,277.00	0.38
21	600801	华新水泥	132,800	1,826,000.00	0.37
22	603228	景旺电子	56,700	1,803,060.00	0.37
23	002371	北方华创	5,600	1,791,384.00	0.37
24	000729	燕京啤酒	200,900	1,773,947.00	0.36

25	000975	山金国际	108,700	1,770,723.00	0.36
26	000550	江铃汽车	80,800	1,754,168.00	0.36
27	002697	红旗连锁	371,600	1,720,508.00	0.35
28	300636	同和药业	165,000	1,678,050.00	0.34
29	688120	华海清科	8,849	1,677,593.42	0.34
30	002267	陕天然气	219,300	1,657,908.00	0.34
31	600938	中国海油	50,000	1,650,000.00	0.34
32	600761	安徽合力	75,200	1,627,328.00	0.33
33	600547	山东黄金	58,300	1,596,254.00	0.33
34	300783	三只松鼠	72,100	1,576,827.00	0.32
35	301299	卓创资讯	36,900	1,549,800.00	0.32
36	688188	柏楚电子	8,230	1,518,846.50	0.31
37	603995	甬金股份	85,200	1,492,704.00	0.31
38	688516	奥特维	35,560	1,486,763.60	0.30
39	003000	劲仔食品	121,000	1,458,050.00	0.30
40	600809	山西汾酒	6,900	1,455,072.00	0.30
41	002533	金杯电工	145,800	1,450,710.00	0.30
42	002961	瑞达期货	128,300	1,404,885.00	0.29
43	000651	格力电器	35,200	1,380,544.00	0.28
44	688480	赛恩斯	49,296	1,373,386.56	0.28
45	688150	莱特光电	68,916	1,336,970.40	0.27
46	300857	协创数据	23,100	1,316,700.00	0.27
47	603610	麒盛科技	133,100	1,315,028.00	0.27
48	601500	通用股份	245,700	1,312,038.00	0.27
49	002519	银河电子	267,200	1,311,952.00	0.27
50	688289	圣湘生物	74,611	1,311,661.38	0.27
51	600642	申能股份	146,500	1,293,595.00	0.27
52	603379	三美股份	33,000	1,291,620.00	0.26
53	601369	陕鼓动力	161,000	1,291,220.00	0.26
54	002111	威海广泰	123,800	1,289,996.00	0.26
55	002001	新和成	67,100	1,288,320.00	0.26
56	688208	道通科技	53,300	1,286,662.00	0.26
57	301077	星华新材	71,000	1,268,060.00	0.26
58	601919	中远海控	81,700	1,265,533.00	0.26
59	002245	蔚蓝锂芯	163,000	1,263,250.00	0.26
60	603897	长城科技	71,800	1,260,090.00	0.26
61	003031	中瓷电子	26,980	1,247,555.20	0.26
62	603629	利通电子	67,400	1,244,204.00	0.25
63	300628	亿联网络	33,800	1,242,826.00	0.25
64	603579	荣泰健康	80,350	1,242,211.00	0.25
65	603806	福斯特	83,920	1,233,624.00	0.25
66	002532	天山铝业	150,800	1,222,988.00	0.25
67	300100	双林股份	113,100	1,218,087.00	0.25

