

中欧量化先锋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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰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	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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化先锋混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化先锋混合	
基金主代码	014995	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 16 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	251,139,562.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
下属分级基金的交易代码	014995	014996
报告期末下属分级基金的份额总额	114,524,249.54 份	136,615,313.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金还可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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95597
传真	021-33830351	025-83387215
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆	江苏省南京市江东中路 228 号

	家嘴环路 479 号 8 层	
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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	200120	210009
法定代表人	窦玉明	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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)	
	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
本期已实现收益	-8,285,305.13	-10,606,210.44
本期利润	-8,644,923.95	-10,902,510.65
加权平均基金份 额本期利润	-0.0709	-0.0741
本期加权平均净 值利润率	-9.02%	-9.54%
本期基金份额净 值增长率	-8.14%	-8.41%
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	-26,762,127.82	-33,406,933.20
期末可供分配基 金份额利润	-0.2337	-0.2445

期末基金资产净值	87,762,121.72	103,208,380.13
期末基金份额净值	0.7663	0.7555
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	-23.37%	-24.45%

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

中欧量化先锋混合 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	-3.80%	0.78%	-4.73%	0.65%	0.93%	0.13%
过去三个月	-3.50%	0.90%	-4.62%	0.85%	1.12%	0.05%
过去六个月	-8.14%	1.20%	-6.51%	1.08%	-1.63%	0.12%
过去一年	-17.45%	1.03%	-13.76%	0.91%	-3.69%	0.12%
自基金合同生效起至今	-23.37%	1.01%	-21.96%	0.95%	-1.41%	0.06%

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

中欧量化先锋混合 C

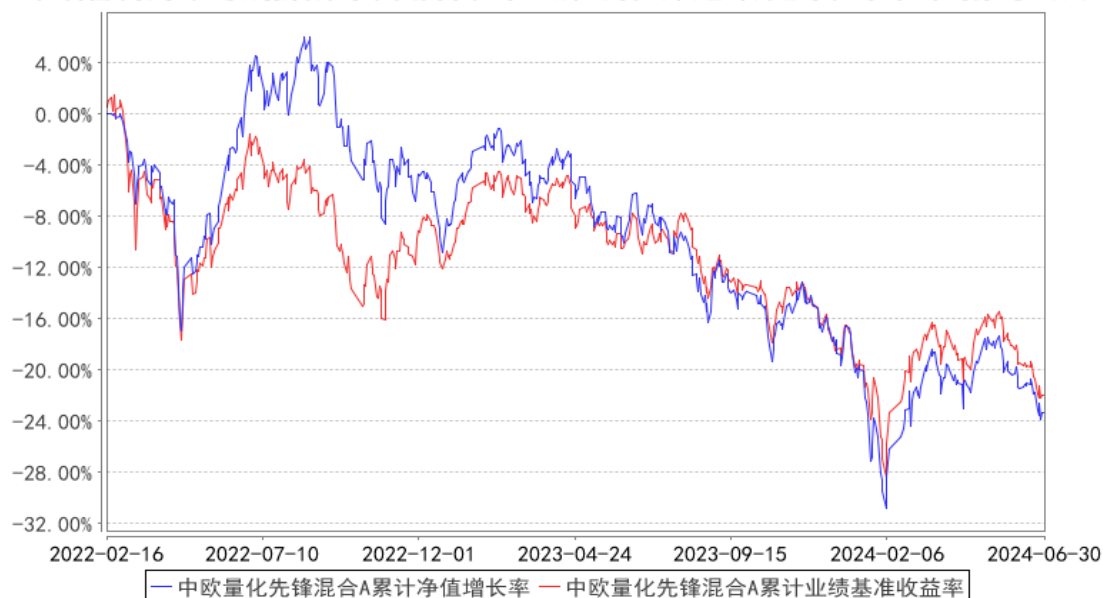
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.84%	0.77%	-4.73%	0.65%	0.89%	0.12%

过去三个月	-3.64%	0.90%	-4.62%	0.85%	0.98%	0.05%
过去六个月	-8.41%	1.20%	-6.51%	1.08%	-1.90%	0.12%
过去一年	-17.94%	1.03%	-13.76%	0.91%	-4.18%	0.12%
自基金合同生效起 至今	-24.45%	1.01%	-21.96%	0.95%	-2.49%	0.06%

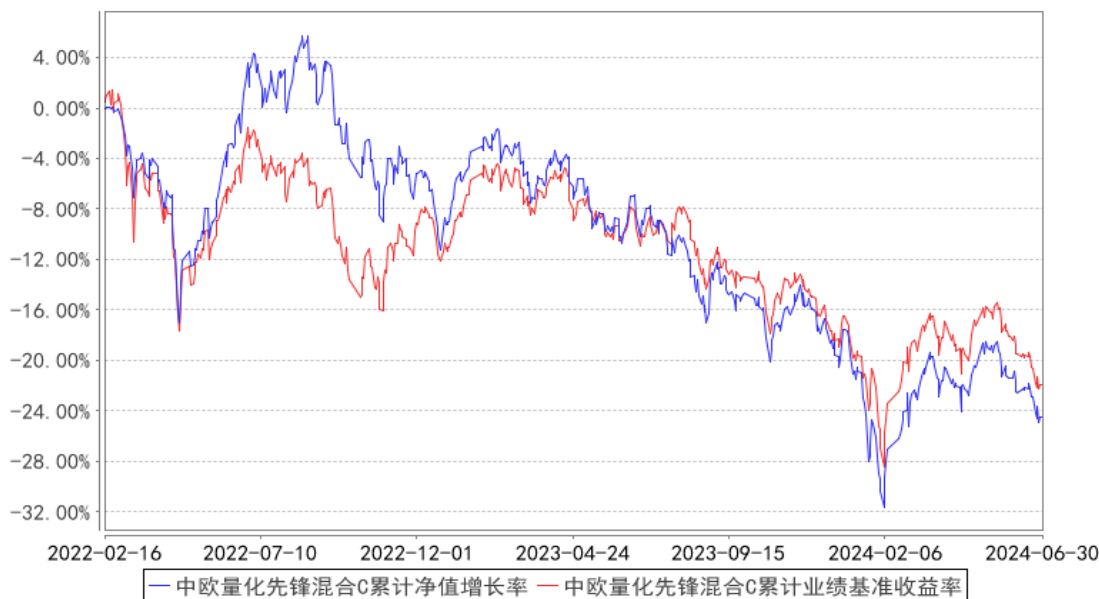
注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧量化先锋混合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



中欧量化先锋混合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		
钱亚婷	基金经理	2022-04-12	-	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。
曲径	量化投资总监 / 基金经理 /	2022-02-16	-	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

	投资经理				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，我们以偏股混合型基金的数量化特征作为抓手，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、另类数据因子和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-8.14%，同期业绩比较基准收益率为-6.51%；基金 C 类份额净值增长率为-8.41%，同期业绩比较基准收益率为-6.51%。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人—华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对中欧量化先锋混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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：中欧量化先锋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	31,889,468.34	19,242,517.84
结算备付金		1,055,160.35	1,132,741.96
存出保证金		934,848.00	418,867.20
交易性金融资产	6.4.7.2	157,256,900.69	222,873,357.19
其中：股票投资		157,256,900.69	222,873,357.19
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		170,605.72	18,225.80

应收申购款		30,184.41	36,669.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		191,337,167.51	243,722,379.54
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		2,535.20	-
应付赎回款		7,643.80	80,227.04
应付管理人报酬		193,775.05	248,782.67
应付托管费		24,221.87	31,097.84
应付销售服务费		52,181.38	67,648.87
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	86,308.36	50,000.00
负债合计		366,665.66	477,756.42
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	251,139,562.87	293,367,252.63
未分配利润	6.4.7.8	-60,169,061.02	-50,122,629.51
净资产合计		190,970,501.85	243,244,623.12
负债和净资产总计		191,337,167.51	243,722,379.54

