

中欧量化动力混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司 根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	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等内容真实、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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60

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.....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
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.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化动力混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化动力混合	
基金主代码	015006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	352,206,140.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
下属分级基金的交 易代码	015006	015007
报告期末下属分级 基金的份额总额	176,556,867.73 份	175,649,272.36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	帅芳
	联系电话	021-68609600	021-38031815
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	021-38917599-5
传真		021-50190017	021-38677819
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	中国（上海）自由贸易试验区

	家嘴环路 479 号 8 层	商城路 618 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	竇玉明	朱健

注：因国泰君安证券股份有限公司换股吸收合并海通证券股份有限公司，本基金托管服务由国泰君安证券股份有限公司继续履行。同时，为更好地反映合并后的实际情况，自 2025 年 4 月 3 日起，原公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”，根据上述安排，本基金托管人法定名称同步变更为“国泰海通证券股份有限公司”，具体请见基金管理人前期发布的相关公告。

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(2025 年 1 月 1 日 – 2025 年 6 月 30 日)	
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
本期已实现收益	5, 203, 040. 45	5, 685, 446. 35
本期利润	6, 925, 087. 88	7, 645, 695. 19
加权平均基金份 额本期利润	0. 0424	0. 0425
本期加权平均净 值利润率	4. 42%	4. 51%
本期基金份额净 值增长率	7. 51%	7. 18%

3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-744,151.73	-4,212,758.08
期末可供分配基金份额利润	-0.0042	-0.0240
期末基金资产净值	175,812,716.00	171,436,514.28
期末基金份额净值	0.9958	0.9760
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.63%	-0.39%

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

中欧量化动力混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.21%	0.67%	3.36%	0.63%	0.85%	0.04%
过去三个月	3.02%	1.32%	2.36%	1.24%	0.66%	0.08%
过去六个月	7.51%	1.19%	4.44%	1.11%	3.07%	0.08%
过去一年	23.47%	1.43%	19.98%	1.34%	3.49%	0.09%
过去三年	-8.04%	1.14%	-4.28%	1.04%	-3.76%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.63%	1.14%	-7.41%	1.08%	9.04%	0.06%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根

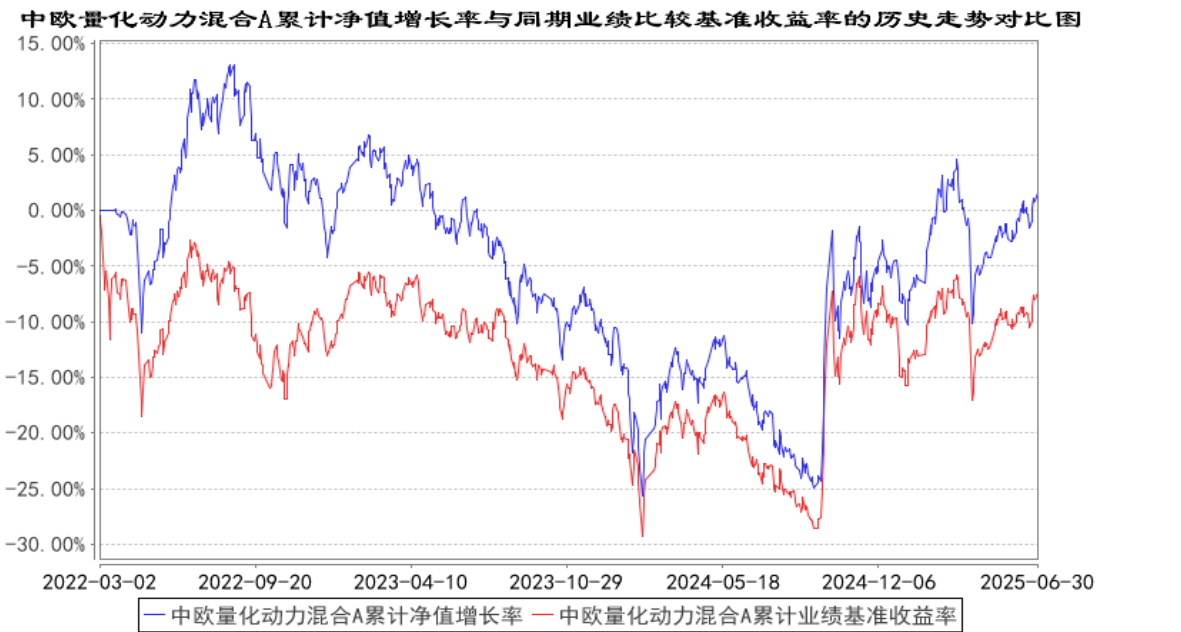
据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧量化动力混合 C