68	300881	盛德鑫泰	47,400	1,217,706.00	0.25
69	688510	航亚科技	66,055	1,216,072.55	0.25
70	000830	鲁西化工	104,400	1,209,996.00	0.25
71	001206	依依股份	92,900	1,209,558.00	0.25
72	601318	中国平安	29,200	1,207,712.00	0.25
73	605488	福莱新材	92,400	1,201,200.00	0.25
74	600916	中国黄金	124,504	1,197,728.48	0.25
75	300458	全志科技	50,700	1,191,957.00	0.24
76	300790	宇瞳光学	88,000	1,188,000.00	0.24
77	688330	宏力达	57,800	1,178,542.00	0.24
78	600820	隧道股份	178,900	1,168,217.00	0.24
79	002969	嘉美包装	408,900	1,165,365.00	0.24
80	000928	中钢国际	209,500	1,162,725.00	0.24
81	300708	聚灿光电	128,600	1,157,400.00	0.24
82	600529	山东药玻	45,400	1,150,436.00	0.24
83	002582	好想你	213,100	1,144,347.00	0.23
84	300638	广和通	66,800	1,142,280.00	0.23
85	603040	新坐标	57,300	1,141,989.00	0.23
86	600298	安琪酵母	40,700	1,136,751.00	0.23
87	601633	长城汽车	44,900	1,135,970.00	0.23
88	603617	君禾股份	190,900	1,126,310.00	0.23
89	603589	口子窖	28,500	1,116,915.00	0.23
90	301000	肇民科技	76,580	1,098,923.00	0.23
91	605333	沪光股份	39,400	1,097,290.00	0.22
92	002215	诺普信	146,800	1,093,660.00	0.22
93	002972	科安达	119,240	1,092,238.40	0.22
94	300724	捷佳伟创	20,200	1,091,002.00	0.22
95	603239	浙江仙通	79,500	1,089,945.00	0.22
96	000690	宝新能源	213,300	1,087,830.00	0.22
97	605555	德昌股份	58,400	1,086,824.00	0.22
98	300303	聚飞光电	223,500	1,086,210.00	0.22
99	002897	意华股份	28,700	1,080,842.00	0.22
100	600598	北大荒	86,200	1,076,638.00	0.22
101	000596	古井贡酒	5,100	1,076,457.00	0.22
102	600150	中国船舶	26,400	1,074,744.00	0.22
103	601668	中国建筑	201,400	1,069,434.00	0.22
104	301206	三元生物	43,400	1,066,772.00	0.22
105	002467	二六三	319,000	1,065,460.00	0.22
106	002422	科伦药业	35,100	1,064,583.00	0.22
107	605116	奥锐特	42,400	1,061,272.00	0.22
108	603727	博迈科	80,500	1,059,380.00	0.22
109	601857	中国石油	102,400	1,056,768.00	0.22
110	001979	招商蛇口	120,200	1,056,558.00	0.22

111	603706	东方环宇	72,100	1,056,265.00	0.22
112	601311	骆驼股份	131,500	1,054,630.00	0.22
113	002847	盐津铺子	24,600	1,052,142.00	0.22
114	600733	北汽蓝谷	130,100	1,051,208.00	0.22
115	688036	传音控股	13,700	1,048,598.00	0.21
116	002140	东华科技	135,081	1,046,877.75	0.21
117	600482	中国动力	53,500	1,042,180.00	0.21
118	002106	莱宝高科	95,300	1,038,770.00	0.21
119	688162	巨一科技	53,306	1,038,400.88	0.21
120	601728	中国电信	168,800	1,038,120.00	0.21
121	300915	海融科技	39,700	1,037,758.00	0.21
122	688486	龙迅股份	18,104	1,037,359.20	0.21
123	605117	德业股份	13,900	1,033,326.00	0.21
124	600989	宝丰能源	59,600	1,032,868.00	0.21
125	601009	南京银行	99,400	1,032,766.00	0.21
126	300181	佐力药业	68,100	1,029,672.00	0.21
127	600483	福能股份	88,200	1,028,412.00	0.21
128	600160	巨化股份	42,500	1,025,525.00	0.21
129	600048	保利发展	117,000	1,024,920.00	0.21
130	301193	家联科技	64,160	1,023,993.60	0.21
131	601328	交通银行	137,000	1,023,390.00	0.21
132	600814	杭州解百	173,300	1,022,470.00	0.21
133	300396	迪瑞医疗	50,300	1,021,593.00	0.21
134	601168	西部矿业	56,900	1,021,355.00	0.21
135	000768	中航西飞	42,500	1,021,275.00	0.21
136	600031	三一重工	61,700	1,018,050.00	0.21
137	601288	农业银行	233,000	1,015,880.00	0.21
138	603568	伟明环保	49,330	1,015,211.40	0.21
139	601169	北京银行	173,600	1,013,824.00	0.21
140	603883	老百姓	55,180	1,013,104.80	0.21
141	002179	中航光电	26,600	1,012,130.00	0.21
142	600536	中国软件	33,800	1,011,296.00	0.21
143	000544	中原环保	128,500	1,011,295.00	0.21
144	601398	工商银行	177,100	1,009,470.00	0.21
145	601939	建设银行	136,400	1,009,360.00	0.21
146	600900	长江电力	34,900	1,009,308.00	0.21
147	300853	申昊科技	69,400	1,009,076.00	0.21
148	600919	江苏银行	135,800	1,008,994.00	0.21
149	603225	新凤鸣	64,700	1,008,673.00	0.21
150	605090	九丰能源	34,700	1,006,300.00	0.21
151	001389	广合科技	22,522	1,006,043.32	0.21
152	300566	激智科技	71,900	1,005,881.00	0.21
153	301071	力量钻石	36,287	1,005,512.77	0.21