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 251,139,562.87 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.7663 元，基金份额总额 114,524,249.54 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.7555 元，基金份额总额 136,615,313.33 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化先锋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 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
一、营业总收入		-17,700,269.69	8,733,036.64
1. 利息收入		63,673.04	298,967.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	63,673.04	100,530.39
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		-	198,436.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,109,743.51	-3,220,210.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-20,052,939.28	-6,325,442.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	163,147.94
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	983,980.03	879,344.89
股利收益	6.4.7.14	1,959,215.74	2,062,739.51
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	-655,919.03	11,193,916.45
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	1,719.81	460,363.50
减：二、营业总支出		1,847,164.91	3,368,177.33
1. 管理人报酬		1,252,351.68	2,469,742.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		156,543.90	246,974.22
3. 销售服务费		340,473.78	543,972.53
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		3,557.46	3,789.38
8. 其他费用	6.4.7.18	94,238.09	103,698.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,547,434.60	5,364,859.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,547,434.60	5,364,859.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,547,434.60	5,364,859.31

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化先锋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	293,367,252.63	-	-50,122,629.51	243,244,623.12
二、本期期初净资产	293,367,252.63	-	-50,122,629.51	243,244,623.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-42,227,689.76	-	-10,046,431.51	-52,274,121.27
（一）、综合收益总额	-	-	-19,547,434.60	-19,547,434.60
（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)	-42,227,689.76	-	9,501,003.09	-32,726,686.67
其中：1. 基金申购款	6,672,261.35	-	-1,401,124.41	5,271,136.94
2. 基金赎回款	-48,899,951.11	-	10,902,127.50	-37,997,823.61
（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	251,139,562.87	-	-60,169,061.02	190,970,501.85
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	360,484,579.97	-	-31,919,367.36	328,565,212.61
二、本期期初净资产	360,484,579.97	-	-31,919,367.36	328,565,212.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,532,199.96	-	6,663,245.89	-20,868,954.07

(一)、综合收益总额	-	-	5,364,859.31	5,364,859.31
(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)	-27,532,199.96	-	1,298,386.58	-26,233,813.38
其中：1. 基金申购款	149,879,573.07	-	-7,597,161.77	142,282,411.30
2. 基金赎回款	-177,411,773.03	-	8,895,548.35	-168,516,224.68
(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	332,952,380.01	-	-25,256,121.47	307,696,258.54

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

中欧量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]78 号文《关于准予中欧量化先锋混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化先锋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 669,842,619.14 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_B15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化先锋混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 2 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 669,882,390.06 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 39,770.92 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 261,184,433.19 份，包含认购利息折合

18,989.03 份；C 类基金的基金份额总额为 408,697,956.87 份，包含认购利息折合 20,781.89 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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化先锋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、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。

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%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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	874,704.08
等于：本金	874,333.10
加：应计利息	370.98
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	31,014,764.26
等于：本金	31,012,965.56
加：应计利息	1,798.70
减：坏账准备	-
合计	31,889,468.34

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	162,713,568.83	-	157,256,900.69	-5,456,668.14
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	162,713,568.83	-	157,256,900.69	-5,456,668.14

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	8,489,460.00	-	-	-
其中：股 指期货 投资	8,489,460.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	8,489,460.00	-	-	-

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
IF2409	IF2409	2.00	2,054,160.00	-7,380.00
IM2409	IM2409	6.00	5,736,240.00	-691,680.00
合计				-699,060.00
减：可抵销期货暂收款				-699,060.00
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述，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	1,773.00
合计	86,308.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	133,587,730.44	133,587,730.44
本期申购	1,037,864.10	1,037,864.10
本期赎回 (以“-”号填列)	-20,101,345.00	-20,101,345.00
本期末	114,524,249.54	114,524,249.54

中欧量化先锋混合 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	159,779,522.19	159,779,522.19
本期申购	5,634,397.25	5,634,397.25
本期赎回 (以“-”号填列)	-28,798,606.11	-28,798,606.11
本期末	136,615,313.33	136,615,313.33

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

中欧量化先锋混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,171,147.86	-5,972,200.00	-22,143,347.86
本期期初	-16,171,147.86	-5,972,200.00	-22,143,347.86
本期利润	-8,285,305.13	-359,618.82	-8,644,923.95
本期基金份额交易产生的变动数	3,221,651.20	804,492.79	4,026,143.99
其中：基金申购款	-193,543.83	-27,330.14	-220,873.97
基金赎回款	3,415,195.03	831,822.93	4,247,017.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,234,801.79	-5,527,326.03	-26,762,127.82

中欧量化先锋混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,873,941.61	-7,105,340.04	-27,979,281.65
本期期初	-20,873,941.61	-7,105,340.04	-27,979,281.65
本期利润	-10,606,210.44	-296,300.21	-10,902,510.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,620,636.45	854,222.65	5,474,859.10
其中：基金申购款	-1,111,155.44	-69,095.00	-1,180,250.44
基金赎回款	5,731,791.89	923,317.65	6,655,109.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,859,515.60	-6,547,417.60	-33,406,933.20

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	6,838.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	45,841.27
结算备付金利息收入	10,993.62
其他	-
合计	63,673.04

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	826,290,131.10
减：卖出股票成本总额	844,924,265.28
减：交易费用	1,418,805.10
买卖股票差价收入	-20,052,939.28

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	983,980.03

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	1,959,215.74
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,959,215.74

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	-69,699.03
股票投资	-69,699.03
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-586,220.00
权证投资	-
期货投资	-586,220.00
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	-655,919.03

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	1,719.81
合计	1,719.81

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
证券组合费	702.73
合计	94,238.09

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、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 （%）
华泰证券	1,202,383,021.52	74.93	2,348,524,004.10	73.53

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 (%)
华泰证券	-	-	1,365,300,000.00	66.80

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 (%)
华泰证券	631,651.39	75.28	-	-
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 (%)
华泰证券	1,225,937.87	73.74	-	-

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	1,252,351.68
其中：应支付销售机构的客户维护 费	523,106.07	1,007,971.94
应支付基金管理人的净管理费	729,245.61	1,461,770.41

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的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。

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	156,543.90	246,974.22

注：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。

6.4.10.2.3 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		
	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C	合计
华泰证券	0.00	250,273.00	250,273.00
中欧财富	0.00	533.09	533.09
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	250,806.09	250,806.09
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		

	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C	合计
华泰证券	0.00	371,521.88	371,521.88
中欧财富	0.00	809.09	809.09
中欧基金	0.00	8,965.30	8,965.30
合计	0.00	381,296.27	381,296.27

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

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

中欧量化先锋混合 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	1,178,146.79	1.03%	1,178,146.79	0.88%
-------	--------------	-------	--------------	-------

份额单位：份

中欧量化先锋混合 C

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	-	-	75,218.21	0.05%

注：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。

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
华泰证券股份有限公司	874,704.08	6,838.15	1,991,906.36	22,868.60

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰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
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	182	3,090.36	2,453.36	-
001387	雪	2024	6个月	新股	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-

	祺电气	2024年1月4日		流通受限						
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	192	3,346.56	6,635.52	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
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	470	5,583.60	8,920.60	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	122	5,483.90	8,043.46	-
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	70.59	188.01	462	32,610.73	86,860.62	-
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	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	315	5,103.00	5,027.40	-

	份									
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	101	2,149.28	2,978.49	-
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	888	16,561.20	16,561.20	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	99	1,846.35	1,846.35	-
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	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	127	2,435.86	2,877.82	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	66	2,519.88	2,567.40	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	87	2,031.45	2,186.31	-
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	311	7,047.26	4,941.79	-
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	74	6,435.04	12,944.82	-
688695	中	2024	6个月	新股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

