

中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 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：兴业证券股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	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	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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
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	57
§ 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	58
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	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中欧中证 500 指数增强		
基金主代码	015453		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 5 月 6 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	兴业证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	276,669,919.41 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
下属分级基金的交易代码	015453	015454	019694
报告期末下属分级基金的份额总额	180,740,897.13 份	95,269,873.67 份	659,148.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 500 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	李少峰
	联系电话	021-68609600	021-20370710

电子邮箱	liyihai@zofund.com	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95562
传真	021-33830351	0591-38507797
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	福建省福州市湖东路 268 号证券大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 11 楼
邮政编码	200120	200135
法定代表人	窦玉明	杨华辉

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)		
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
本期已实现收益	-55,344.33	-816,370.10	-3,589.45
本期利润	-3,067,395.40	-4,052,798.46	-29,672.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0168	-0.0412	-0.0442
本期加权平均净值利润率	-1.92%	-4.76%	-5.05%

本期基金份额净值增长率	-4.60%	-4.88%	-4.83%
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	-27,014,254.21	-15,279,411.76	-100,397.74
期末可供分配基金份额利润	-0.1495	-0.1604	-0.1523
期末基金资产净值	153,726,642.92	79,990,461.91	558,750.87
期末基金份额净值	0.8505	0.8396	0.8477
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	-14.95%	-16.04%	-4.66%

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

中欧中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.16%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.39%	-0.03%
过去三个月	-4.78%	0.99%	-6.16%	1.09%	1.38%	-0.10%

过去六个月	-4.60%	1.43%	-8.46%	1.53%	3.86%	-0.10%
过去一年	-10.48%	1.16%	-16.71%	1.21%	6.23%	-0.05%
自基金合同生效起 至今	-14.95%	0.98%	-12.30%	1.08%	-2.65%	-0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+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。

中欧中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.21%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.34%	-0.03%
过去三个月	-4.92%	0.99%	-6.16%	1.09%	1.24%	-0.10%
过去六个月	-4.88%	1.43%	-8.46%	1.53%	3.58%	-0.10%
过去一年	-11.02%	1.16%	-16.71%	1.21%	5.69%	-0.05%
自基金合同生效起 至今	-16.04%	0.98%	-12.30%	1.08%	-3.74%	-0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+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。

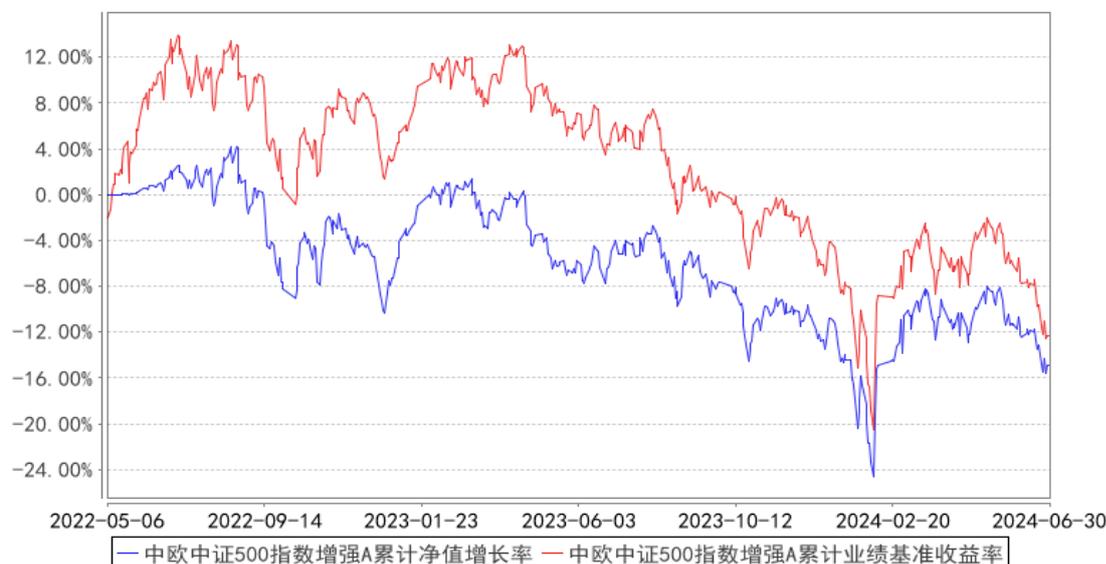
中欧中证 500 指数增强 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.19%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.36%	-0.03%
过去三个月	-4.89%	0.99%	-6.16%	1.09%	1.27%	-0.10%
过去六个月	-4.83%	1.43%	-8.46%	1.53%	3.63%	-0.10%
自基金份额起始运 作日至今	-4.66%	1.28%	-9.73%	1.36%	5.07%	-0.08%

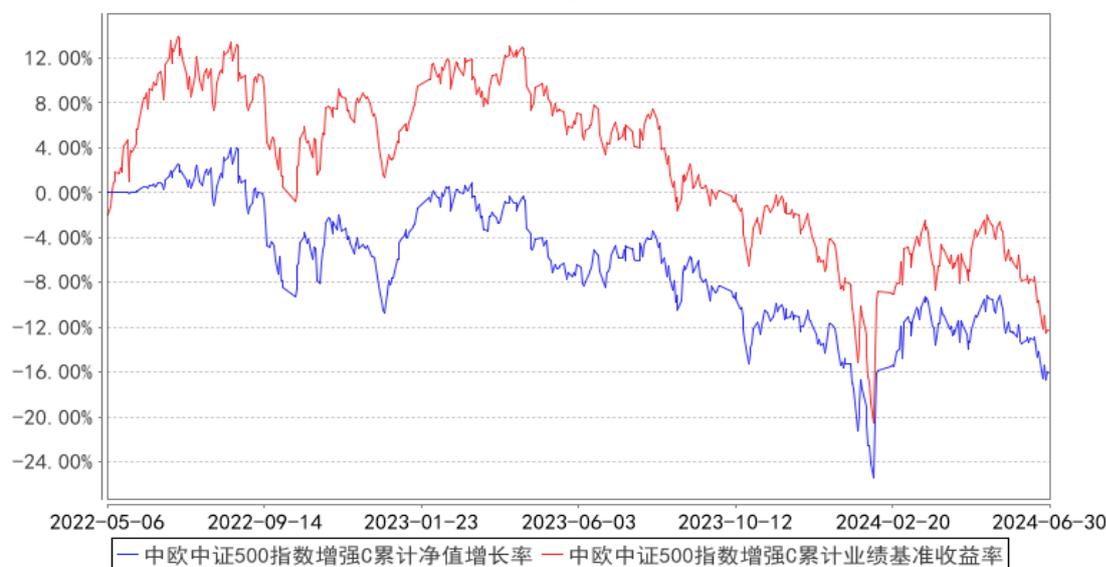
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