154	300673	佩蒂股份	76,500	1,003,680.00	0.21
155	301123	奕东电子	55,900	1,003,405.00	0.21
156	600132	重庆啤酒	16,500	1,001,550.00	0.21
157	002594	比亚迪	4,000	1,001,000.00	0.21
158	600866	星湖科技	181,300	1,000,776.00	0.21
159	000930	中粮科技	198,900	1,000,467.00	0.21
160	688981	中芯国际	21,700	1,000,370.00	0.20
161	000719	中原传媒	98,900	999,879.00	0.20
162	300373	扬杰科技	25,700	999,730.00	0.20
163	600486	扬农化工	17,700	999,165.00	0.20
164	600000	浦发银行	121,400	999,122.00	0.20
165	300729	乐歌股份	64,500	999,105.00	0.20
166	002432	九安医疗	24,600	997,284.00	0.20
167	603321	梅轮电梯	145,800	995,814.00	0.20
168	002155	湖南黄金	55,000	995,500.00	0.20
169	000425	徐工机械	139,200	995,280.00	0.20
170	300003	乐普医疗	67,000	994,280.00	0.20
171	605499	东鹏饮料	4,600	992,450.00	0.20
172	603296	华勤技术	17,960	991,930.80	0.20
173	002023	海特高新	108,400	991,860.00	0.20
174	000529	广弘控股	168,600	991,368.00	0.20
175	301327	华宝新能	17,300	991,290.00	0.20
176	002048	宁波华翔	76,600	991,204.00	0.20
177	688180	君实生物	34,079	989,994.95	0.20
178	603809	豪能股份	122,484	989,670.72	0.20
179	000700	模塑科技	188,300	988,575.00	0.20
180	600426	华鲁恒升	37,100	988,344.00	0.20
181	002230	科大讯飞	23,000	987,850.00	0.20
182	600161	天坛生物	40,480	987,712.00	0.20
183	002558	巨人网络	104,600	987,424.00	0.20
184	000519	中兵红箭	67,300	987,291.00	0.20
185	688698	伟创电气	36,600	987,102.00	0.20
186	603368	柳药集团	56,400	987,000.00	0.20
187	600176	中国巨石	89,300	986,765.00	0.20
188	002556	辉隆股份	236,600	986,622.00	0.20
189	300418	昆仑万维	30,600	986,544.00	0.20
190	600096	云天化	50,800	986,536.00	0.20
191	000951	中国重汽	68,800	985,216.00	0.20
192	605183	确成股份	63,700	984,802.00	0.20
193	002064	华峰化学	137,300	984,441.00	0.20
194	300193	佳士科技	132,600	983,892.00	0.20
195	002487	大金重工	43,000	983,840.00	0.20
196	600521	华海药业	57,670	983,273.50	0.20