	创 股 份	年 3 月 6 日		流 通 受 限						
--	-------------	--------------	--	------------------	--	--	--	--	--	--

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。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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	31,889,468.34	-	-	-	31,889,468.34
结算备付金	1,055,160.35	-	-	-	1,055,160.35
存出保证金	-	-	-	934,848.00	934,848.00
交易性金融资产	-	-	-	157,256,900.69	157,256,900.69
应收股利	-	-	-	170,605.72	170,605.72
应收申购款	-	-	-	30,184.41	30,184.41
资产总计	32,944,628.69	-	-	158,392,538.82	191,337,167.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,643.80	7,643.80
应付管理人报酬	-	-	-	193,775.05	193,775.05

应付托管费	-	-	-	24,221.87	24,221.87
应付清算款	-	-	-	2,535.20	2,535.20
应付销售服务费	-	-	-	52,181.38	52,181.38
其他负债	-	-	-	86,308.36	86,308.36
负债总计	-	-	-	366,665.66	366,665.66
利率敏感度缺口	32,944,628.69	-	-	-158,025,873.16	190,970,501.85
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	19,242,517.84	-	-	-	19,242,517.84
结算备付金	1,132,741.96	-	-	-	1,132,741.96
存出保证金	-	-	-	418,867.20	418,867.20
交易性金融资产	-	-	-	-222,873,357.19	222,873,357.19
应收股利	-	-	-	18,225.80	18,225.80
应收申购款	-	-	-	36,669.55	36,669.55
资产总计	20,375,259.80	-	-	-223,347,119.74	243,722,379.54
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	80,227.04	80,227.04
应付管理人报酬	-	-	-	248,782.67	248,782.67
应付托管费	-	-	-	31,097.84	31,097.84
应付销售服务费	-	-	-	67,648.87	67,648.87
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	477,756.42	477,756.42
利率敏感度缺口	20,375,259.80	-	-	-222,869,363.32	243,244,623.12

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 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	12,901,952.97	-	12,901,952.97
应收股利	-	170,605.72	-	170,605.72
资产合计	-	13,072,558.69	-	13,072,558.69
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,072,558.69	-	13,072,558.69
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	16,729,162.83	-	16,729,162.83
应收股利	-	18,225.80	-	18,225.80
资产合计	-	16,747,388.63	-	16,747,388.63
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	16,747,388.63	-	16,747,388.63

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
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）
	港币相对人民币贬	-653,627.93	-837,369.43

	值 5%		
	港币相对人民币升值 5%	653,627.93	837,369.43

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	157,256,900.69	82.35	222,873,357.19	91.63
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	157,256,900.69	82.35	222,873,357.19	91.63

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%	10,262,021.59	13,250,602.38
	业绩比较基准下降	-10,262,021.59	-13,250,602.38

	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	157,016,338.68	222,037,578.59
第二层次	18,407.55	141,616.00
第三层次	222,154.46	694,162.60
合计	157,256,900.69	222,873,357.19

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	157,256,900.69	82.19
	其中：股票	157,256,900.69	82.19
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	32,944,628.69	17.22
8	其他各项资产	1,135,638.13	0.59
9	合计	191,337,167.51	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 12,901,952.97 元，占基金资产净值比例 6.76%。

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	1,531,750.00	0.80
B	采矿业	6,404,779.00	3.35
C	制造业	105,849,591.01	55.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,951,425.52	2.59
E	建筑业	3,534,095.00	1.85
F	批发和零售业	1,124,460.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,566,169.00	0.82

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,866,857.29	4.64
J	金融业	6,596,883.00	3.45
K	房地产业	1,356,671.00	0.71
L	租赁和商务服务业	1,187,107.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	118,195.40	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,498.50	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,242,466.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	144,354,947.72	75.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	9,145.05	0.00
消费者非必需品	4,146,257.78	2.17
消费者常用品	845,296.84	0.44
能源	-	-
金融	2,729,072.92	1.43
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	1,654,748.16	0.87
电信服务	2,905,389.01	1.52
公用事业	612,043.21	0.32
地产业	-	-
合计	12,901,952.97	6.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	01211	比亚迪股份	14,000	2,964,384.64	1.55
1	002594	比亚迪	2,500	625,625.00	0.33
2	00700	腾讯控股	5,200	1,767,386.57	0.93
3	601636	旗滨集团	237,300	1,530,585.00	0.80
4	01024	快手-W	26,800	1,128,820.88	0.59
5	01398	工商银行	183,000	774,974.84	0.41
5	601398	工商银行	54,100	308,370.00	0.16
6	601601	中国太保	37,900	1,055,894.00	0.55
7	688408	中信博	11,432	1,052,658.56	0.55

8	002601	龙佰集团	56,100	1,041,777.00	0.55
9	000975	山金国际	61,900	1,008,351.00	0.53
10	01810	小米集团-W	67,000	1,007,744.75	0.53
11	002463	沪电股份	26,400	963,600.00	0.50
12	000568	泸州老窖	6,200	889,638.00	0.47
13	02367	巨子生物	20,200	845,296.84	0.44
14	01288	农业银行	174,000	530,413.11	0.28
14	601288	农业银行	70,500	307,380.00	0.16
15	300413	芒果超媒	39,300	821,370.00	0.43
16	600183	生益科技	38,600	812,916.00	0.43
17	300394	天孚通信	9,080	802,853.60	0.42
18	00939	建设银行	88,000	463,422.40	0.24
18	601939	建设银行	41,500	307,100.00	0.16
19	000550	江铃汽车	35,200	764,192.00	0.40
20	000651	格力电器	19,300	756,946.00	0.40
21	03328	交通银行	82,000	458,767.73	0.24
21	601328	交通银行	37,800	282,366.00	0.15
22	003000	劲仔食品	61,200	737,460.00	0.39
23	002371	北方华创	2,300	735,747.00	0.39
24	600970	中材国际	60,400	728,424.00	0.38
25	03690	美团-W	7,180	728,043.01	0.38
26	601800	中国交建	80,000	715,200.00	0.37
27	03968	招商银行	15,500	501,494.84	0.26
27	600036	招商银行	5,900	201,721.00	0.11
28	000423	东阿阿胶	11,200	701,120.00	0.37
29	601899	紫金矿业	38,200	671,174.00	0.35
30	603383	顶点软件	19,980	640,758.60	0.34
31	688278	特宝生物	11,854	634,781.70	0.33
32	300926	博俊科技	31,560	631,831.20	0.33
33	600989	宝丰能源	36,200	627,346.00	0.33
34	601058	赛轮轮胎	44,800	627,200.00	0.33
35	601857	中国石油	60,400	623,328.00	0.33
36	002572	索菲亚	40,600	622,398.00	0.33
37	688253	英诺特	16,125	614,523.75	0.32
38	688510	航亚科技	33,282	612,721.62	0.32
39	00836	华润电力	28,000	612,043.21	0.32
40	301498	乖宝宠物	11,200	602,560.00	0.32
41	000883	湖北能源	100,000	601,000.00	0.31
42	603992	松霖科技	32,200	592,158.00	0.31
43	600435	北方导航	68,600	591,332.00	0.31
44	600938	中国海油	17,900	590,700.00	0.31
45	600186	莲花控股	171,600	588,588.00	0.31
46	688099	晶晨股份	9,909	587,801.88	0.31