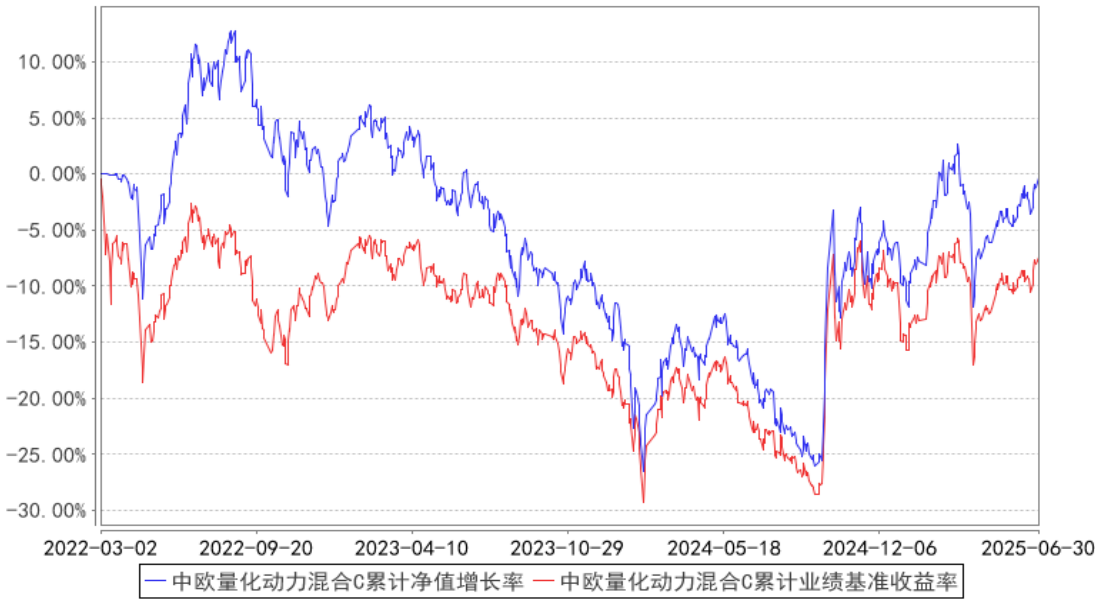
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①－③	②－④
过去一个月	4.14%	0.67%	3.36%	0.63%	0.78%	0.04%
过去三个月	2.86%	1.32%	2.36%	1.24%	0.50%	0.08%
过去六个月	7.18%	1.20%	4.44%	1.11%	2.74%	0.09%
过去一年	22.72%	1.43%	19.98%	1.34%	2.74%	0.09%
过去三年	-9.69%	1.14%	-4.28%	1.04%	-5.41%	0.10%
自基金合同生效 起至今	-0.39%	1.14%	-7.41%	1.08%	7.02%	0.06%

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

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



中欧量化动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 208 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2024-04-23	—	3 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
曲径	权益投决会委员 / 权益专户投决会委员 / 量化	2022-03-02	—	18 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

	投资总监 / 基金经 理 / 投资 经理				
--	-------------------------------	--	--	--	--

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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	2,689,451,479.32	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,885,092,107.13	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,574,543,586.45	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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 19 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

2025 年上半年，A 股呈现“震荡修复、结构分化”特征。宽基指数中北证 50、中证 1000 等中小盘指数延续强势，沪深 300 等大盘指数表现相对平淡。行业层面，TMT 板块受全球 AI 技术突破及国内新型工业化政策推动持续领涨，大金融与科技共同构成双主线，传统周期板块分化明显，有色金属受益于美联储降息预期下的黄金行情。分节奏来看，市场年初在政策预期驱动下震荡上行，中小盘成长风格占优，2 月春节因素致交投清淡但机器人、低空经济等主题活跃；随后在消化 3 月地缘冲突及 4 月美国对华加征关税冲击后，上证指数展现韧性逐步修复，5 月国内流动性改善与中美关税和解形成共振，金融、光模块等权重板块引领收复失地，6 月在地缘冲突与联储鸽派表态交织下，军工、银行等避险资产与 AI 产业链共同发力，北向资金上半年净流入显著，推动市场风险偏好回升。宏观层面，弱复苏背景下产业政策与外资流向主导行情，地缘风险与关税冲击等外部扰动逐步消退，景气赛道修复与权重板块发力共同塑造了“中小盘突围、政策护航”的格局，为下半年结构性行情铺垫基础。从大类因子来看的话，量价、成长、盈利预测类表现较优，价值和质量类表现相对逊色；从风格因子来看的话，小市值因子、低波动因子表现不错，估值、盈利、杠杆因子表现不佳。

在报告期内，本基金利用基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成投资组合，以达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对基准的超额收益。

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 7.51%，同期业绩比较基准收益率为 4.44%；基金 C 类份额净值增长率为 7.18%，同期业绩比较基准收益率为 4.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期地缘政治因素或许还会扰动市场节奏，引发阶段性波动。但当前中国市场估值处于低位区间，且在全球资产配置中仍处低配状态，配置性价比突出。面对外部环境压力，国内刺激消费、拉动内需的政策将为经济增长构筑支撑。但也需要保持谨慎的是，下半年部分高增长基数的行业或有增速回落的压力。此外，出口产业链中，海外库存较高的环节也可能受到全球关税压力传导而需求回落。因此，市场需要进一步挖掘结构性投资机会。从行业布局看，我们认为三大方向具备潜力：首先是科技成长领域，AI 产业已进入“硬件铺路、软件变现”的关键阶段，