197	603538	美诺华	88,000	982,960.00	0.20
198	300841	康华生物	19,400	982,416.00	0.20
199	601336	新华保险	32,700	981,981.00	0.20
200	688575	亚辉龙	42,100	981,772.00	0.20
201	300285	国瓷材料	55,000	981,750.00	0.20
202	002142	宁波银行	44,500	981,670.00	0.20
203	300124	汇川技术	19,100	979,830.00	0.20
204	002755	奥赛康	101,500	979,475.00	0.20
205	000895	双汇发展	41,200	979,324.00	0.20
206	300693	盛弘股份	46,700	977,898.00	0.20
207	603055	台华新材	96,500	977,545.00	0.20
208	603087	甘李药业	21,100	977,352.00	0.20
209	300702	天宇股份	54,700	975,301.00	0.20
210	601595	上海电影	49,300	975,154.00	0.20
211	603229	奥翔药业	96,800	972,840.00	0.20
212	601688	华泰证券	78,500	972,615.00	0.20
213	002790	瑞尔特	107,700	972,531.00	0.20
214	600879	航天电子	125,100	972,027.00	0.20
215	600125	铁龙物流	162,700	971,319.00	0.20
216	002237	恒邦股份	84,300	970,293.00	0.20
217	301033	迈普医学	24,800	969,928.00	0.20
218	601888	中国中免	15,500	968,595.00	0.20
219	002452	长高电新	116,900	967,932.00	0.20
220	601882	海天精工	42,200	966,802.00	0.20
221	603583	捷昌驱动	47,400	966,012.00	0.20
222	002752	昇兴股份	190,900	965,954.00	0.20
223	300357	我武生物	47,700	964,494.00	0.20
224	603899	晨光股份	30,800	963,424.00	0.20
225	603160	汇顶科技	14,000	962,500.00	0.20
226	002850	科达利	12,600	962,388.00	0.20
227	000568	泸州老窖	6,700	961,383.00	0.20
228	601881	中国银河	88,300	958,938.00	0.20
229	002271	东方雨虹	77,700	958,818.00	0.20
230	603355	莱克电气	44,300	956,880.00	0.20
231	000538	云南白药	18,700	956,505.00	0.20
232	600309	万华化学	11,800	954,148.00	0.20
233	688278	特宝生物	17,800	953,190.00	0.20
234	600764	中国海防	48,300	948,129.00	0.19
235	300529	健帆生物	34,700	944,187.00	0.19
236	300758	七彩化学	87,800	943,850.00	0.19
237	300979	华利集团	15,500	943,175.00	0.19
238	688533	上声电子	36,450	942,961.50	0.19
239	600371	万向德农	136,200	942,504.00	0.19

240	603893	瑞芯微	15,900	940,803.00	0.19
241	300950	德固特	61,600	938,784.00	0.19
242	600499	科达制造	111,200	937,416.00	0.19
243	002550	千红制药	172,900	931,931.00	0.19
244	600021	上海电力	94,000	929,660.00	0.19
245	603699	纽威股份	54,140	926,876.80	0.19
246	001207	联科科技	63,800	926,376.00	0.19
247	605098	行动教育	21,700	924,854.00	0.19
248	688331	荣昌生物	21,400	924,480.00	0.19
249	000682	东方电子	83,700	924,048.00	0.19
250	601608	中信重工	242,366	923,414.46	0.19
251	688028	沃尔德	56,200	923,366.00	0.19
252	000725	京东方 A	225,400	921,886.00	0.19
253	601700	风范股份	209,700	920,583.00	0.19
254	300842	帝科股份	23,720	920,336.00	0.19
255	603788	宁波高发	74,900	919,772.00	0.19
256	300105	龙源技术	142,100	917,966.00	0.19
257	688253	英诺特	24,059	916,888.49	0.19
258	600389	江山股份	64,700	912,917.00	0.19
259	688676	金盘科技	17,500	912,625.00	0.19
260	002282	博深股份	142,800	912,492.00	0.19
261	600362	江西铜业	38,500	911,680.00	0.19
262	600873	梅花生物	90,900	910,818.00	0.19
263	002757	南兴股份	75,400	908,570.00	0.19
264	688127	蓝特光学	49,400	908,466.00	0.19
265	301219	腾远钴业	23,700	906,762.00	0.19
266	600546	山煤国际	61,700	902,054.00	0.18
267	300384	三联虹普	68,700	901,344.00	0.18
268	002980	华盛昌	40,800	893,112.00	0.18
269	301061	匠心家居	19,000	892,240.00	0.18
270	301015	百洋医药	37,900	891,787.00	0.18
271	688349	三一重能	35,900	891,756.00	0.18
272	688728	格科微	73,500	890,085.00	0.18
273	600346	恒力石化	63,800	890,010.00	0.18
274	002979	雷赛智能	48,800	888,160.00	0.18
275	002643	万润股份	88,800	888,000.00	0.18
276	300945	曼卡龙	99,600	887,436.00	0.18
277	688313	仕佳光子	92,900	884,408.00	0.18
278	002254	泰和新材	99,800	883,230.00	0.18
279	688235	百济神州	7,588	878,993.92	0.18
280	000933	神火股份	43,400	877,982.00	0.18
281	300596	利安隆	32,200	873,586.00	0.18
282	605305	中际联合	33,826	872,372.54	0.18