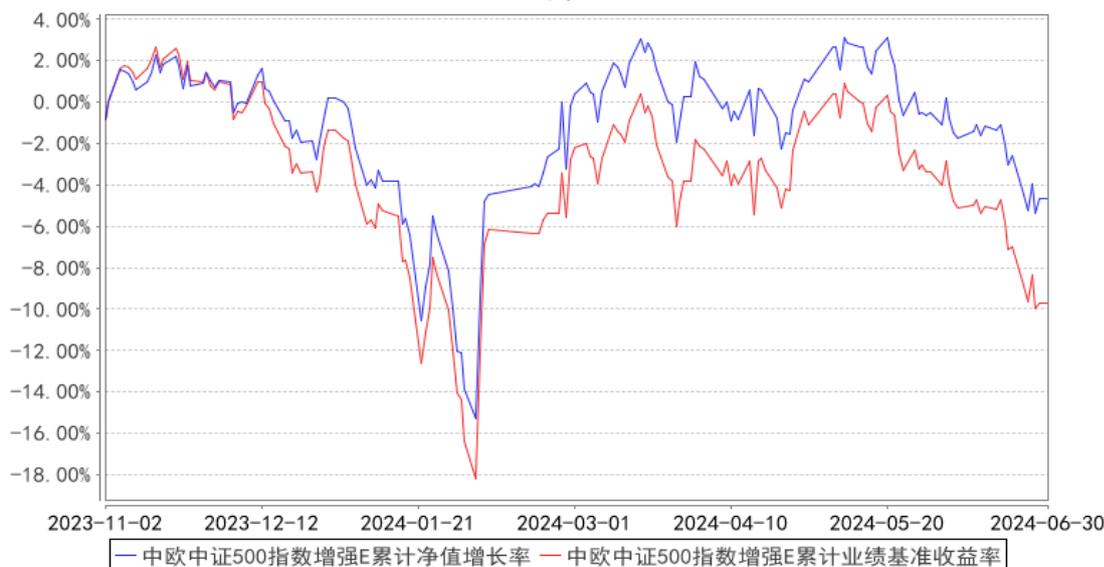
中欧中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧中证500指数增强E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2023 年 11 月 1 日新增 E 类份额，图示日期为 2023 年 11 月 2 日至 2024 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 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		
钱亚婷	基金经理	2022-05-06	-	8 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。
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。

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。

4.2 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，国内宏观经济处于结构性复苏中，制造业投资和出口增速强于社零消费和产业链投资增速。二级市场方面，年初经历了一轮流动性冲击，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

制造的比较优势，在上半年也有相对较好的表现。展望下半年，市场的定价重心或重新聚焦基本面，预计政策层面或将更加聚焦于需求端的刺激措施，但国内信心提振进度与海外降息节奏不明朗等因素，仍值得密切关注。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。当前市场仍处于修复期，在宏观经济结构调整的大背景下，投资者更倾向于投资安全性更高的资产，因此今年延续了前两年的市场风格，低估值、高股息的价值风格表现相对较好。但是从长期投资回报角度，成长空间大的这类投资标的，它们的估值在这几年持续被压缩，未来或具有更高的赔率。我们根据自己的禀赋和研究资源，将自己更擅长的基本面逻辑模型更上一层，通过多元量化模型，平衡短期风险和长期投资价值，选择优秀的企业，相信他们的收入和利润增长，会映射到合理的投资回报。

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-4.60%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；基金 C 类份额净值增长率为-4.88%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；基金 E 类份额净值增长率为-4.83%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二十届三中全会强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，预计下半年国内宏观政策以稳为主。流动性角度来看，美联储有望在 9 月份开启降息周期，中美利差的收窄，有利于缓解人民币汇率压力，7 月下旬以来，央行已经先后下调 7 天逆回购、LPR、MLF 利率，未来有望进一步宽松。我们预计下半年经济增长动能改善，通胀温和回升，名义 GDP 增速可能回升。当前 A 股市场总体处于低估区域，预计下行的空间不大。展望下半年，在经济结构调整的背景下，地产稳定政策对总需求的影响还需要等待和观察，比较难有一蹴而就的景气趋势投资机会，当前更需要结合估值位置，寻找稳定增长的投资机会。我们看好上市公司中盈利边际改善，同时估值合理的投资机会，市场有望恢复到以业绩为驱动的状态，业绩是公司价值的抓手，公司价值是股价的抓手。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本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：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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	8,209,472.52	15,202,845.78
结算备付金		3,054,525.64	1,242,390.58
存出保证金		472,089.60	652,416.00
交易性金融资产	6.4.7.2	221,511,178.81	221,518,850.81
其中：股票投资		213,833,673.19	216,359,141.77
基金投资		-	-
债券投资		7,677,505.62	5,159,709.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,745,120.95	1,785,470.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,151.77
资产总计		234,992,387.52	240,403,125.37
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		362,783.26	1,896,563.68

应付管理人报酬		199,208.53	200,486.09
应付托管费		29,881.28	30,072.90
应付销售服务费		40,067.89	45,900.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	39.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,590.86	50,000.00
负债合计		716,531.82	2,223,062.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	276,669,919.41	268,195,515.65
未分配利润	6.4.7.8	-42,394,063.71	-30,015,452.44
净资产合计		234,275,855.70	238,180,063.21
负债和净资产总计		234,992,387.52	240,403,125.37