重点关注估值合理的应用层企业，特别是具备垂直行业 know-how 的解决方案提供商。其次，传统周期行业迎来供给侧改革红利，部分化工、建材细分领域经过三年产能出清，行业集中度显著提升，在“整治内卷式竞争”政策指引下，头部优质企业盈利修复弹性可观。最后，消费行业中的“隐形冠军”值得长期布局，那些维持健康资产负债表、持续进行渠道优化的企业，一旦消费景气度回暖，将展现更强的业绩弹性。值得注意的是，这三个方向都符合“高质量增长”的转型主线，在估值洼地和政策催化双重作用下，有望成为引领市场复苏的重要引擎。基于市场特征演变，本基金将继续强化模型对市场的适配性，力争提升策略在延续波动环境中的超额收益挖掘能力。通过风控把控与模型优化的双向发力，助力量化策略在复杂市场中追求更稳健的表现。

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历。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

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧量化动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	48,011,339.33	28,965,081.14
结算备付金		2,502,426.31	2,785,787.33
存出保证金		700,687.20	-
交易性金融资产	6.4.7.2	300,651,279.48	200,461,747.97
其中：股票投资		300,651,279.48	200,461,747.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		293,800.35	-
应收申购款		33,916.87	23,927.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		352,193,449.54	232,236,544.33
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		3,897,589.49	36.41
应付赎回款		480,064.30	941,591.56
应付管理人报酬		349,801.16	243,211.75
应付托管费		43,725.14	30,401.49
应付销售服务费		88,233.84	63,170.96
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	84,805.33	50,000.00
负债合计		4,944,219.26	1,328,412.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	352,206,140.09	251,507,825.97
未分配利润	6.4.7.8	-4,956,909.81	-20,599,693.81
净资产合计		347,249,230.28	230,908,132.16
负债和净资产总计		352,193,449.54	232,236,544.33

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 352,206,140.09 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9958 元，基金份额总额 176,556,867.73 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9760 元，基金份额总额 175,649,272.36 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17,329,778.14	-24,869,354.86
1. 利息收入		88,704.27	75,363.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	88,704.27	75,363.59
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		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		13,496,538.67	-27,349,920.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,363,402.60	-30,447,817.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	19,637.26
资产支持证券投 资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	66,979.33	363,122.81
股利收益	6.4.7.14	4,066,156.74	2,715,136.88
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.15	3,682,296.27	2,365,720.11
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	62,238.93	39,481.71
减：二、营业总支出		2,758,995.07	2,556,832.06
1. 管理人报酬		1,922,484.58	1,775,380.05
2. 托管费		240,310.59	221,922.50
3. 销售服务费		499,317.37	461,402.41
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		1,807.09	3,563.17
8. 其他费用	6.4.7.18	95,075.44	94,563.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,570,783.07	-27,426,186.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,570,783.07	-27,426,186.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,570,783.07	-27,426,186.92

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	251,507,825.97	-	-20,599,693.81	230,908,132.16
二、本期期初净资产	251,507,825.97	-	-20,599,693.81	230,908,132.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	100,698,314.12	-	15,642,784.00	116,341,098.12
（一）、综合收益总额	-	-	14,570,783.07	14,570,783.07
（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）	100,698,314.12	-	1,072,000.93	101,770,315.05
其中：1. 基金申购款	257,937,571.82	-	-4,766,104.98	253,171,466.84
2. 基金赎回款	- 157,239,257.70	-	5,838,105.91	-151,401,151.79
（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	352,206,140.09	-	-4,956,909.81	347,249,230.28
项目	上年度可比期间 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	404,174,523.34	-	-51,965,226.59	352,209,296.75
二、本期期初净资产	404,174,523.34	-	-51,965,226.59	352,209,296.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-80,330,130.62	-	-12,642,425.60	-92,972,556.22
（一）、综合收益总额	-	-	-27,426,186.92	-27,426,186.92
（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）	-80,330,130.62	-	14,783,761.32	-65,546,369.30
其中：1. 基金申购款	50,438,412.03	-	-8,967,055.67	41,471,356.36
2. 基金赎回款	- 130,768,542.65	-	23,750,816.99	-107,017,725.66
（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	323,844,392.72	-	-64,607,652.19	259,236,740.53

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

基金管理人负责人

王音然

主管会计工作负责人

李宝林

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧量化动力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以

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

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

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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。

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征增值税试点的通知》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法》、《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[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[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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	467,539.73
等于：本金	467,012.22
加：应计利息	527.51
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	47,543,799.60
等于：本金	47,540,423.28
加：应计利息	3,376.32
减：坏账准备	-
合计	48,011,339.33