283	002968	新大正	97,900	872,289.00	0.18
284	002182	宝武镁业	77,300	871,944.00	0.18
285	002345	潮宏基	184,700	871,784.00	0.18
286	002053	云南能投	72,100	871,689.00	0.18
287	600559	老白干酒	47,800	869,004.00	0.18
288	600566	济川药业	27,300	865,683.00	0.18
289	000598	兴蓉环境	115,000	864,800.00	0.18
290	000400	许继电气	25,129	864,688.89	0.18
291	601865	福莱特	42,900	862,290.00	0.18
292	002249	大洋电机	182,100	861,333.00	0.18
293	600794	保税科技	271,600	860,972.00	0.18
294	300349	金卡智能	72,200	860,624.00	0.18
295	000543	皖能电力	97,102	859,352.70	0.18
296	301358	湖南裕能	27,300	858,858.00	0.18
297	600865	百大集团	132,600	857,922.00	0.18
298	002299	圣农发展	62,800	856,592.00	0.18
299	600975	新五丰	121,100	856,177.00	0.18
300	603909	建发合诚	102,900	856,128.00	0.18
301	300791	仙乐健康	33,960	855,792.00	0.18
302	688016	心脉医疗	8,700	853,035.00	0.17
303	688662	富信科技	34,936	852,438.40	0.17
304	300170	汉得信息	138,700	851,618.00	0.17
305	301056	森赫股份	110,900	850,603.00	0.17
306	000532	华金资本	70,300	847,818.00	0.17
307	601628	中国人寿	27,200	844,560.00	0.17
308	301280	珠城科技	21,700	841,960.00	0.17
309	301160	翔楼新材	22,600	841,850.00	0.17
310	600755	厦门国贸	117,300	841,041.00	0.17
311	002534	西子洁能	83,900	839,839.00	0.17
312	603026	石大胜华	24,800	838,240.00	0.17
313	002381	双箭股份	124,200	833,382.00	0.17
314	603088	宁波精达	110,600	832,818.00	0.17
315	601886	江河集团	170,400	831,552.00	0.17
316	300771	智莱科技	94,600	831,534.00	0.17
317	603408	建霖家居	63,000	830,970.00	0.17
318	000703	恒逸石化	117,000	829,530.00	0.17
319	603039	泛微网络	26,100	828,936.00	0.17
320	600729	重庆百货	37,000	827,320.00	0.17
321	605018	长华集团	91,300	827,178.00	0.17
322	688571	杭华股份	156,200	826,298.00	0.17
323	000921	海信家电	25,600	825,344.00	0.17
324	300002	神州泰岳	101,500	824,180.00	0.17
325	688551	科威尔	26,000	819,000.00	0.17