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 276,669,919.41 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8505 元，基金份额总额 180,740,897.13 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.8396 元，基金份额总额 95,269,873.67 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 0.8477 元，基金份额总额 659,148.61 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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		-5,372,716.26	2,957,771.70
1. 利息收入		64,492.02	38,135.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,381.44	38,135.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		7,110.58	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		803,829.29	-736,785.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,192,978.31	-2,635,342.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	67,963.37	30,397.48
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	2,019,175.59	-271,542.11
股利收益	6.4.7.14	2,909,668.64	2,139,701.79
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	-6,274,562.27	3,635,189.28
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	33,524.70	21,231.79
减：二、营业总支出		1,777,149.89	1,351,746.71
1. 管理人报酬		1,225,785.18	897,884.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		183,867.74	134,682.72
3. 销售服务费		256,172.07	211,176.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		9,488.26	9,497.83
其中：卖出回购金融资产支出		9,488.26	9,497.83
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		8,297.04	244.53
8. 其他费用	6.4.7.18	93,539.60	98,260.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-7,149,866.15	1,606,024.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-7,149,866.15	1,606,024.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,149,866.15	1,606,024.99

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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	268,195,515.65	-	-30,015,452.44	238,180,063.21
二、本期期初净资产	268,195,515.65	-	-30,015,452.44	238,180,063.21

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,474,403.76	-	-12,378,611.27	-3,904,207.51
(一)、综合收益总额	-	-	-7,149,866.15	-7,149,866.15
(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)	8,474,403.76	-	-5,228,745.12	3,245,658.64
其中：1. 基金申购款	277,616,403.79	-	-40,614,354.31	237,002,049.48
2. 基金赎回款	-269,142,000.03	-	35,385,609.19	-233,756,390.84
(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	276,669,919.41	-	-42,394,063.71	234,275,855.70
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	153,387,349.76	-	-11,288,135.15	142,099,214.61
二、本期期初净资产	153,387,349.76	-	-11,288,135.15	142,099,214.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	76,206,975.54	-	-923,477.66	75,283,497.88
(一)、综合收益总额	-	-	1,606,024.99	1,606,024.99
(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)	76,206,975.54	-	-2,529,502.65	73,677,472.89
其中：1. 基金申购款	324,229,133.77	-	-11,980,209.08	312,248,924.69
2. 基金赎回款	-248,022,158.2	-	9,450,706.43	-238,571,451.80

	3			
(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	229,594,325.30	-	-12,211,612.81	217,382,712.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘建平</u>	<u>杨毅</u>	<u>王音然</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]452 号《关于准予中欧中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 554,717,103.97 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_B28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 554,773,443.76 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 56,339.79 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 239,826,320.08 份，包含认购利息折合 37,397.50 份；C 类基金的基金份额总额为 314,947,123.68 份，包含认购利息折合 18,942.29 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，基金托管人为兴业证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 500 指数增强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（包括创业板股票以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。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:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 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	1,857,423.32
等于：本金	1,856,835.66
加：应计利息	587.66
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	6,352,049.20
等于：本金	6,351,181.18
加：应计利息	868.02
减：坏账准备	-
合计	8,209,472.52

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	222,450,237.79	-	213,833,673.19	-8,616,564.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,609,135.00	64,785.62	7,677,505.62	3,585.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,609,135.00	64,785.62	7,677,505.62	3,585.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	230,059,372.79	64,785.62	221,511,178.81	-8,612,979.60	

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			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	4,141,520.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,141,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,141,520.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	4.00	3,934,080.00	-207,440.00
合计				-207,440.00
减：可抵销期货暂收款				-207,440.00
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 0。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合约产生的持仓损益，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）之间按抵消后净额为 0。

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	-
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	24,863.02
其他应付	55.50
合计	84,590.86

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 500 指数增强 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	164,655,064.69	164,655,064.69
本期申购	93,748,312.36	93,748,312.36
本期赎回（以“-”号填列）	-77,662,479.92	-77,662,479.92
本期末	180,740,897.13	180,740,897.13

中欧中证 500 指数增强 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	102,821,367.65	102,821,367.65

本期申购	177,960,083.32	177,960,083.32
本期赎回（以“-”号填列）	-185,511,577.30	-185,511,577.30
本期末	95,269,873.67	95,269,873.67

中欧中证 500 指数增强 E

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	719,083.31	719,083.31
本期申购	5,908,008.11	5,908,008.11
本期赎回（以“-”号填列）	-5,967,942.81	-5,967,942.81
本期末	659,148.61	659,148.61

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

中欧中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,027,997.00	-3,844,161.06	-17,872,158.06
本期期初	-14,027,997.00	-3,844,161.06	-17,872,158.06
本期利润	-55,344.33	-3,012,051.07	-3,067,395.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,890,542.39	-4,184,158.36	-6,074,700.75
其中：基金申购款	-9,320,981.77	-6,683,476.06	-16,004,457.83
基金赎回款	7,430,439.38	2,499,317.70	9,929,757.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,973,883.72	-11,040,370.49	-27,014,254.21

中欧中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,673,769.21	-2,390,942.23	-12,064,711.44
本期期初	-9,673,769.21	-2,390,942.23	-12,064,711.44
本期利润	-816,370.10	-3,236,428.36	-4,052,798.46
本期基金份额交易产生的变动数	977,389.73	-139,291.59	838,098.14
其中：基金申购款	-18,135,697.45	-5,734,182.29	-23,869,879.74
基金赎回款	19,113,087.18	5,594,890.70	24,707,977.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,512,749.58	-5,766,662.18	-15,279,411.76

中欧中证 500 指数增强 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-61,789.93	-16,793.01	-78,582.94
本期期初	-61,789.93	-16,793.01	-78,582.94
本期利润	-3,589.45	-26,082.84	-29,672.29
本期基金份额交易产生的	5,179.14	2,678.35	7,857.49

生的变动数			
其中：基金申购款	-566,823.71	-173,193.03	-740,016.74
基金赎回款	572,002.85	175,871.38	747,874.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,200.24	-40,197.50	-100,397.74

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	9,176.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	19,099.44
结算备付金利息收入	29,105.97
其他	-
合计	57,381.44