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 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	292,892,204.94	-	300,651,279.48	7,759,074.54
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	292,892,204.94	-	300,651,279.48	7,759,074.54

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 2025 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	5,520,780.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,520,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,520,780.00	-	-	-

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
IH2507	IH2507	1.00	807,540.00	21,480.00
IM2507	IM2507	4.00	5,031,520.00	296,800.00

合计				318,280.00
减：可抵销期货暂收款				318,280.00
净额				0.00

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.17
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	59,507.37
预提费用-审计费	24,795.19
其他应付	481.60
合计	84,805.33

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	120,750,762.56	120,750,762.56
本期申购	103,098,906.01	103,098,906.01

本期赎回（以“-”号填列）	-47,292,800.84	-47,292,800.84
本期末	176,556,867.73	176,556,867.73

中欧量化动力混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,757,063.41	130,757,063.41
本期申购	154,838,665.81	154,838,665.81
本期赎回（以“-”号填列）	-109,946,456.86	-109,946,456.86
本期末	175,649,272.36	175,649,272.36

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

中欧量化动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,462,324.99	-4,444,077.17	-8,906,402.16
本期期初	-4,462,324.99	-4,444,077.17	-8,906,402.16
本期利润	5,203,040.45	1,722,047.43	6,925,087.88
本期基金份额交易产生的变动数	827,783.90	409,378.65	1,237,162.55
其中：基金申购款	345,170.05	-359,309.04	-14,138.99
基金赎回款	482,613.85	768,687.69	1,251,301.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,568,499.36	-2,312,651.09	-744,151.73

中欧量化动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,882,042.02	-4,811,249.63	-11,693,291.65
本期期初	-6,882,042.02	-4,811,249.63	-11,693,291.65
本期利润	5,685,446.35	1,960,248.84	7,645,695.19
本期基金份额交易产生的变动数	-637,051.04	471,889.42	-165,161.62
其中：基金申购款	-3,456,769.67	-1,295,196.32	-4,751,965.99
基金赎回款	2,819,718.63	1,767,085.74	4,586,804.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,833,646.71	-2,379,111.37	-4,212,758.08

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,752.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	54,081.09

结算备付金利息收入	17,007.65
其他	3,863.11
合计	88,704.27

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,680,259,833.62
减：卖出股票成本总额	2,666,431,221.06
减：交易费用	4,465,209.96
买卖股票差价收入	9,363,402.60

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	66,979.33

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,066,156.74
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	4,066,156.74

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,364,016.27
股票投资	3,364,016.27
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	318,280.00
权证投资	-
期货投资	318,280.00
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	3,682,296.27

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	62,238.93
合计	62,238.93

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
证券组合费	1,762.56
存托服务费	10.32
合计	95,075.44

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

因国泰君安证券股份有限公司换股吸收合并海通证券股份有限公司，本基金托管服务由国泰君安证券股份有限公司继续履行。同时，为更好地反映合并后的实际情况，自 2025 年 4 月 3 日起，原公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”，根据上述安排，本基金托管人法定名称同步变更为“国泰海通证券股份有限公司”，具体请见基金管理人前期发布的相关公告。

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

注：以下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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
国泰海通	1,935,998,117.36	35.58	—	—
海通证券	—	—	855,103,804.17	34.40

注：因国泰君安证券股份有限公司换股吸收合并海通证券股份有限公司，本基金托管服务由国泰君安证券股份有限公司继续履行。同时，为更好地反映合并后的实际情况，自 2025 年 4 月 3 日起，原公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国泰海通	869,339.10	36.26	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 （%）
海通证券	452,560.17	34.56	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、因国泰君安证券股份有限公司换股吸收合并海通证券股份有限公司，本基金托管服务由国泰君安证券股份有限公司继续履行。同时，为更好地反映合并后的实际情况，自2025年4月3日起，原公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,922,484.58	1,775,380.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	561,962.48	711,831.20
应支付基金管理人的净管理费	1,360,522.10	1,063,548.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	240,310.59	221,922.50

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

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
国泰海通	0.00	129,772.35	129,772.35
中欧财富	0.00	2.20	2.20
中欧基金	0.00	128,174.30	128,174.30
合计	0.00	257,948.85	257,948.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	0.00	193,542.85	193,542.85
中欧财富	0.00	18.71	18.71

中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	193,561.56	193,561.56

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

2、因国泰君安证券股份有限公司换股吸收合并海通证券股份有限公司，本基金托管服务由国泰君安证券股份有限公司继续履行。同时，为更好地反映合并后的实际情况，自 2025 年 4 月 3 日起，原公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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固有资金投资本基金的情况

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

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

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	213,698.04	0.12%	213,698.04	0.18%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	17,285,494.22	23,923.46	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	19,506,482.20	23,246.03