47	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.31
48	300870	欧陆通	13,500	585,630.00	0.31
49	000333	美的集团	9,000	580,500.00	0.30
50	300693	盛弘股份	27,500	575,850.00	0.30
51	688581	安杰思	11,597	567,441.21	0.30
52	000425	徐工机械	78,800	563,420.00	0.30
53	688772	珠海冠宇	37,400	557,260.00	0.29
54	300308	中际旭创	3,980	548,762.40	0.29
55	601233	桐昆股份	34,300	547,428.00	0.29
56	300750	宁德时代	3,000	540,090.00	0.28
57	001979	招商蛇口	61,100	537,069.00	0.28
58	688036	传音控股	6,960	532,718.40	0.28
59	601717	郑煤机	35,500	525,400.00	0.28
60	600011	华能国际	54,500	524,290.00	0.27
61	300760	迈瑞医疗	1,800	523,638.00	0.27
62	002318	久立特材	21,900	510,927.00	0.27
63	688012	中微公司	3,609	509,807.34	0.27
64	002273	水晶光电	30,000	509,400.00	0.27
65	300502	新易盛	4,700	496,085.00	0.26
66	603198	迎驾贡酒	8,500	488,750.00	0.26
67	002415	海康威视	15,800	488,378.00	0.26
68	600801	华新水泥	35,400	486,750.00	0.25
69	300395	菲利华	15,800	485,850.00	0.25
70	688578	艾力斯	7,600	484,424.00	0.25
71	002475	立讯精密	12,300	483,513.00	0.25
72	000729	燕京啤酒	54,400	480,352.00	0.25
73	002608	江苏国信	61,900	479,725.00	0.25
74	002928	华夏航空	75,300	477,402.00	0.25
75	002028	思源电气	7,100	474,990.00	0.25
76	002984	森麒麟	19,500	469,755.00	0.25
77	002001	新和成	24,300	466,560.00	0.24
78	603589	口子窖	11,800	462,442.00	0.24
79	000951	中国重汽	32,200	461,104.00	0.24
80	300003	乐普医疗	31,000	460,040.00	0.24
81	688276	百克生物	16,200	459,594.00	0.24
82	601318	中国平安	11,100	459,096.00	0.24
83	002182	宝武镁业	40,240	453,907.20	0.24
84	09992	泡泡玛特	13,000	453,830.13	0.24
85	002532	天山铝业	55,100	446,861.00	0.23
86	688120	华海清科	2,357	446,840.06	0.23
87	603228	景旺电子	14,000	445,200.00	0.23
88	300251	光线传媒	52,800	444,048.00	0.23
89	688252	天德钰	30,200	438,806.00	0.23

90	300303	聚飞光电	90,100	437,886.00	0.23
91	600547	山东黄金	15,700	429,866.00	0.23
92	688008	澜起科技	7,515	429,557.40	0.22
93	600048	保利发展	48,800	427,488.00	0.22
94	688019	安集科技	3,370	423,946.00	0.22
95	601137	博威合金	27,800	423,672.00	0.22
96	300724	捷佳伟创	7,800	421,278.00	0.22
97	600941	中国移动	3,900	419,250.00	0.22
98	688484	南芯科技	11,300	419,230.00	0.22
99	600316	洪都航空	24,700	410,761.00	0.22
100	002322	理工能科	25,100	402,102.00	0.21
101	600312	平高电气	20,400	396,780.00	0.21
102	600529	山东药玻	15,500	392,770.00	0.21
103	301004	嘉益股份	4,300	391,300.00	0.20
104	688127	蓝特光学	21,199	389,849.61	0.20
105	002906	华阳集团	14,500	388,020.00	0.20
106	600038	中直股份	9,400	386,434.00	0.20
107	600760	中航沈飞	9,600	384,960.00	0.20
108	000409	云鼎科技	47,200	380,904.00	0.20
109	002083	孚日股份	87,500	370,125.00	0.19
110	300403	汉宇集团	53,900	368,137.00	0.19
111	688516	奥特维	8,800	367,928.00	0.19
112	605003	众望布艺	22,900	367,545.00	0.19
113	603283	赛腾股份	4,800	366,720.00	0.19
114	002683	广东宏大	18,200	366,366.00	0.19
115	688018	乐鑫科技	3,694	364,523.92	0.19
116	300181	佐力药业	24,100	364,392.00	0.19
117	300547	川环科技	22,200	362,970.00	0.19
118	300719	安达维尔	21,300	361,035.00	0.19
119	000032	深桑达 A	24,100	361,018.00	0.19
120	603267	鸿远电子	10,500	358,050.00	0.19
121	600309	万华化学	4,400	355,784.00	0.19
122	300001	特锐德	17,600	354,112.00	0.19
123	605319	无锡振华	20,000	354,000.00	0.19
124	002116	中国海诚	37,700	350,987.00	0.18
125	000403	派林生物	13,100	349,246.00	0.18
126	601668	中国建筑	64,800	344,088.00	0.18
127	605116	奥锐特	13,700	342,911.00	0.18
128	00992	联想集团	34,000	341,962.94	0.18
129	301345	涛涛车业	6,200	341,620.00	0.18
130	000521	长虹美菱	44,600	338,068.00	0.18
131	603501	韦尔股份	3,400	337,858.00	0.18
132	600988	赤峰黄金	20,500	334,970.00	0.18

133	002922	伊戈尔	15,300	334,458.00	0.18
134	600150	中国船舶	8,200	333,822.00	0.17
135	688147	微导纳米	13,332	331,966.80	0.17
136	600820	隧道股份	50,700	331,071.00	0.17
137	603725	天安新材	53,140	329,999.40	0.17
138	002027	分众传媒	54,300	329,058.00	0.17
139	002558	巨人网络	34,800	328,512.00	0.17
140	002452	长高电新	39,600	327,888.00	0.17
141	300853	申昊科技	22,400	325,696.00	0.17
142	600482	中国动力	16,700	325,316.00	0.17
143	000063	中兴通讯	11,550	323,053.50	0.17
144	601009	南京银行	30,900	321,051.00	0.17
145	002311	海大集团	6,800	319,940.00	0.17
146	601728	中国电信	51,700	317,955.00	0.17
147	603296	华勤技术	5,740	317,020.20	0.17
148	600160	巨化股份	13,100	316,103.00	0.17
149	001389	广合科技	7,092	315,548.52	0.17
150	000719	中原传媒	31,200	315,432.00	0.17
151	601766	中国中车	42,000	315,420.00	0.17
152	000960	锡业股份	20,300	314,447.00	0.16
153	000786	北新建材	10,600	314,396.00	0.16
154	002738	中矿资源	11,700	313,560.00	0.16
155	000682	东方电子	28,400	313,536.00	0.16
156	600418	江淮汽车	19,700	312,048.00	0.16
157	300373	扬杰科技	8,000	311,200.00	0.16
158	688180	君实生物	10,700	310,835.00	0.16
159	600483	福能股份	26,600	310,156.00	0.16
160	600845	宝信软件	9,700	309,721.00	0.16
161	300357	我武生物	15,300	309,366.00	0.16
162	601169	北京银行	52,800	308,352.00	0.16
163	300454	深信服	6,100	308,233.00	0.16
164	603606	东方电缆	6,300	307,503.00	0.16
165	002823	凯中精密	25,200	307,440.00	0.16
166	600900	长江电力	10,600	306,552.00	0.16
167	605166	聚合顺	29,200	306,308.00	0.16
168	002472	双环传动	13,900	306,078.00	0.16
169	000700	模塑科技	58,300	306,075.00	0.16
170	603225	新凤鸣	19,600	305,564.00	0.16
171	002048	宁波华翔	23,600	305,384.00	0.16
172	688728	格科微	25,200	305,172.00	0.16
173	002254	泰和新材	34,400	304,440.00	0.16
174	603556	海兴电力	6,500	304,395.00	0.16
175	603477	巨星农牧	10,600	304,220.00	0.16