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	1,094,035,906.45
减：卖出股票成本总额	1,096,405,080.05
减：交易费用	1,823,804.71
买卖股票差价收入	-4,192,978.31

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	65,094.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,869.00
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	67,963.37

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	5,193,156.03

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,097,211.00
减：应计利息总额	93,076.03
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,869.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	2,019,175.59

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	2,909,668.64
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	2,909,668.64

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	-6,089,162.27
股票投资	-6,093,648.27
债券投资	4,486.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-185,400.00
权证投资	-
期货投资	-185,400.00

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	-6,274,562.27

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	33,480.91
基金转换费收入	43.79
合计	33,524.70

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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
存托服务费	4.24
合计	93,539.60

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
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	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(%)
兴业证券	1,784,597,790.97	81.38	621,545,011.42	46.90

6.4.10.1.2 债券交易

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 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例(%)
兴业证券	9,668,509.27	100.00	1,006,342.60	100.00

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(%)
兴业证券	62,359,000.00	100.00	56,751,000.00	100.00

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 (%)
兴业证券	929,390.50	81.81	-	-
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 (%)
兴业证券	500,129.23	53.06	-	-

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	1,225,785.18	897,884.96
其中：应支付销售机构的客户维护 费	296,381.25	240,194.01
应支付基金管理人的净管理费	929,403.93	657,690.95

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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托管费	183,867.74	134,682.72

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

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			
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E	合计
国都证券	0.00	8.73	0.00	8.73
兴业证券	0.00	165,889.14	0.00	165,889.14
中欧财富	0.00	658.57	24.83	683.40
中欧基金	0.00	0.00	366.61	366.61
合计	0.00	166,556.44	391.44	166,947.88
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			
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00	0.00
兴业证券	0.00	137,728.26	0.00	137,728.26
中欧财富	0.00	64.51	0.00	64.51
中欧基金	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	137,792.77	0.00	137,792.77

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年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理

人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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

中欧中证 500 指数增强 A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	10,001,819.44	10,001,819.44
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,001,819.44	10,001,819.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.53%	8.73%

中欧中证 500 指数增强 E

份额单位：份

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
----	---------------------------------------	--

报告期初持有的基金份额	168,709.93	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	168,709.93	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.60%	-

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、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 C 类基金份额。

3、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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

中欧中证 500 指数增强 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	11,500.16	0.01%	54,872.88	0.03%

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、本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类基金份额、E 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
兴业证券股份有限公司	6,796,475.00	25,288.21	1,688,290.20	11,544.40

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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	177	3,078.03	3,646.20	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	176	2,988.48	2,372.48	-
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	-
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	597	7,092.36	11,331.06	-
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	148	6,652.60	9,757.64	-
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	70.47	188.01	497	35,021.64	93,440.97	-
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	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	310	5,022.00	4,947.60	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	104	2,213.12	3,066.96	-
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	1,090	20,328.50	20,328.50	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	122	2,275.30	2,275.30	-
603312	西	2024	6个月	新股	29.02	25.36	89	2,582.78	2,257.04	-

	典新能	年1月4日		流通受限						
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	37	2,681.02	2,518.22	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	127	3,302.00	4,761.23	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	154	2,953.72	3,489.64	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	67	2,558.06	2,606.30	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	106	2,475.10	2,663.78	-
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	331	7,500.46	5,259.59	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	91	7,913.36	15,918.63	-
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	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	415	6,511.35	7,797.85	-

	微								
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--

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

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析

的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其

上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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	8,209,472.52	-	-	-	8,209,472.52
结算备付金	3,054,525.64	-	-	-	3,054,525.64
存出保证金	-	-	-	472,089.60	472,089.60
交易性金融资产	7,677,505.62	-	-	-213,833,673.19	221,511,178.81
应收申购款	-	-	-	1,745,120.95	1,745,120.95
资产总计	18,941,503.78	-	-	-216,050,883.74	234,992,387.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	362,783.26	362,783.26
应付管理人报酬	-	-	-	199,208.53	199,208.53
应付托管费	-	-	-	29,881.28	29,881.28

应付销售服务费	-	-	-	40,067.89	40,067.89
其他负债	-	-	-	84,590.86	84,590.86
负债总计	-	-	-	716,531.82	716,531.82
利率敏感度缺口	18,941,503.78	-	-	-215,334,351.92	234,275,855.70
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	15,202,845.78	-	-	-	15,202,845.78
结算备付金	1,242,390.58	-	-	-	1,242,390.58
存出保证金	-	-	-	652,416.00	652,416.00
交易性金融资产	5,159,709.04	-	-	-216,359,141.77	221,518,850.81
应收申购款	-	-	-	1,785,470.43	1,785,470.43
其他资产	-	-	-	1,151.77	1,151.77
资产总计	21,604,945.40	-	-	-218,798,179.97	240,403,125.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,896,563.68	1,896,563.68
应付管理人报酬	-	-	-	200,486.09	200,486.09
应付托管费	-	-	-	30,072.90	30,072.90
应付销售服务费	-	-	-	45,900.08	45,900.08
应交税费	-	-	-	39.41	39.41
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	2,223,062.16	2,223,062.16
利率敏感度缺口	21,604,945.40	-	-	-216,575,117.81	238,180,063.21

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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 3.28%（2023 年 12 月 31 日：2.17%），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	213,833,673.19	91.27	216,359,141.77	90.84
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	213,833,673.19	91.27	216,359,141.77	90.84

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%	10,830,521.62	11,875,105.02
	业绩比较基准下降5%	-10,830,521.62	-11,875,105.02

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	213,545,982.49	215,726,896.33
第二层次	7,700,109.42	5,159,709.04
第三层次	265,086.90	632,245.44
合计	221,511,178.81	221,518,850.81

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	213,833,673.19	91.00
	其中：股票	213,833,673.19	91.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,677,505.62	3.27
	其中：债券	7,677,505.62	3.27
	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	11,263,998.16	4.79
8	其他各项资产	2,217,210.55	0.94
9	合计	234,992,387.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	990,457.00	0.42
B	采矿业	4,676,224.00	2.00
C	制造业	120,549,332.24	51.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,349,510.00	3.56
E	建筑业	3,976,001.28	1.70
F	批发和零售业	1,541,932.80	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	8,003,912.00	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,318,610.14	4.40
J	金融业	19,032,793.10	8.12
K	房地产业	1,188,462.00	0.51
L	租赁和商务服务业	1,825,423.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共	730,590.00	0.31