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰海通证券股份有限公司 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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股流通受限	5.30	14.44	643	3,407.90	9,284.92	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	C信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	C信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	27.50	56.19	215	5,912.50	12,080.85	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股流通受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股流通受限	27.52	45.22	206	5,668.64	9,315.32	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优	2025年5	6个月	新股流通	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

	绿能	月 28 日		受限						
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	189	8,788.50	8,098.65	-
603072	天和	2024 年 12	6 个月	新股流通	12.30	54.45	206	2,533.80	11,216.70	-

	磁材	月 24 日		受限						
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	61	5,703.50	5,530.26	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	106	2,183.60	3,718.48	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	XD 汇通控	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	88	2,127.84	2,932.16	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	448	8,682.24	37,403.52	-
688545	兴福	2025 年 1	6 个月	新股流通	11.68	26.95	738	8,619.84	19,889.10	-

	电子	月 15 日		受限						
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	25.80	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	XD 胜科纳	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	326	15,410.02	40,476.16	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	6,900	238,665.41	262,545.00	-

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 2025 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 2025 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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 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 2025 年 6 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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 2025 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	48,011,339.33	-	-	-	48,011,339.33
结算备付金	2,502,426.31	-	-	-	2,502,426.31
存出保证金	-	-	-	700,687.20	700,687.20
交易性金融资产	-	-	-	300,651,279.48	300,651,279.48
应收股利	-	-	-	293,800.35	293,800.35
应收申购款	-	-	-	33,916.87	33,916.87
资产总计	50,513,765.64	-	-	301,679,683.90	352,193,449.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	480,064.30	480,064.30
应付管理人报酬	-	-	-	349,801.16	349,801.16
应付托管费	-	-	-	43,725.14	43,725.14
应付清算款	-	-	-	3,897,589.49	3,897,589.49
应付销售服务费	-	-	-	88,233.84	88,233.84
其他负债	-	-	-	84,805.33	84,805.33
负债总计	-	-	-	4,944,219.26	4,944,219.26
利率敏感度缺口	50,513,765.64	-	-	-296,735,464.64	347,249,230.28
上年度末 2024 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	28,965,081.14	-	-	-	28,965,081.14
结算备付金	2,785,787.33	-	-	-	2,785,787.33
交易性金融资产	-	-	-	200,461,747.97	200,461,747.97
应收申购款	-	-	-	23,927.89	23,927.89
资产总计	31,750,868.47	-	-	200,485,675.86	232,236,544.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	941,591.56	941,591.56
应付管理人报酬	-	-	-	243,211.75	243,211.75
应付托管费	-	-	-	30,401.49	30,401.49

应付清算款	-	-	-	36.41	36.41
应付销售服务费	-	-	-	63,170.96	63,170.96
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	1,328,412.17	1,328,412.17
利率敏感度缺口	31,750,868.47	-	-	-199,157,263.69	230,908,132.16

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 2025 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%（2024 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（2024 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 2025 年 6 月 30 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	-	54,802,702.36	-	54,802,702.36
应收股利	-	293,800.35	-	293,800.35
资产合计	-	55,096,502.71	-	55,096,502.71
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	55,096,502.71	-	55,096,502.71
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	-	40,502,412.42	-	40,502,412.42
资产合计	-	40,502,412.42	-	40,502,412.42
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	-	40,502,412.42	-	40,502,412.42

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	港币相对人民币贬值 5%	-2,754,825.14	-2,025,120.62
	港币相对人民币升值 5%	2,754,825.14	2,025,120.62

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	300,651,279.48	86.58	200,461,747.97	86.81
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	300,651,279.48	86.58	200,461,747.97	86.81

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	18,171,908.44	12,025,819.42
	业绩比较基准下降5%	-18,171,908.44	-12,025,819.42

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	300,001,516.08	199,918,922.59
第二层次	277,930.54	25,239.60

第三层次	371,832.86	517,585.78
合计	300,651,279.48	200,461,747.97

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 2025 年 8 月 29 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	300,651,279.48	85.37
	其中：股票	300,651,279.48	85.37
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	50,513,765.64	14.34
8	其他各项资产	1,028,404.42	0.29
9	合计	352,193,449.54	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 54,802,702.36 元，占基金资产净值比例 15.78%。

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	642,198.00	0.18
B	采矿业	10,463,732.00	3.01
C	制造业	156,168,486.00	44.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,326,273.40	1.25
E	建筑业	5,048,084.00	1.45
F	批发和零售业	7,075,702.70	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	5,464,783.00	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,729,590.14	4.82
J	金融业	27,329,451.52	7.87
K	房地产业	2,157,354.00	0.62
L	租赁和商务服务业	3,377,966.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	1,088,893.20	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	1,071,830.16	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	320,565.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,583,668.00	1.32
S	综合	-	-
	合计	245,848,577.12	70.80

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	2,320,060.07	0.67
消费者非必需品	12,788,569.42	3.68