326	603309	维力医疗	74,200	816,942.00	0.17
327	301109	军信股份	54,400	813,280.00	0.17
328	002116	中国海诚	87,300	812,763.00	0.17
329	603993	洛阳钼业	95,400	810,900.00	0.17
330	002152	广电运通	77,400	809,604.00	0.17
331	688222	成都先导	71,000	805,850.00	0.17
332	605111	新洁能	26,340	805,740.60	0.17
333	605389	长龄液压	38,360	805,176.40	0.16
334	002991	甘源食品	13,200	800,580.00	0.16
335	603167	渤海轮渡	97,900	799,843.00	0.16
336	600315	上海家化	44,600	792,988.00	0.16
337	603486	科沃斯	16,800	792,624.00	0.16
338	603798	康普顿	93,900	790,638.00	0.16
339	605368	蓝天燃气	57,920	790,028.80	0.16
340	002322	理工能科	49,300	789,786.00	0.16
341	688685	迈信林	32,300	789,735.00	0.16
342	300532	今天国际	64,200	789,018.00	0.16
343	603983	丸美股份	28,300	779,099.00	0.16
344	603976	正川股份	55,200	778,872.00	0.16
345	003025	思进智能	63,200	777,992.00	0.16
346	600282	南钢股份	155,400	773,892.00	0.16
347	601101	昊华能源	83,900	771,041.00	0.16
348	601800	中国交建	85,400	763,476.00	0.16
349	688663	新风光	32,800	763,256.00	0.16
350	603367	辰欣药业	54,700	762,518.00	0.16
351	000030	富奥股份	155,100	761,541.00	0.16
352	002296	辉煌科技	73,500	757,785.00	0.16
353	600582	天地科技	109,900	757,211.00	0.16
354	688606	奥泰生物	16,000	754,080.00	0.15
355	600378	昊华科技	26,000	751,400.00	0.15
356	300482	万孚生物	30,700	749,080.00	0.15
357	002423	中粮资本	100,000	749,000.00	0.15
358	603277	银都股份	24,900	747,996.00	0.15
359	603096	新经典	44,200	746,980.00	0.15
360	002774	快意电梯	117,500	746,125.00	0.15
361	300207	欣旺达	49,000	743,330.00	0.15
362	002906	华阳集团	27,700	741,252.00	0.15
363	601088	中国神华	16,600	736,542.00	0.15
364	300016	北陆药业	166,400	733,824.00	0.15
365	300837	浙矿股份	35,300	732,828.00	0.15
366	605007	五洲特纸	58,000	732,540.00	0.15
367	601566	九牧王	86,600	729,172.00	0.15
368	605378	野马电池	47,260	728,749.20	0.15

369	600373	中文传媒	49,100	728,644.00	0.15
370	301003	江苏博云	33,700	724,887.00	0.15
371	688255	凯尔达	36,100	723,805.00	0.15
372	603399	永杉锂业	116,500	721,135.00	0.15
373	600557	康缘药业	45,900	720,630.00	0.15
374	601963	重庆银行	92,800	719,200.00	0.15
375	002833	弘亚数控	39,200	715,008.00	0.15
376	000786	北新建材	24,100	714,806.00	0.15
377	688002	睿创微纳	25,500	713,235.00	0.15
378	688275	万润新能	24,200	711,964.00	0.15
379	002228	合兴包装	303,000	709,020.00	0.15
380	300034	钢研高纳	44,600	708,694.00	0.15
381	002093	国脉科技	116,200	705,334.00	0.14
382	002392	北京利尔	223,700	704,655.00	0.14
383	300916	朗特智能	27,900	702,522.00	0.14
384	603020	爱普股份	104,600	697,682.00	0.14
385	300589	江龙船艇	58,700	697,356.00	0.14
386	603051	鹿山新材	31,700	692,011.00	0.14
387	600660	福耀玻璃	14,400	689,760.00	0.14
388	601966	玲珑轮胎	37,400	687,038.00	0.14
389	000893	亚钾国际	42,400	685,184.00	0.14
390	300981	中红医疗	71,500	684,255.00	0.14
391	001331	胜通能源	49,400	684,190.00	0.14
392	002835	同为股份	40,500	684,045.00	0.14
393	301187	欧圣电气	28,200	683,850.00	0.14
394	000708	中信特钢	50,100	679,857.00	0.14
395	003019	宸展光电	26,370	667,952.10	0.14
396	000683	远兴能源	96,300	665,433.00	0.14
397	600332	白云山	22,500	659,925.00	0.14
398	000923	河钢资源	38,300	659,526.00	0.14
399	688767	博拓生物	26,300	659,341.00	0.14
400	300818	耐普矿机	25,580	652,290.00	0.13
401	600760	中航沈飞	16,100	645,610.00	0.13
402	000528	柳工	57,200	640,068.00	0.13
403	000157	中联重科	83,200	638,976.00	0.13
404	001368	通达创智	32,600	637,330.00	0.13
405	603786	科博达	9,800	628,670.00	0.13
406	301345	涛涛车业	11,400	628,140.00	0.13
407	000960	锡业股份	40,100	621,149.00	0.13
408	601969	海南矿业	97,800	620,052.00	0.13
409	600787	中储股份	127,200	611,832.00	0.13
410	002340	格林美	95,300	607,061.00	0.12
411	600141	兴发集团	31,700	604,836.00	0.12