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,989,800.00	1.28
S	综合	-	-
	合计	184,173,047.56	78.61

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	392,589.00	0.17
C	制造业	24,816,837.39	10.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	262,542.00	0.11
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	261,208.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,922,501.64	1.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,947.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,660,625.63	12.66

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601128	常熟银行	758,830	5,744,343.10	2.45
2	601665	齐鲁银行	956,700	4,697,397.00	2.01
3	000883	湖北能源	723,300	4,347,033.00	1.86
4	688301	奕瑞科技	30,632	3,529,725.36	1.51
5	600350	山东高速	380,700	3,369,195.00	1.44
6	002273	水晶光电	193,000	3,277,140.00	1.40
7	000519	中兵红箭	221,000	3,242,070.00	1.38
8	601636	旗滨集团	482,900	3,114,705.00	1.33
9	600435	北方导航	300,500	2,590,310.00	1.11
10	300394	天孚通信	29,060	2,569,485.20	1.10
11	601608	中信重工	670,100	2,553,081.00	1.09
12	688099	晶晨股份	42,954	2,548,031.28	1.09
13	001872	招商港口	125,800	2,421,650.00	1.03
14	300502	新易盛	22,700	2,395,985.00	1.02
15	002430	杭氧股份	105,300	2,342,925.00	1.00
16	000887	中鼎股份	178,800	2,188,512.00	0.93
17	002028	思源电气	32,700	2,187,630.00	0.93
18	600529	山东药玻	84,100	2,131,094.00	0.91
19	002138	顺络电子	73,900	2,029,294.00	0.87
20	600315	上海家化	112,700	2,003,806.00	0.86
21	688029	南微医学	32,383	1,993,497.48	0.85
22	600970	中材国际	162,300	1,957,338.00	0.84
23	688120	华海清科	10,300	1,952,674.00	0.83
24	688520	神州细胞	49,428	1,944,991.80	0.83
25	600499	科达制造	222,900	1,879,047.00	0.80
26	002152	广电运通	177,700	1,858,742.00	0.79
27	600764	中国海防	94,100	1,847,183.00	0.79
28	600879	航天电子	233,800	1,816,626.00	0.78
29	603160	汇顶科技	26,000	1,787,500.00	0.76
30	000400	许继电气	51,600	1,775,556.00	0.76
31	300487	蓝晓科技	42,400	1,770,624.00	0.76
32	603893	瑞芯微	29,700	1,757,349.00	0.75
33	600820	隧道股份	266,500	1,740,245.00	0.74
34	300395	菲利华	54,900	1,688,175.00	0.72
35	300251	光线传媒	200,400	1,685,364.00	0.72
36	600873	梅花生物	166,800	1,671,336.00	0.71
37	601966	玲珑轮胎	85,300	1,566,961.00	0.67
38	688002	睿创微纳	55,300	1,546,741.00	0.66
39	002831	裕同科技	60,000	1,535,400.00	0.66

40	601233	桐昆股份	93,626	1,494,270.96	0.64
41	601717	郑煤机	98,900	1,463,720.00	0.62
42	600038	中直股份	35,400	1,455,294.00	0.62
43	002984	森麒麟	59,300	1,428,537.00	0.61
44	300002	神州泰岳	174,583	1,417,613.96	0.61
45	688516	奥特维	33,855	1,415,477.55	0.60
46	000933	神火股份	69,800	1,412,054.00	0.60
47	003031	中瓷电子	30,300	1,401,072.00	0.60
48	601156	东航物流	68,700	1,398,045.00	0.60
49	600021	上海电力	137,800	1,362,842.00	0.58
50	300003	乐普医疗	90,000	1,335,600.00	0.57
51	600755	厦门国贸	186,200	1,335,054.00	0.57
52	300724	捷佳伟创	24,400	1,317,844.00	0.56
53	600373	中文传媒	87,900	1,304,436.00	0.56
54	603486	科沃斯	27,600	1,302,168.00	0.56
55	000636	风华高科	97,900	1,278,574.00	0.55
56	000830	鲁西化工	108,500	1,257,515.00	0.54
57	600988	赤峰黄金	76,300	1,246,742.00	0.53
58	600566	济川药业	39,100	1,239,861.00	0.53
59	000423	东阿阿胶	19,800	1,239,480.00	0.53
60	002155	湖南黄金	68,200	1,234,420.00	0.53
61	688772	珠海冠宇	81,844	1,219,475.60	0.52
62	600361	创新新材	302,500	1,219,075.00	0.52
63	002244	滨江集团	163,700	1,188,462.00	0.51
64	600546	山煤国际	79,500	1,162,290.00	0.50
65	600801	华新水泥	84,100	1,156,375.00	0.49
66	300529	健帆生物	41,900	1,140,099.00	0.49
67	688525	佰维存储	17,700	1,135,455.00	0.48
68	603883	老百姓	60,580	1,112,248.80	0.47
69	688281	华秦科技	13,340	1,111,488.80	0.47
70	002423	中粮资本	148,000	1,108,520.00	0.47
71	002532	天山铝业	136,200	1,104,582.00	0.47
72	688188	柏楚电子	5,818	1,073,711.90	0.46
73	000729	燕京啤酒	121,300	1,071,079.00	0.46
74	600299	安迪苏	108,800	1,055,360.00	0.45
75	300558	贝达药业	32,300	1,051,365.00	0.45
76	603737	三棵树	28,900	1,048,203.00	0.45
77	600521	华海药业	61,100	1,041,755.00	0.44
78	300253	卫宁健康	176,000	1,038,400.00	0.44
79	300207	欣旺达	68,200	1,034,594.00	0.44
80	600582	天地科技	148,700	1,024,543.00	0.44
81	300383	光环新网	120,900	1,021,605.00	0.44
82	002019	亿帆医药	82,200	1,015,992.00	0.43