消费者常用品	1,745,636.45	0.50
能源	3,107,893.69	0.90
金融	7,455,993.77	2.15
医疗保健	4,860,146.33	1.40
工业	2,419,115.18	0.70
信息技术	4,568,477.37	1.32
电信服务	13,256,743.57	3.82
公用事业	723,167.23	0.21
地产业	1,556,899.28	0.45
合计	54,802,702.36	15.78

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	00700	腾讯控股	28,900	13,256,743.57	3.82
2	03690	美团-W	51,310	5,863,056.96	1.69
3	600919	江苏银行	315,800	3,770,652.00	1.09
4	00388	香港交易所	9,500	3,628,284.27	1.04
5	600998	九州通	616,100	3,166,754.00	0.91
6	300777	中简科技	81,900	2,968,875.00	0.85
7	002414	高德红外	288,700	2,959,175.00	0.85
8	300017	网宿科技	275,800	2,956,576.00	0.85
9	002056	横店东磁	208,605	2,951,760.75	0.85
10	300684	中石科技	123,600	2,951,568.00	0.85
11	00981	中芯国际	72,000	2,935,019.88	0.85
12	002249	大洋电机	444,700	2,926,126.00	0.84
13	600166	福田汽车	1,079,700	2,925,987.00	0.84
14	300014	亿纬锂能	63,300	2,899,773.00	0.84
15	301510	固高科技	95,400	2,866,770.00	0.83
16	002913	奥士康	95,900	2,820,419.00	0.81
17	601208	东材科技	297,300	2,818,404.00	0.81
18	688582	芯动联科	41,400	2,782,080.00	0.80
19	601138	工业富联	129,900	2,777,262.00	0.80
20	002624	完美世界	181,600	2,754,872.00	0.79
21	000988	华工科技	58,500	2,750,085.00	0.79
22	600499	科达制造	278,800	2,732,240.00	0.79
23	002701	奥瑞金	456,100	2,713,795.00	0.78
24	002706	良信股份	303,400	2,703,294.00	0.78
25	000975	山金国际	139,400	2,640,236.00	0.76
26	601319	中国人保	302,200	2,632,162.00	0.76
27	002080	中材科技	133,400	2,601,300.00	0.75

28	06181	老铺黄金	2,800	2,573,887.68	0.74
29	600873	梅花生物	232,900	2,489,701.00	0.72
30	601456	国联民生	160,700	1,663,245.00	0.48
30	01456	国联民生	202,500	797,773.86	0.23
31	300850	新强联	67,687	2,424,548.34	0.70
32	688629	华丰科技	41,800	2,390,960.00	0.69
33	300079	数码视讯	401,600	2,349,360.00	0.68
34	605305	中际联合	84,400	2,344,632.00	0.68
35	000001	平安银行	193,000	2,329,510.00	0.67
36	002487	大金重工	70,000	2,303,000.00	0.66
37	600039	四川路桥	232,500	2,301,750.00	0.66
38	000902	新洋丰	164,900	2,280,567.00	0.66
39	600490	鹏欣资源	508,600	2,232,754.00	0.64
40	688668	鼎通科技	35,000	2,186,100.00	0.63
41	600933	爱柯迪	136,000	2,177,360.00	0.63
42	601989	中国重工	469,100	2,176,624.00	0.63
43	300232	洲明科技	299,000	2,164,760.00	0.62
44	01530	三生制药	100,000	2,156,761.75	0.62
45	603766	隆鑫通用	168,200	2,146,232.00	0.62
46	603296	华勤技术	25,800	2,081,544.00	0.60
47	600866	星湖科技	299,900	2,072,309.00	0.60
48	300959	线上线下	44,300	2,014,321.00	0.58
49	601003	柳钢股份	564,900	1,988,448.00	0.57
50	601998	中信银行	139,700	1,187,450.00	0.34
50	00998	中信银行	115,000	784,459.39	0.23
51	000553	安道麦 A	266,900	1,927,018.00	0.55
52	601665	齐鲁银行	302,800	1,913,696.00	0.55
53	601088	中国神华	25,700	1,041,878.00	0.30
53	01088	中国神华	28,500	791,413.01	0.23
54	301507	民生健康	125,900	1,826,809.00	0.53
55	000425	徐工机械	233,000	1,810,410.00	0.52
56	601107	四川成渝	298,300	1,795,766.00	0.52
57	601229	上海银行	168,800	1,790,968.00	0.52
58	600315	上海家化	84,900	1,788,843.00	0.52
59	600188	兖矿能源	84,900	1,033,233.00	0.30
59	01171	兖矿能源	106,000	754,966.93	0.22
60	300496	中科创达	29,200	1,670,824.00	0.48
61	002736	国信证券	144,400	1,663,488.00	0.48
62	301260	格力博	84,000	1,656,480.00	0.48
63	688475	萤石网络	52,200	1,645,344.00	0.47
64	000783	长江证券	232,400	1,610,532.00	0.46
65	601328	交通银行	196,400	1,571,200.00	0.45
66	688141	杰华特	42,100	1,371,618.00	0.39