176	688369	致远互联	19,300	303,589.00	0.16
177	300415	伊之密	14,600	303,388.00	0.16
178	601168	西部矿业	16,900	303,355.00	0.16
179	688676	金盘科技	5,814	303,200.10	0.16
180	688575	亚辉龙	13,000	303,160.00	0.16
181	002643	万润股份	30,300	303,000.00	0.16
182	605499	东鹏饮料	1,400	302,050.00	0.16
183	688188	柏楚电子	1,636	301,923.80	0.16
184	600489	中金黄金	20,400	301,920.00	0.16
185	603596	伯特利	7,760	301,864.00	0.16
186	600426	华鲁恒升	11,300	301,032.00	0.16
187	00268	金蝶国际	45,000	300,636.79	0.16
188	600000	浦发银行	36,400	299,572.00	0.16
189	600486	扬农化工	5,300	299,185.00	0.16
190	688308	欧科亿	15,400	299,068.00	0.16
191	603979	金诚信	5,900	298,127.00	0.16
192	688256	寒武纪	1,500	298,005.00	0.16
193	300973	立高食品	10,600	297,754.00	0.16
194	600096	云天化	15,300	297,126.00	0.16
195	300418	昆仑万维	9,200	296,608.00	0.16
196	300274	阳光电源	4,780	296,503.40	0.16
197	600276	恒瑞医药	7,652	294,295.92	0.15
198	600176	中国巨石	26,600	293,930.00	0.15
199	002993	奥海科技	7,900	293,880.00	0.15
200	688361	中科飞测	6,200	293,260.00	0.15
201	002648	卫星化学	16,300	293,074.00	0.15
202	002230	科大讯飞	6,800	292,060.00	0.15
203	600919	江苏银行	39,300	291,999.00	0.15
204	300408	三环集团	10,000	291,900.00	0.15
205	600378	昊华科技	10,100	291,890.00	0.15
206	002432	九安医疗	7,200	291,888.00	0.15
207	300458	全志科技	12,400	291,524.00	0.15
208	300498	温氏股份	14,700	291,354.00	0.15
209	002142	宁波银行	13,200	291,192.00	0.15
210	002353	杰瑞股份	8,300	291,164.00	0.15
211	601156	东航物流	14,300	291,005.00	0.15
212	002850	科达利	3,800	290,244.00	0.15
213	600536	中国软件	9,700	290,224.00	0.15
214	000426	兴业银锡	21,300	289,254.00	0.15
215	002179	中航光电	7,600	289,180.00	0.15
216	603040	新坐标	14,500	288,985.00	0.15
217	600066	宇通客车	11,200	288,960.00	0.15
218	000768	中航西飞	12,000	288,360.00	0.15

219	000938	紫光股份	12,900	288,315.00	0.15
220	600521	华海药业	16,900	288,145.00	0.15
221	002139	拓邦股份	27,100	287,802.00	0.15
222	002714	牧原股份	6,600	287,760.00	0.15
223	600694	大商股份	17,100	287,451.00	0.15
224	603087	甘李药业	6,200	287,184.00	0.15
225	605090	九丰能源	9,900	287,100.00	0.15
226	600487	亨通光电	18,200	287,014.00	0.15
227	600522	中天科技	18,100	286,885.00	0.15
228	300729	乐歌股份	18,500	286,565.00	0.15
229	301358	湖南裕能	9,100	286,286.00	0.15
230	002064	华峰化学	39,900	286,083.00	0.15
231	603538	美诺华	25,600	285,952.00	0.15
232	688123	聚辰股份	4,700	285,901.00	0.15
233	688349	三一重能	11,500	285,660.00	0.15
234	300679	电连技术	7,100	285,633.00	0.15
235	300105	龙源技术	44,100	284,886.00	0.15
236	300636	同和药业	28,000	284,760.00	0.15
237	002050	三花智控	14,900	284,292.00	0.15
238	300702	天宇股份	15,940	284,210.20	0.15
239	603816	顾家家居	8,800	284,152.00	0.15
240	600161	天坛生物	11,640	284,016.00	0.15
241	300285	国瓷材料	15,900	283,815.00	0.15
242	002755	奥赛康	29,400	283,710.00	0.15
243	600761	安徽合力	13,100	283,484.00	0.15
244	688639	华恒生物	3,700	282,643.00	0.15
245	601336	新华保险	9,400	282,282.00	0.15
246	003031	中瓷电子	6,100	282,064.00	0.15
247	002444	巨星科技	11,400	281,580.00	0.15
248	688981	中芯国际	6,100	281,210.00	0.15
249	600499	科达制造	33,300	280,719.00	0.15
250	000895	双汇发展	11,800	280,486.00	0.15
251	002752	昇兴股份	55,300	279,818.00	0.15
252	002487	大金重工	12,200	279,136.00	0.15
253	600975	新五丰	39,400	278,558.00	0.15
254	000529	广弘控股	47,300	278,124.00	0.15
255	603393	新天然气	8,000	277,920.00	0.15
256	601882	海天精工	12,100	277,211.00	0.15
257	600733	北汽蓝谷	34,300	277,144.00	0.15
258	601595	上海电影	14,000	276,920.00	0.15
259	601628	中国人寿	8,900	276,345.00	0.14
260	603229	奥翔药业	27,400	275,370.00	0.14
261	603899	晨光股份	8,800	275,264.00	0.14

262	600809	山西汾酒	1,300	274,144.00	0.14
263	002790	瑞尔特	30,268	273,320.04	0.14
264	600027	XD 华电国	39,300	272,742.00	0.14
265	600566	济川药业	8,600	272,706.00	0.14
266	000543	皖能电力	30,800	272,580.00	0.14
267	603055	台华新材	26,900	272,497.00	0.14
268	688698	伟创电气	10,100	272,397.00	0.14
269	300124	汇川技术	5,300	271,890.00	0.14
270	000600	建投能源	43,000	270,900.00	0.14
271	600031	三一重工	16,400	270,600.00	0.14
272	300033	同花顺	2,600	269,620.00	0.14
273	300633	开立医疗	6,800	269,144.00	0.14
274	601881	中国银河	24,700	268,242.00	0.14
275	688331	荣昌生物	6,200	267,840.00	0.14
276	002271	东方雨虹	21,700	267,778.00	0.14
277	300979	华利集团	4,400	267,740.00	0.14
278	688037	芯源微	3,000	267,000.00	0.14
279	688235	百济神州	2,300	266,432.00	0.14
280	605117	德业股份	3,580	266,137.20	0.14
281	601607	上海医药	13,900	265,629.00	0.14
282	300482	万孚生物	10,800	263,520.00	0.14
283	601138	工业富联	9,600	263,040.00	0.14
284	603179	新泉股份	6,700	262,908.00	0.14
285	300435	中泰股份	22,300	262,471.00	0.14
286	600559	老白干酒	14,400	261,792.00	0.14
287	603558	健盛集团	26,300	261,685.00	0.14
288	000400	许继电气	7,600	261,516.00	0.14
289	300638	广和通	15,200	259,920.00	0.14
290	601608	中信重工	67,700	257,937.00	0.14
291	002299	圣农发展	18,900	257,796.00	0.13
292	600298	安琪酵母	9,200	256,956.00	0.13
293	300034	钢研高纳	16,100	255,829.00	0.13
294	688366	昊海生科	4,140	255,355.20	0.13
295	002154	报喜鸟	46,600	253,504.00	0.13
296	300596	利安隆	9,300	252,309.00	0.13
297	000338	潍柴动力	15,500	251,720.00	0.13
298	000921	海信家电	7,800	251,472.00	0.13
299	601872	招商轮船	29,700	250,965.00	0.13
300	603300	华铁应急	45,900	250,614.00	0.13
301	601669	中国电建	44,800	250,432.00	0.13
302	000807	云铝股份	18,500	249,935.00	0.13
303	688498	源杰科技	1,900	248,881.00	0.13
304	002465	海格通信	24,000	248,640.00	0.13