83	000893	亚钾国际	62,800	1,014,848.00	0.43
84	601615	明阳智能	106,900	1,009,136.00	0.43
85	002153	石基信息	173,200	992,436.00	0.42
86	600598	北大荒	79,300	990,457.00	0.42
87	300776	帝尔激光	21,500	988,140.00	0.42
88	000703	恒逸石化	136,500	967,785.00	0.41
89	600642	申能股份	108,600	958,938.00	0.41
90	000997	新大陆	68,400	951,444.00	0.41
91	603379	三美股份	24,300	951,102.00	0.41
92	002409	雅克科技	15,000	943,650.00	0.40
93	603228	景旺电子	28,800	915,840.00	0.39
94	002568	百润股份	54,000	908,820.00	0.39
95	002340	格林美	142,400	907,088.00	0.39
96	002008	大族激光	42,500	884,000.00	0.38
97	688234	天岳先进	17,900	839,868.00	0.36
98	601198	东兴证券	103,300	822,268.00	0.35
99	688276	百克生物	28,777	816,403.49	0.35
100	002120	韵达股份	105,300	815,022.00	0.35
101	002202	金风科技	115,800	778,176.00	0.33
102	002608	江苏国信	99,800	773,450.00	0.33
103	601990	南京证券	100,200	769,536.00	0.33
104	603568	伟明环保	35,500	730,590.00	0.31
105	600095	湘财股份	120,400	717,584.00	0.31
106	000563	陕国投 A	257,500	708,125.00	0.30
107	002078	太阳纸业	50,000	697,500.00	0.30
108	000818	航锦科技	31,000	684,480.00	0.29
109	600399	抚顺特钢	103,700	583,831.00	0.25
110	001203	大中矿业	59,500	571,795.00	0.24
111	600298	安琪酵母	20,300	566,979.00	0.24
112	002517	恺英网络	59,100	564,405.00	0.24
113	300001	特锐德	27,200	547,264.00	0.23
114	603589	口子窖	13,900	544,741.00	0.23
115	601058	赛轮轮胎	37,700	527,800.00	0.23
116	600062	华润双鹤	25,800	505,164.00	0.22
117	002563	森马服饰	83,000	482,230.00	0.21
118	603444	吉比特	2,700	480,627.00	0.21
119	002025	航天电器	10,100	468,438.00	0.20
120	002683	广东宏大	22,900	460,977.00	0.20
121	688617	惠泰医疗	1,000	456,100.00	0.19
122	600859	王府井	36,600	429,684.00	0.18
123	300058	蓝色光标	77,500	421,600.00	0.18
124	601108	财通证券	57,500	380,075.00	0.16
125	000598	兴蓉环境	49,500	372,240.00	0.16

126	600141	兴发集团	19,000	362,520.00	0.15
127	600126	杭钢股份	85,200	350,172.00	0.15
128	002572	索菲亚	22,800	349,524.00	0.15
129	600109	国金证券	45,300	342,015.00	0.15
130	601555	东吴证券	56,200	331,580.00	0.14
131	688779	长远锂科	71,400	330,582.00	0.14
132	002797	第一创业	56,500	287,585.00	0.12
133	000728	国元证券	47,300	286,638.00	0.12
134	002673	西部证券	45,100	279,169.00	0.12
135	000032	深桑达 A	18,586	278,418.28	0.12
136	000783	长江证券	57,000	275,310.00	0.12
137	601162	天风证券	114,900	250,482.00	0.11
138	601696	中银证券	27,300	247,884.00	0.11
139	002558	巨人网络	24,400	230,336.00	0.10
140	600369	西南证券	64,200	229,836.00	0.10
141	600066	宇通客车	8,900	229,620.00	0.10
142	300677	英科医疗	8,400	225,204.00	0.10
143	600909	华安证券	45,100	189,871.00	0.08
144	002064	华峰化学	25,600	183,552.00	0.08
145	601456	国联证券	18,600	179,304.00	0.08
146	600008	首创环保	64,900	173,932.00	0.07
147	000750	国海证券	59,600	173,436.00	0.07
148	002939	长城证券	24,900	166,830.00	0.07
149	002926	华西证券	24,000	158,160.00	0.07
150	001286	陕西能源	13,700	157,961.00	0.07
151	002557	洽洽食品	5,600	157,864.00	0.07
152	002500	山西证券	33,100	155,570.00	0.07
153	000630	铜陵有色	39,800	143,678.00	0.06
154	600032	浙江新能	18,700	136,136.00	0.06
155	600390	五矿资本	33,000	133,650.00	0.06
156	600901	江苏金租	22,780	115,039.00	0.05
157	000967	盈峰环境	25,400	107,442.00	0.05
158	600398	海澜之家	10,900	100,716.00	0.04
159	000987	越秀资本	20,000	99,200.00	0.04
160	600517	国网英大	22,400	96,992.00	0.04
161	002670	国盛金控	10,200	86,394.00	0.04
162	000785	居然之家	28,300	68,769.00	0.03
163	000958	电投产融	18,300	66,978.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	99,500	1,577,075.00	0.67
2	600487	亨通光电	98,500	1,553,345.00	0.66