67	03998	波司登	318,000	1,345,600.46	0.39
68	688258	卓易信息	26,998	1,307,513.14	0.38
69	000987	越秀资本	190,282	1,305,334.52	0.38
70	000100	TCL 科技	275,100	1,191,183.00	0.34
71	300363	博腾股份	67,800	1,158,024.00	0.33
72	300843	胜蓝股份	34,700	1,099,643.00	0.32
73	603379	三美股份	22,800	1,097,136.00	0.32
74	603167	渤海轮渡	95,800	1,092,120.00	0.31
75	600282	南钢股份	251,900	1,057,980.00	0.30
76	601168	西部矿业	63,400	1,054,342.00	0.30
77	000932	华菱钢铁	238,900	1,051,160.00	0.30
78	000983	山西焦煤	163,600	1,047,040.00	0.30
79	601019	山东出版	110,300	1,044,541.00	0.30
80	000937	冀中能源	180,800	1,039,600.00	0.30
81	600461	洪城环境	107,800	1,039,192.00	0.30
82	601928	凤凰传媒	93,000	1,038,810.00	0.30
83	600153	建发股份	100,100	1,038,037.00	0.30
84	600757	长江传媒	111,700	1,036,576.00	0.30
85	600664	哈药股份	281,600	1,036,288.00	0.30
86	601919	中远海控	68,900	1,036,256.00	0.30
87	601225	陕西煤业	53,800	1,035,112.00	0.30
88	000157	中联重科	143,100	1,034,613.00	0.30
89	600064	南京高科	133,500	1,029,285.00	0.30
90	300770	新媒股份	25,700	1,027,743.00	0.30
91	600729	重庆百货	34,300	1,023,169.00	0.29
92	600755	厦门国贸	168,800	1,021,240.00	0.29
93	601169	北京银行	149,200	1,019,036.00	0.29
94	000429	粤高速 A	76,100	1,014,413.00	0.29
95	601009	南京银行	87,200	1,013,264.00	0.29
96	601838	成都银行	50,400	1,013,040.00	0.29
97	601166	兴业银行	43,000	1,003,620.00	0.29
98	600502	XD 安徽建	213,000	1,001,100.00	0.29
99	601098	XD 中南传	76,100	998,432.00	0.29
100	605118	力鼎光电	38,700	960,921.00	0.28
101	301367	瑞迈特	11,200	941,920.00	0.27
102	02367	巨子生物	17,400	915,579.56	0.26
103	01952	云顶新耀	16,000	907,572.64	0.26
104	600875	东方电气	52,800	883,872.00	0.25
105	09992	泡泡玛特	3,600	875,253.13	0.25
106	09699	顺丰同城	49,000	846,344.32	0.24
107	300207	欣旺达	42,000	842,520.00	0.24
108	02469	粉笔	374,000	835,619.79	0.24
109	06869	长飞光纤光缆	43,000	835,255.01	0.24

110	02145	上美股份	11,100	830,056.89	0.24
111	300990	同飞股份	16,400	818,360.00	0.24
112	00883	中国海洋石油	50,000	807,987.70	0.23
113	01810	小米集团-W	14,600	798,202.48	0.23
114	00564	郑煤机	58,400	791,412.10	0.23
115	01801	信达生物	11,000	786,465.68	0.23
116	01258	中国有色矿业	118,000	784,477.63	0.23
117	601061	中信金属	99,000	783,090.00	0.23
118	00817	中国金茂	720,000	781,358.76	0.23
118	01882	海天国际	42,000	781,358.76	0.23
119	02601	中国太保	31,800	778,650.27	0.22
120	600531	豫光金铅	100,600	778,644.00	0.22
121	01772	赣锋锂业	37,400	777,638.00	0.22
122	02328	中国财险	56,000	776,251.84	0.22
123	02602	万物云	40,400	775,540.52	0.22
124	601901	方正证券	98,000	775,180.00	0.22
125	601857	中国石油	90,600	774,630.00	0.22
126	01787	山东黄金	30,500	757,944.44	0.22
127	01898	中煤能源	91,000	753,526.05	0.22
128	002434	万里扬	102,400	750,592.00	0.22
129	02268	药明合联	19,500	739,773.84	0.21
130	002284	亚太股份	66,400	733,720.00	0.21
131	01773	天立国际控股	175,000	724,544.28	0.21
132	01816	中广核电力	297,000	723,167.23	0.21
133	06963	阳光保险	233,000	690,574.14	0.20
134	002993	奥海科技	16,200	671,814.00	0.19
135	600728	佳都科技	120,700	657,815.00	0.19
136	600861	北京人力	33,300	642,690.00	0.19
137	600338	西藏珠峰	52,200	578,898.00	0.17
138	002362	汉王科技	25,300	567,226.00	0.16
139	000729	燕京啤酒	43,800	566,334.00	0.16
140	300767	震安科技	42,200	549,866.00	0.16
141	002223	鱼跃医疗	15,100	537,560.00	0.15
142	600109	国金证券	60,900	534,093.00	0.15
143	603102	百合股份	12,600	530,838.00	0.15
144	603328	依顿电子	50,400	494,424.00	0.14
145	600663	陆家嘴	55,100	488,186.00	0.14
146	688008	澜起科技	5,800	475,600.00	0.14
147	600887	伊利股份	17,000	473,960.00	0.14
148	688578	艾力斯	4,800	446,592.00	0.13
149	300768	迪普科技	25,900	444,185.00	0.13
150	000823	超声电子	37,200	440,820.00	0.13
151	301291	明阳电气	10,000	411,500.00	0.12