305	600642	申能股份	28,100	248,123.00	0.13
306	300014	亿纬锂能	6,200	247,504.00	0.13
307	000758	中色股份	48,600	246,888.00	0.13
308	688002	睿创微纳	8,795	245,996.15	0.13
309	002043	兔宝宝	23,700	245,769.00	0.13
310	300401	花园生物	17,100	245,214.00	0.13
310	600755	厦门国贸	34,200	245,214.00	0.13
311	688443	智翔金泰	8,100	240,894.00	0.13
312	301033	迈普医学	6,100	238,571.00	0.12
313	002106	莱宝高科	21,400	233,260.00	0.12
314	601100	恒立液压	5,000	232,900.00	0.12
315	002152	广电运通	22,100	231,166.00	0.12
316	000528	柳工	20,600	230,514.00	0.12
317	603088	宁波精达	30,600	230,418.00	0.12
318	002831	裕同科技	9,000	230,310.00	0.12
319	603195	公牛集团	2,975	229,432.00	0.12
320	688658	悦康药业	12,800	228,352.00	0.12
321	688617	惠泰医疗	500	228,050.00	0.12
322	688138	清溢光电	10,600	227,900.00	0.12
323	002026	山东威达	27,400	227,420.00	0.12
324	605016	百龙创园	11,000	224,070.00	0.12
325	600550	保变电气	42,800	222,988.00	0.12
326	600875	东方电气	12,000	221,400.00	0.12
327	002063	远光软件	42,200	221,128.00	0.12
328	300915	海融科技	8,400	219,576.00	0.11
329	688301	奕瑞科技	1,900	218,937.00	0.11
330	002236	大华股份	14,100	217,986.00	0.11
331	000858	五粮液	1,700	217,668.00	0.11
332	603019	中科曙光	5,200	215,800.00	0.11
333	002422	科伦药业	7,100	215,343.00	0.11
334	002988	豪美新材	14,000	214,900.00	0.11
335	603995	甬金股份	12,100	211,992.00	0.11
336	300453	三鑫医疗	33,100	211,509.00	0.11
337	688266	泽璟制药	3,900	211,458.00	0.11
338	603993	洛阳钼业	24,800	210,800.00	0.11
339	000830	鲁西化工	18,000	208,620.00	0.11
340	688409	富创精密	5,616	207,455.04	0.11
341	688187	时代电气	4,200	207,396.00	0.11
342	603737	三棵树	5,700	206,739.00	0.11
343	601702	华峰铝业	11,300	206,338.00	0.11
344	300487	蓝晓科技	4,900	204,624.00	0.11
345	600572	康恩贝	45,700	204,279.00	0.11
346	000977	浪潮信息	5,600	203,672.00	0.11

347	601225	陕西煤业	7,900	203,583.00	0.11
348	600546	山煤国际	13,900	203,218.00	0.11
349	601888	中国中免	3,200	199,968.00	0.10
350	000690	宝新能源	39,200	199,920.00	0.10
351	601699	潞安环能	10,900	197,617.00	0.10
352	600373	中文传媒	13,300	197,372.00	0.10
353	002605	姚记科技	9,600	196,032.00	0.10
354	601838	成都银行	12,900	195,951.00	0.10
355	002847	盐津铺子	4,580	195,886.60	0.10
356	688029	南微医学	3,176	195,514.56	0.10
357	600873	梅花生物	19,400	194,388.00	0.10
358	688072	拓荆科技	1,616	194,097.76	0.10
359	600879	航天电子	24,600	191,142.00	0.10
360	600582	天地科技	27,700	190,853.00	0.10
361	000519	中兵红箭	12,900	189,243.00	0.10
362	601966	玲珑轮胎	10,200	187,374.00	0.10
363	002533	金杯电工	18,700	186,065.00	0.10
364	000887	中鼎股份	15,200	186,048.00	0.10
365	300685	艾德生物	10,500	185,220.00	0.10
366	600428	中远海特	30,100	184,212.00	0.10
367	603379	三美股份	4,700	183,958.00	0.10
368	002151	北斗星通	7,600	183,768.00	0.10
369	002557	洽洽食品	6,500	183,235.00	0.10
370	002833	弘亚数控	10,000	182,400.00	0.10
371	002423	中粮资本	24,100	180,509.00	0.09
372	600690	海尔智家	6,300	178,794.00	0.09
373	601117	中国化学	21,600	177,984.00	0.09
374	603605	珀莱雅	1,600	177,584.00	0.09
375	300194	福安药业	47,400	177,276.00	0.09
376	603368	柳药集团	10,100	176,750.00	0.09
377	000933	神火股份	8,700	176,001.00	0.09
378	688601	力芯微	4,000	174,760.00	0.09
379	603590	康辰药业	6,800	173,672.00	0.09
380	600866	星湖科技	31,000	171,120.00	0.09
381	601916	浙商银行	61,900	170,844.00	0.09
382	603486	科沃斯	3,600	169,848.00	0.09
383	002897	意华股份	4,500	169,470.00	0.09
384	600764	中国海防	8,600	168,818.00	0.09
385	688525	佰维存储	2,600	166,790.00	0.09
386	001309	德明利	1,870	161,568.00	0.08
387	601665	齐鲁银行	32,900	161,539.00	0.08
388	001965	招商公路	13,500	160,110.00	0.08
389	600916	中国黄金	16,500	158,730.00	0.08

390	688016	心脉医疗	1,600	156,880.00	0.08
391	601208	东材科技	21,000	152,460.00	0.08
392	600021	上海电力	15,400	152,306.00	0.08
393	002876	三利谱	6,300	151,956.00	0.08
394	603365	水星家纺	9,700	151,805.00	0.08
395	002430	杭氧股份	6,800	151,300.00	0.08
396	600557	康缘药业	9,600	150,720.00	0.08
397	002807	江阴银行	39,900	150,423.00	0.08
398	000034	神州数码	6,500	148,785.00	0.08
399	000893	亚钾国际	9,200	148,672.00	0.08
400	000155	川能动力	13,700	147,549.00	0.08
401	002519	银河电子	29,300	143,863.00	0.08
402	600157	永泰能源	121,700	143,606.00	0.08
403	301187	欧圣电气	5,900	143,075.00	0.07
404	002011	盾安环境	14,500	142,535.00	0.07
405	603809	豪能股份	17,600	142,208.00	0.07
406	002130	沃尔核材	10,000	141,200.00	0.07
407	301000	肇民科技	9,660	138,621.00	0.07
408	002245	蔚蓝锂芯	17,800	137,950.00	0.07
409	300896	爱美客	800	137,680.00	0.07
410	301219	腾远钴业	3,594	137,506.44	0.07
411	000928	中钢国际	24,000	133,200.00	0.07
412	601865	福莱特	6,500	130,650.00	0.07
413	603583	捷昌驱动	6,400	130,432.00	0.07
414	001914	招商积余	12,800	128,256.00	0.07
415	300623	捷捷微电	7,400	128,020.00	0.07
416	002244	滨江集团	17,200	124,872.00	0.07
417	002215	诺普信	16,600	123,670.00	0.06
418	002920	德赛西威	1,400	121,926.00	0.06
419	300790	宇瞳光学	9,000	121,500.00	0.06
420	600050	中国联通	25,400	119,380.00	0.06
421	002745	木林森	14,700	118,482.00	0.06
422	300857	协创数据	2,000	114,000.00	0.06
423	688348	昱能科技	1,900	112,100.00	0.06
424	000998	隆平高科	11,400	112,062.00	0.06
425	600114	东睦股份	7,400	106,486.00	0.06
426	300002	神州泰岳	13,000	105,560.00	0.06
427	000923	河钢资源	6,100	105,042.00	0.06
428	002997	瑞鹄模具	3,200	102,304.00	0.05
429	688798	艾为电子	1,800	101,916.00	0.05
430	601500	通用股份	18,900	100,926.00	0.05
431	002409	雅克科技	1,600	100,656.00	0.05
432	603348	文灿股份	3,600	99,684.00	0.05