3	000409	云鼎科技	152,500	1,230,675.00	0.53
4	002236	大华股份	67,200	1,038,912.00	0.44
5	002322	理工能科	64,300	1,030,086.00	0.44
6	002922	伊戈尔	44,600	974,956.00	0.42
7	002463	沪电股份	26,300	959,950.00	0.41
8	688019	安集科技	7,242	911,043.60	0.39
9	688138	清溢光电	41,300	887,950.00	0.38
10	002371	北方华创	2,700	863,703.00	0.37
11	688252	天德钰	57,758	839,223.74	0.36
12	688127	蓝特光学	45,000	827,550.00	0.35
13	688484	南芯科技	21,300	790,230.00	0.34
14	300926	博俊科技	38,505	770,870.10	0.33
15	688510	航亚科技	41,307	760,461.87	0.32
16	300870	欧陆通	16,200	702,756.00	0.30
17	688581	安杰思	14,260	697,741.80	0.30
18	688408	中信博	7,300	672,184.00	0.29
19	688578	艾力斯	9,754	621,719.96	0.27
20	603992	松霖科技	31,300	575,607.00	0.25
21	688253	英诺特	14,111	537,770.21	0.23
22	605319	无锡振华	28,400	502,680.00	0.21
23	300719	安达维尔	27,600	467,820.00	0.20
24	300181	佐力药业	30,700	464,184.00	0.20
25	000403	派林生物	17,400	463,884.00	0.20
26	002026	山东威达	52,900	439,070.00	0.19
27	603088	宁波精达	58,200	438,246.00	0.19
28	002422	科伦药业	13,400	406,422.00	0.17
29	002906	华阳集团	14,700	393,372.00	0.17
30	000975	山金国际	24,100	392,589.00	0.17
31	300453	三鑫医疗	61,300	391,707.00	0.17
32	603283	赛腾股份	5,100	389,640.00	0.17
33	300547	川环科技	23,800	389,130.00	0.17
34	002988	豪美新材	25,200	386,820.00	0.17
35	000550	江铃汽车	17,800	386,438.00	0.16
36	301345	涛涛车业	7,000	385,700.00	0.16
37	301033	迈普医学	9,700	379,367.00	0.16
38	688278	特宝生物	6,601	353,483.55	0.15
39	605003	众望布艺	20,600	330,630.00	0.14
40	002823	凯中精密	26,100	318,420.00	0.14
41	600312	平高电气	15,900	309,255.00	0.13
42	002083	孚日股份	69,000	291,870.00	0.12
43	000521	长虹美菱	38,100	288,798.00	0.12
44	300403	汉宇集团	41,400	282,762.00	0.12
45	301498	乖宝宠物	5,100	274,380.00	0.12

46	301004	嘉益股份	3,000	273,000.00	0.12
47	002116	中国海诚	28,200	262,542.00	0.11
48	002928	华夏航空	41,200	261,208.00	0.11
49	688147	微导纳米	10,000	249,000.00	0.11
50	003000	劲仔食品	14,800	178,340.00	0.08
51	600186	莲花控股	51,800	177,674.00	0.08
52	301589	诺瓦星云	497	93,440.97	0.04
53	603285	键邦股份	1,212	22,603.80	0.01
54	688692	达梦数据	91	15,918.63	0.01
55	688472	XD 阿特斯	1,487	15,137.66	0.01
56	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
57	301565	中仑新材	597	11,331.06	0.00
58	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
59	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
60	301580	爱迪特	148	9,757.64	0.00
61	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
62	688709	成都华微	415	7,797.85	0.00
63	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
64	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
65	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
66	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
67	301277	新天地	428	5,555.44	0.00
68	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
69	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
70	688584	上海合晶	331	5,259.59	0.00
71	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
72	601033	永兴股份	310	4,947.60	0.00
73	603341	龙旗科技	127	4,761.23	0.00
74	001359	平安电工	177	3,646.20	0.00
75	603344	星德胜	154	3,489.64	0.00
76	603082	北自科技	104	3,066.96	0.00
77	603381	永臻股份	106	2,663.78	0.00
78	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
79	603375	盛景微	67	2,606.30	0.00
80	603325	博隆技术	37	2,518.22	0.00
81	001379	腾达科技	176	2,372.48	0.00
82	603312	西典新能	89	2,257.04	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	002273	水晶光电	12,205,564.00	5.12

2	002138	顺络电子	11,311,545.00	4.75
3	300394	天孚通信	11,256,023.00	4.73
4	688301	奕瑞科技	11,154,155.93	4.68
5	601128	常熟银行	10,866,967.28	4.56
6	300251	光线传媒	9,353,269.00	3.93
7	002739	万达电影	9,196,936.00	3.86
8	002738	中矿资源	8,857,460.96	3.72
9	300418	昆仑万维	8,768,602.00	3.68
10	601665	齐鲁银行	8,686,931.00	3.65
11	300037	新宙邦	8,677,099.00	3.64
12	300253	卫宁健康	8,595,830.00	3.61
13	002244	滨江集团	8,516,427.00	3.58
14	002463	沪电股份	8,481,743.00	3.56
15	300502	新易盛	8,318,645.00	3.49
16	688772	珠海冠宇	8,222,724.93	3.45
17	600153	建发股份	7,667,128.00	3.22
18	600998	九州通	7,367,853.00	3.09
19	000883	湖北能源	7,346,357.00	3.08
20	002966	苏州银行	7,122,212.40	2.99
21	000975	山金国际	7,059,193.00	2.96
22	002867	周大生	7,054,412.00	2.96
23	600529	山东药玻	7,010,636.00	2.94
24	600985	淮北矿业	6,858,479.00	2.88
25	600566	济川药业	6,762,506.00	2.84
26	603267	鸿远电子	6,723,836.00	2.82
27	600418	江淮汽车	6,681,251.00	2.81
28	300487	蓝晓科技	6,510,932.00	2.73
29	002465	海格通信	6,344,518.00	2.66
30	688188	柏楚电子	6,329,310.41	2.66
31	000933	神火股份	6,289,673.00	2.64
32	002409	雅克科技	6,282,077.00	2.64
33	688385	复旦微电	6,280,422.72	2.64
34	603712	七一二	6,138,258.00	2.58
35	601928	凤凰传媒	6,076,699.00	2.55
36	688002	睿创微纳	5,981,294.80	2.51
37	002568	百润股份	5,837,426.00	2.45
38	002281	光迅科技	5,803,678.00	2.44
39	300383	光环新网	5,687,104.00	2.39
40	002430	杭氧股份	5,681,702.00	2.39
41	300529	健帆生物	5,580,188.00	2.34
42	002600	领益智造	5,496,394.00	2.31
43	688052	纳芯微	5,338,385.55	2.24
44	688099	晶晨股份	5,333,073.30	2.24

45	600499	科达制造	5,323,363.00	2.24
46	600970	中材国际	5,212,300.00	2.19
47	603658	安图生物	5,171,616.00	2.17
48	600373	中文传媒	5,110,884.00	2.15
49	603225	新凤鸣	5,068,636.00	2.13
50	300604	长川科技	5,059,915.00	2.12
51	002468	申通快递	5,040,866.00	2.12
52	002028	思源电气	4,959,815.00	2.08
53	601966	玲珑轮胎	4,926,080.00	2.07
54	000729	燕京啤酒	4,915,069.00	2.06
55	600867	通化东宝	4,904,242.00	2.06
56	600066	宇通客车	4,808,963.88	2.02
57	688169	石头科技	4,798,800.80	2.01