412	601198	东兴证券	75,900	604,164.00	0.12
413	002879	长缆科技	45,900	602,667.00	0.12
414	300383	光环新网	70,800	598,260.00	0.12
415	603980	吉华集团	159,500	596,530.00	0.12
416	002046	国机精工	58,600	595,962.00	0.12
417	600999	招商证券	42,600	592,566.00	0.12
418	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.12
419	688089	嘉必优	43,632	577,687.68	0.12
420	300249	依米康	87,900	569,592.00	0.12
421	603871	嘉友国际	31,700	560,773.00	0.11
422	688566	吉贝尔	24,886	559,935.00	0.11
423	688088	虹软科技	19,000	548,340.00	0.11
424	002970	锐明技术	15,200	547,656.00	0.11
425	688484	南芯科技	14,700	545,370.00	0.11
426	002922	伊戈尔	24,900	544,314.00	0.11
427	000913	钱江摩托	34,400	542,144.00	0.11
428	002984	森麒麟	22,300	537,207.00	0.11
429	001338	永顺泰	53,800	527,240.00	0.11
430	300017	网宿科技	62,400	492,960.00	0.10
431	688409	富创精密	13,200	487,608.00	0.10
432	300590	移为通信	41,200	470,504.00	0.10
433	600817	宇通重工	56,700	464,940.00	0.10
434	300776	帝尔激光	10,100	464,196.00	0.10
435	002648	卫星化学	22,400	402,752.00	0.08
436	600285	羚锐制药	16,600	401,886.00	0.08
437	300442	润泽科技	16,100	385,595.00	0.08
438	300800	力合科技	37,000	383,320.00	0.08
439	300031	宝通科技	25,800	370,746.00	0.08
440	002831	裕同科技	13,900	355,701.00	0.07
441	000600	建投能源	53,700	338,310.00	0.07
442	000906	浙商中拓	50,100	337,674.00	0.07
443	000915	华特达因	10,800	325,728.00	0.07
444	603258	电魂网络	20,100	324,615.00	0.07
445	300872	天阳科技	23,000	304,750.00	0.06
446	688558	国盛智科	14,757	272,709.36	0.06
447	002469	三维化学	47,600	271,320.00	0.06
448	600316	洪都航空	15,300	254,439.00	0.05
449	301589	诺瓦星云	1,208	227,116.08	0.05
450	300946	恒而达	8,400	223,776.00	0.05
451	601699	潞安环能	11,600	210,308.00	0.04
452	603025	大豪科技	15,100	208,682.00	0.04
453	300323	华灿光电	46,900	204,015.00	0.04
454	002483	润邦股份	45,200	203,852.00	0.04

455	603444	吉比特	1,000	178,010.00	0.04
456	600810	神马股份	28,400	176,080.00	0.04
457	601600	中国铝业	22,600	172,438.00	0.04
458	603992	松霖科技	7,800	143,442.00	0.03
459	600327	大东方	38,400	122,880.00	0.03
460	300815	玉禾田	9,300	108,252.00	0.02
461	001296	长江材料	6,400	91,200.00	0.02
462	688472	XD阿特斯	8,402	85,532.36	0.02
463	002765	蓝黛科技	14,600	68,620.00	0.01
464	603758	秦安股份	8,900	67,640.00	0.01
465	688429	时创能源	3,106	52,615.64	0.01
466	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
467	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
468	603162	海通发展	2,500	23,250.00	0.00
469	688709	成都华微	969	18,207.51	0.00
470	601609	金田股份	2,600	14,716.00	0.00
471	688256	寒武纪	71	14,105.57	0.00
472	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
473	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
474	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
475	688584	上海合晶	776	12,330.64	0.00
476	601033	永兴股份	762	12,161.52	0.00
477	301277	新天地	921	11,954.58	0.00
478	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
479	603341	龙旗科技	270	10,122.30	0.00
480	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
481	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
482	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
483	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
484	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
485	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
486	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
487	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
488	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
489	301550	斯菱股份	100	4,791.00	0.00
490	603187	海容冷链	400	4,664.00	0.00
491	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
492	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
493	301373	凌玮科技	176	4,012.80	0.00
494	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
495	603919	金徽酒	200	3,634.00	0.00
496	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
497	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