433	600125	铁龙物流	16,400	97,908.00	0.05
434	600389	江山股份	6,900	97,359.00	0.05
435	300842	帝科股份	2,500	97,000.00	0.05
436	300396	迪瑞医疗	4,700	95,457.00	0.05
437	300031	宝通科技	6,600	94,842.00	0.05
438	301071	力量钻石	3,400	94,214.00	0.05
439	600197	伊力特	5,200	92,612.00	0.05
440	601369	陕鼓动力	11,500	92,230.00	0.05
441	300628	亿联网络	2,500	91,925.00	0.05
442	300708	聚灿光电	10,200	91,800.00	0.05
443	002968	新大正	10,300	91,773.00	0.05
444	300841	康华生物	1,800	91,152.00	0.05
445	603203	快克智能	3,800	89,604.00	0.05
446	688378	奥来德	3,780	88,678.80	0.05
447	301589	诺瓦星云	462	86,860.62	0.05
448	300566	激智科技	6,200	86,738.00	0.05
449	601528	瑞丰银行	18,300	86,376.00	0.05
450	002035	华帝股份	13,800	85,974.00	0.05
451	600887	伊利股份	3,200	82,688.00	0.04
452	000544	中原环保	10,500	82,635.00	0.04
453	300226	上海钢联	4,800	81,312.00	0.04
454	601633	长城汽车	3,200	80,960.00	0.04
455	603158	腾龙股份	11,400	80,256.00	0.04
456	603367	辰欣药业	5,700	79,458.00	0.04
457	603806	福斯特	5,320	78,204.00	0.04
458	002267	陕天然气	10,300	77,868.00	0.04
459	000581	威孚高科	4,500	73,260.00	0.04
460	002206	海利得	19,100	72,962.00	0.04
461	300589	江龙船艇	6,100	72,468.00	0.04
462	601577	长沙银行	8,800	71,984.00	0.04
463	002291	遥望科技	16,600	71,380.00	0.04
464	603337	杰克股份	2,700	71,064.00	0.04
465	688800	瑞可达	2,459	69,048.72	0.04
466	000589	贵州轮胎	13,100	66,417.00	0.03
467	301308	江波龙	700	66,318.00	0.03
468	002943	宇晶股份	3,200	66,144.00	0.03
469	600586	金晶科技	11,400	66,120.00	0.03
470	603733	仙鹤股份	3,700	65,046.00	0.03
471	300119	瑞普生物	4,700	64,014.00	0.03
472	600475	华光环能	7,200	62,712.00	0.03
473	603919	金徽酒	3,400	61,778.00	0.03
474	605555	德昌股份	3,300	61,413.00	0.03
475	601609	金田股份	10,700	60,562.00	0.03

476	002534	西子洁能	6,000	60,060.00	0.03
477	603258	电魂网络	3,700	59,755.00	0.03
478	300751	迈为股份	500	59,740.00	0.03
479	688332	中科蓝讯	1,005	59,284.95	0.03
480	688766	普冉股份	600	58,302.00	0.03
481	301280	珠城科技	1,500	58,200.00	0.03
482	603520	司太立	6,000	57,240.00	0.03
483	600420	国药现代	5,300	56,604.00	0.03
484	600737	中粮糖业	5,900	56,581.00	0.03
485	600346	恒力石化	4,000	55,800.00	0.03
486	300218	安利股份	3,700	55,796.00	0.03
487	603681	永冠新材	4,200	53,550.00	0.03
488	688380	中微半导	3,200	53,504.00	0.03
489	688226	威腾电气	2,900	50,692.00	0.03
490	300422	博世科	10,600	50,456.00	0.03
491	600933	爱柯迪	3,400	50,286.00	0.03
492	300457	赢合科技	2,800	49,924.00	0.03
493	000563	陕国投 A	17,700	48,675.00	0.03
494	601311	骆驼股份	6,000	48,120.00	0.03
495	002351	漫步者	3,600	47,340.00	0.02
496	002140	东华科技	6,100	47,275.00	0.02
497	603100	川仪股份	2,000	47,020.00	0.02
498	603867	新化股份	2,000	46,660.00	0.02
499	605507	国邦医药	2,800	46,620.00	0.02
500	300752	隆利科技	3,400	46,172.00	0.02
501	688028	沃尔德	2,700	44,361.00	0.02
502	301030	仕净科技	1,800	44,316.00	0.02
503	603025	大豪科技	3,200	44,224.00	0.02
504	600794	保税科技	13,900	44,063.00	0.02
505	688533	上声电子	1,700	43,979.00	0.02
506	300017	网宿科技	5,400	42,660.00	0.02
507	002403	爱仕达	6,400	42,368.00	0.02
508	002047	宝鹰股份	28,900	41,616.00	0.02
509	600662	外服控股	10,100	40,501.00	0.02
510	000906	浙商中拓	6,000	40,440.00	0.02
511	301327	华宝新能	700	40,110.00	0.02
512	300881	盛德鑫泰	1,500	38,535.00	0.02
513	603758	秦安股份	5,000	38,000.00	0.02
514	002111	威海广泰	3,600	37,512.00	0.02
515	601512	中新集团	4,900	37,338.00	0.02
516	001206	依依股份	2,800	36,456.00	0.02
517	300115	长盈精密	3,000	35,970.00	0.02
518	002088	鲁阳节能	2,900	35,061.00	0.02

519	603617	君禾股份	5,900	34,810.00	0.02
520	300687	赛意信息	2,500	34,800.00	0.02
521	688551	科威尔	1,100	34,650.00	0.02
522	603355	莱克电气	1,600	34,560.00	0.02
523	002911	佛燃能源	3,718	33,982.52	0.02
524	000404	长虹华意	6,300	33,579.00	0.02
525	002381	双箭股份	5,000	33,550.00	0.02
526	603035	常熟汽饰	2,600	32,968.00	0.02
527	600327	大东方	10,300	32,960.00	0.02
528	000680	山推股份	3,500	32,445.00	0.02
529	688257	新锐股份	2,100	32,193.00	0.02
530	603579	荣泰健康	2,060	31,847.60	0.02
531	688566	吉贝尔	1,400	31,500.00	0.02
532	000811	冰轮环境	3,200	30,880.00	0.02
533	300783	三只松鼠	1,400	30,618.00	0.02
534	002046	国机精工	3,000	30,510.00	0.02
535	002991	甘源食品	500	30,325.00	0.02
536	600516	方大炭素	7,000	30,170.00	0.02
537	002298	中电兴发	6,700	29,614.00	0.02
538	603324	盛剑环境	1,100	29,381.00	0.02
539	605183	确成股份	1,900	29,374.00	0.02
540	603239	浙江仙通	2,100	28,791.00	0.02
541	605007	五洲特纸	2,200	27,786.00	0.01
542	301206	三元生物	1,100	27,038.00	0.01
543	002062	宏润建设	7,600	26,448.00	0.01
544	601886	江河集团	5,400	26,352.00	0.01
545	688358	祥生医疗	1,000	25,970.00	0.01
546	002730	电光科技	3,600	25,344.00	0.01
547	301293	三博脑科	650	24,498.50	0.01
548	600332	白云山	800	23,464.00	0.01
549	300260	新莱应材	1,100	23,034.00	0.01
550	300573	兴齐眼药	140	22,960.00	0.01
551	301283	聚胶股份	800	22,696.00	0.01
552	002468	申通快递	2,600	21,840.00	0.01
553	603071	物产环能	1,700	21,301.00	0.01
554	605050	福然德	2,400	21,144.00	0.01
555	688371	菲沃泰	2,100	21,084.00	0.01
556	002008	大族激光	1,000	20,800.00	0.01
557	000683	远兴能源	3,000	20,730.00	0.01
558	600301	华锡有色	1,000	20,220.00	0.01
559	601566	九牧王	2,300	19,366.00	0.01
560	300253	卫宁健康	3,200	18,880.00	0.01
561	300005	探路者	3,700	18,537.00	0.01