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	002273	水晶光电	13,394,461.00	5.62
2	002463	沪电股份	11,653,859.14	4.89
3	300418	昆仑万维	11,590,095.47	4.87
4	002138	顺络电子	10,888,613.00	4.57
5	300394	天孚通信	10,271,982.96	4.31
6	600566	济川药业	9,994,691.00	4.20
7	603225	新凤鸣	9,826,297.38	4.13
8	002738	中矿资源	9,673,347.92	4.06
9	002739	万达电影	9,485,177.50	3.98
10	300251	光线传媒	9,482,267.00	3.98
11	603267	鸿远电子	9,436,956.00	3.96
12	600985	淮北矿业	9,045,628.00	3.80
13	002966	苏州银行	8,999,002.30	3.78
14	000975	山金国际	8,930,883.00	3.75
15	002244	滨江集团	8,577,528.00	3.60
16	300604	长川科技	8,336,644.62	3.50
17	603658	安图生物	8,174,926.50	3.43
18	600529	山东药玻	8,109,319.00	3.40
19	300037	新宙邦	8,091,769.00	3.40
20	688772	珠海冠宇	8,001,382.90	3.36
21	600153	建发股份	7,878,778.94	3.31
22	688072	拓荆科技	7,735,717.19	3.25
23	000933	神火股份	7,519,022.41	3.16
24	600998	九州通	7,491,771.34	3.15
25	002600	领益智造	7,491,477.00	3.15

26	002568	百润股份	7,105,970.24	2.98
27	002867	周大生	7,102,534.00	2.98
28	688169	石头科技	7,012,723.34	2.94
29	300253	卫宁健康	6,898,373.00	2.90
30	300502	新易盛	6,875,021.42	2.89
31	002409	雅克科技	6,783,744.00	2.85
32	600867	通化东宝	6,769,814.00	2.84
33	603233	大参林	6,720,851.64	2.82
34	603927	中科软	6,700,214.40	2.81
35	688301	奕瑞科技	6,698,295.92	2.81
36	603712	七一二	6,527,966.00	2.74
37	002465	海格通信	6,327,972.00	2.66
38	600418	江淮汽车	6,128,445.00	2.57
39	601233	桐昆股份	6,030,980.00	2.53
40	002422	科伦药业	6,028,370.00	2.53
41	688728	格科微	5,937,110.13	2.49
42	601966	玲珑轮胎	5,912,830.00	2.48
43	601928	凤凰传媒	5,877,073.00	2.47
44	600066	宇通客车	5,734,262.64	2.41
45	600373	中文传媒	5,652,631.00	2.37
46	002281	光迅科技	5,586,693.24	2.35
47	600528	中铁工业	5,474,188.00	2.30
48	002572	索菲亚	5,473,110.00	2.30
49	601128	常熟银行	5,433,127.00	2.28
50	688385	复旦微电	5,351,741.78	2.25
51	688052	纳芯微	5,249,756.18	2.20
52	601665	齐鲁银行	5,233,503.70	2.20
53	002468	申通快递	5,192,845.00	2.18
54	300529	健帆生物	5,180,572.00	2.18
55	688188	柏楚电子	5,111,182.49	2.15
56	600160	巨化股份	5,101,704.00	2.14
57	600398	海澜之家	4,999,883.00	2.10
58	603596	伯特利	4,892,382.60	2.05
59	000423	东阿阿胶	4,852,975.00	2.04
60	601577	长沙银行	4,843,471.60	2.03
61	603826	坤彩科技	4,789,548.00	2.01
62	600096	云天化	4,788,241.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,099,973,259.74
卖出股票收入（成交）总额	1,094,035,906.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	7,677,505.62	3.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,677,505.62	3.28

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019740	24 国债 09	29,000	2,909,914.03	1.24
2	019733	24 国债 02	24,000	2,425,753.64	1.04
3	019727	23 国债 24	23,000	2,341,837.95	1.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，齐鲁银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局山东监管局、央行济南分行的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	472,089.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,745,120.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,217,210.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧中证 500 指数增强 A	2,056	87,909.00	99,284,606.67	54.93%	81,456,290.46	45.07%
中欧中证 500 指数增强 C	2,762	34,493.08	2,324,588.79	2.44%	92,945,284.88	97.56%
中欧中证 500 指数增强 E	133	4,956.00	168,709.93	25.60%	490,438.68	74.40%
合计	4,951	55,881.62	101,777,905.39	36.79%	174,892,014.02	63.21%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧中证 500 指数增强 A	171,941.75	0.10%
	中欧中证 500 指数增强 C	0.00	0.00%
	中欧中证 500 指数增强 E	0.00	0.00%
	合计	171,941.75	0.06%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	中欧中证 500 指数增强 A	0
	中欧中证 500 指数增强 C	0
	中欧中证 500 指数增强 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 500 指数增强 A	10~50
	中欧中证 500 指数增强 C	0
	中欧中证 500 指数增强 E	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
基金合同生效日（2022 年 5 月 6 日）基金份额总额	239,826,320.08	314,947,123.68	-
本报告期期初基金份额总额	164,655,064.69	102,821,367.65	719,083.31
本报告期基金总申购份额	93,748,312.36	177,960,083.32	5,908,008.11
减：本报告期基金总赎回份额	77,662,479.92	185,511,577.30	5,967,942.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	180,740,897.13	95,269,873.67	659,148.61

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员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 (%)	
兴业证券	3	1,784,597,790.97	81.38	929,390.50	81.81	-
国投证券	3	408,200,347.95	18.62	206,608.25	18.19	-

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 (%)
兴业证券	9,668,509.27	100.00	62,359,000.00	100.00	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22

3	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 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	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧中证 500 指数增强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	中欧中证 500 指数增强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、中欧中证 500 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧中证 500 指数增强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