498	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
499	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
500	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
501	301376	致欧科技	26	550.42	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688601	力芯微	14,443,105.63	2.46
2	600285	羚锐制药	11,286,932.00	1.92
3	600642	申能股份	9,296,750.60	1.58
4	600566	济川药业	9,034,660.00	1.54
5	002984	森麒麟	8,486,887.20	1.44
6	600970	中材国际	7,902,663.00	1.35
7	600373	中文传媒	7,850,813.00	1.34
8	603379	三美股份	7,566,197.00	1.29
9	000651	格力电器	7,523,735.00	1.28
10	300418	昆仑万维	7,229,712.64	1.23
11	002273	水晶光电	7,080,593.00	1.21
12	002371	北方华创	6,892,260.21	1.17
13	002154	报喜鸟	6,824,453.00	1.16
14	300031	宝通科技	6,771,063.00	1.15
15	002138	顺络电子	6,673,212.00	1.14
16	600529	山东药玻	6,447,480.00	1.10
17	600435	北方导航	6,442,249.00	1.10
18	600546	山煤国际	6,396,105.94	1.09
19	603589	口子窖	6,276,033.00	1.07
20	601966	玲珑轮胎	6,231,948.00	1.06

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	688601	力芯微	14,542,044.70	2.47
2	600285	羚锐制药	11,209,156.00	1.91
3	600566	济川药业	10,955,489.00	1.86
4	600373	中文传媒	10,622,478.00	1.81
5	300418	昆仑万维	10,605,544.00	1.81
6	000932	华菱钢铁	10,023,079.72	1.71
7	600642	申能股份	9,877,755.50	1.68
8	002984	森麒麟	7,973,954.00	1.36

9	001309	德明利	7,755,667.00	1.32
10	603267	鸿远电子	7,526,581.00	1.28
11	600985	淮北矿业	7,513,669.06	1.28
12	603379	三美股份	7,500,108.00	1.28
13	600529	山东药玻	7,160,219.00	1.22
14	002244	滨江集团	7,159,041.00	1.22
15	002154	报喜鸟	7,088,286.00	1.21
16	600690	海尔智家	7,033,374.00	1.20
17	002138	顺络电子	6,964,940.00	1.19
18	600155	华创云信	6,935,092.00	1.18
19	300218	安利股份	6,818,698.00	1.16
20	000651	格力电器	6,758,161.00	1.15

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	2,912,056,963.75
卖出股票收入（成交）总额	2,967,286,606.05

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

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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体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	814,473.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,710.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	820,183.93

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
中欧金安量化混合 A	4,831	109,592.58	5,015,093.37	0.95%	524,426,675.72	99.05%
中欧金安量化混合 C	735	107,529.97	4,582,588.54	5.80%	74,451,939.00	94.20%
合计	5,566	109,320.21	9,597,681.91	1.58%	598,878,614.72	98.42%

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	中欧金安量化混合 A	438,139.84	0.08%
	中欧金安量化混合 C	0.00	0.00%
	合计	438,139.84	0.07%

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	中欧金安量化混合 A	10~50
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	10~50
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 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	893,269,013.78	139,571,239.72

(2022 年 1 月 20 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	608,617,669.78	84,430,248.65
本报告期基金总申购份额	11,785,009.43	8,976,047.66
减：本报告期基金总赎回份额	90,960,910.12	14,371,768.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	529,441,769.09	79,034,527.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

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 (%)	
中国中金财富证券	3	5,666,207,376.16	96.40	2,906,909.05	87.85	-
国金证券	3	211,363,983.58	3.60	402,189.88	12.15	-

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。

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 (%)
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧基金安量化混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧基金安量化混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧基金安量化混合型证券投资基金	中国证监会指定媒介	2024-04-20

	2024 年第 1 季度报告		
7	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
8	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	2024-06-25

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日