562	002166	莱茵生物	2,700	18,468.00	0.01
563	603285	键邦股份	987	18,407.55	0.01
564	688162	巨一科技	900	17,532.00	0.01
565	605339	南侨食品	1,200	17,064.00	0.01
566	002017	东信和平	2,000	16,660.00	0.01
567	002138	顺络电子	600	16,476.00	0.01
568	002674	兴业科技	1,600	16,352.00	0.01
569	601952	苏垦农发	1,800	16,236.00	0.01
570	301356	天振股份	1,200	15,528.00	0.01
571	600746	江苏索普	2,600	15,314.00	0.01
572	301160	翔楼新材	400	14,900.00	0.01
573	603629	利通电子	800	14,768.00	0.01
574	002282	博深股份	2,200	14,058.00	0.01
575	603162	海通发展	1,500	13,950.00	0.01
576	603235	天新药业	572	13,745.16	0.01
577	000021	深科技	900	13,608.00	0.01
578	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
579	688692	达梦数据	74	12,944.82	0.01
580	688289	圣湘生物	700	12,306.00	0.01
581	300203	聚光科技	1,200	12,108.00	0.01
582	600262	北方股份	700	11,501.00	0.01
583	603173	福斯达	500	10,855.00	0.01
584	002916	深南电路	100	10,577.00	0.01
585	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
586	000042	中洲控股	2,500	9,875.00	0.01
587	00772	阅文集团	400	9,181.56	0.00
588	02099	中国黄金国际	200	9,145.05	0.00
589	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
590	301565	中仑新材	470	8,920.60	0.00
591	601098	中南传媒	700	8,694.00	0.00
592	301299	卓创资讯	200	8,400.00	0.00
593	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
594	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.00
595	301580	爱迪特	122	8,043.46	0.00
596	002595	豪迈科技	200	7,634.00	0.00
597	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
598	603160	汇顶科技	100	6,875.00	0.00
599	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
600	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
601	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
602	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
603	605305	中际联合	200	5,158.00	0.00
604	601033	永兴股份	315	5,027.40	0.00

605	301367	怡和嘉业	80	4,976.00	0.00
606	688584	上海合晶	311	4,941.79	0.00
607	02382	舜宇光学科技	100	4,403.68	0.00
608	002705	新宝股份	300	4,221.00	0.00
609	600221	海航控股	3,500	3,570.00	0.00
610	603082	北自科技	101	2,978.49	0.00
611	603344	星德胜	127	2,877.82	0.00
612	301391	卡莱特	65	2,845.70	0.00
613	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
614	603375	盛景微	66	2,567.40	0.00
615	603325	博隆技术	37	2,518.22	0.00
616	001379	腾达科技	182	2,453.36	0.00
617	600729	重庆百货	100	2,236.00	0.00
618	603381	永臻股份	87	2,186.31	0.00
619	002728	特一药业	96	744.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	01024	快手-W	6,708,073.54	2.76
2	01211	比亚迪股份	3,291,599.62	1.35
2	002594	比亚迪	1,443,085.00	0.59
3	000568	泸州老窖	3,638,355.00	1.50
4	03690	美团-W	3,622,858.01	1.49
5	300413	芒果超媒	3,192,975.00	1.31
6	01810	小米集团-W	2,870,023.08	1.18
7	002463	沪电股份	2,778,204.00	1.14
8	06862	海底捞	2,738,229.80	1.13
9	000651	格力电器	2,620,077.00	1.08
10	688072	拓荆科技	2,574,128.69	1.06
11	002371	北方华创	2,566,550.00	1.06
12	601328	交通银行	1,716,829.15	0.71
12	03328	交通银行	804,696.32	0.33
13	600123	兰花科创	2,519,179.06	1.04
14	601939	建设银行	1,672,004.00	0.69
14	00939	建设银行	808,555.43	0.33
15	601985	中国核电	2,444,886.00	1.01
16	688012	中微公司	2,439,532.56	1.00
17	603516	淳中科技	2,431,672.00	1.00
18	600039	四川路桥	2,379,357.00	0.98
19	601288	农业银行	1,319,587.00	0.54
19	01288	农业银行	1,036,423.09	0.43

20	300729	乐歌股份	2,323,081.00	0.96
----	--------	------	--------------	------

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	01024	快手-W	7,605,526.67	3.13
2	603516	淳中科技	3,720,076.00	1.53
3	600039	四川路桥	3,599,271.00	1.48
4	000568	泸州老窖	3,325,624.00	1.37
5	03690	美团-W	3,275,468.98	1.35
6	03993	洛阳钼业	2,617,139.04	1.08
6	603993	洛阳钼业	489,865.00	0.20
7	688072	拓荆科技	2,936,393.10	1.21
8	601985	中国核电	2,824,601.00	1.16
9	06862	海底捞	2,801,466.04	1.15
10	000932	华菱钢铁	2,726,892.00	1.12
11	688012	中微公司	2,592,201.41	1.07
12	600755	厦门国贸	2,536,888.00	1.04
13	600123	兰花科创	2,498,554.30	1.03
14	600674	川投能源	2,426,853.00	1.00
15	600985	淮北矿业	2,371,226.00	0.97
16	688169	石头科技	2,319,116.49	0.95
17	002463	沪电股份	2,314,080.00	0.95
18	601328	交通银行	1,917,493.00	0.79
18	03328	交通银行	370,884.48	0.15
19	600941	中国移动	2,284,187.00	0.94
20	601088	中国神华	2,271,149.00	0.93

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	779,377,507.81
卖出股票收入（成交）总额	826,290,131.10

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，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中，中国太平洋保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	934,848.00

2	应收清算款	-
3	应收股利	170,605.72
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,184.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,135,638.13

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧量化先锋混合 A	3,179	36,025.24	10,976,465.76	9.58%	103,547,783.78	90.42%
中欧量化先锋混合 C	17,312	7,891.37	1,155,573.41	0.85%	135,459,739.92	99.15%
合计	20,491	12,256.09	12,132,039.17	4.83%	239,007,523.70	95.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧量化先锋混合 A	1,178,146.79	1.03%
	中欧量化先锋混合 C	0.00	0.00%

	合计	1,178,146.79	0.47%
--	----	--------------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧量化先锋混合 A	>100
	中欧量化先锋混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化先锋混合 A	>100
	中欧量化先锋混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
基金合同生效日 (2022 年 2 月 16 日) 基金份额总额	261,184,433.19	408,697,956.87
本报告期期初基金份额总额	133,587,730.44	159,779,522.19
本报告期基金总申购份额	1,037,864.10	5,634,397.25
减：本报告期基金总赎回份额	20,101,345.00	28,798,606.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	114,524,249.54	136,615,313.33

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本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

本报告期内托管人及其高级管理人员无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 (%)	
华泰证券	4	1,202,383,021.52	74.93	631,651.39	75.28	-
中泰证券	3	402,337,182.77	25.07	207,440.05	24.72	-

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 (%)
华泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中泰证 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	中欧量化先锋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
2	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
3	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
4	中欧量化先锋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
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	中欧量化先锋混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧量化先锋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	中欧量化先锋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、中欧量化先锋混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化先锋混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化先锋混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化先锋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