152	300196	长海股份	33,700	411,140.00	0.12
153	603500	祥和实业	42,600	390,216.00	0.11
154	002798	帝欧家居	53,300	353,379.00	0.10
155	002940	昂利康	9,400	348,834.00	0.10
156	603818	曲美家居	67,600	347,464.00	0.10
157	02331	李宁	22,500	347,179.37	0.10
158	603808	歌力思	40,300	334,490.00	0.10
159	300509	新美星	38,900	332,984.00	0.10
160	688045	必易微	9,600	330,240.00	0.10
161	603982	泉峰汽车	29,800	330,184.00	0.10
162	300514	友讯达	23,400	329,472.00	0.09
163	002623	亚玛顿	20,400	329,460.00	0.09
164	688485	九州一轨	30,200	328,878.00	0.09
165	301413	安培龙	4,300	328,735.00	0.09
166	002209	达意隆	26,100	327,555.00	0.09
167	603176	汇通集团	68,100	326,880.00	0.09
168	000715	中兴商业	56,890	325,979.70	0.09
169	603163	圣晖集成	11,400	325,014.00	0.09
170	001210	金房能源	23,720	324,726.80	0.09
171	605189	富春染织	26,130	324,534.60	0.09
172	688419	耐科装备	8,700	324,336.00	0.09
173	002394	联发股份	39,400	324,262.00	0.09
174	603321	梅轮电梯	41,500	323,700.00	0.09
175	002674	兴业科技	32,400	323,676.00	0.09
176	603829	洛凯股份	18,900	323,568.00	0.09
177	300883	龙利得	52,000	323,440.00	0.09
178	603909	建发合诚	33,200	323,368.00	0.09
179	603617	君禾股份	45,100	323,367.00	0.09
180	301222	浙江恒威	11,100	323,121.00	0.09
181	301020	密封科技	14,800	323,084.00	0.09
182	600791	京能置业	68,300	323,059.00	0.09
183	301360	荣旗科技	6,700	322,002.00	0.09
184	002787	华源控股	39,400	321,898.00	0.09
185	002893	京能热力	30,100	321,769.00	0.09
186	300906	日月明	11,700	321,750.00	0.09
186	301088	戎美股份	23,400	321,750.00	0.09
187	300703	创源股份	15,200	321,632.00	0.09
188	603238	诺邦股份	18,300	320,982.00	0.09
189	002998	优彩资源	44,200	320,892.00	0.09
190	603878	武进不锈	59,200	320,864.00	0.09
191	600661	昂立教育	30,100	320,565.00	0.09
192	300811	铂科新材	6,900	320,229.00	0.09
193	002084	海鸥住工	90,200	320,210.00	0.09

194	002687	乔治白	69,000	320,160.00	0.09
195	001266	宏英智能	12,100	320,045.00	0.09
196	603208	江山欧派	20,400	319,872.00	0.09
197	301276	嘉曼服饰	17,560	319,416.40	0.09
198	603201	常润股份	17,300	319,185.00	0.09
199	600969	郴电国际	44,700	319,158.00	0.09
200	300707	威唐工业	23,100	319,011.00	0.09
201	603269	海鸥股份	34,220	318,930.40	0.09
202	603681	永冠新材	21,300	318,861.00	0.09
203	301106	骏成科技	10,700	318,860.00	0.09
204	300616	尚品宅配	24,200	318,714.00	0.09
205	688115	思林杰	6,200	318,680.00	0.09
206	002551	尚荣医疗	84,700	318,472.00	0.09
207	300621	维业股份	35,800	318,262.00	0.09
208	000798	中水渔业	42,800	317,576.00	0.09
209	600249	两面针	54,900	317,322.00	0.09
210	603378	亚士创能	52,300	316,938.00	0.09
211	002968	新大正	30,700	316,824.00	0.09
212	301227	森鹰窗业	13,200	316,800.00	0.09
213	002864	盘龙药业	11,200	316,624.00	0.09
214	688455	科捷智能	22,500	316,575.00	0.09
215	301321	翰博高新	20,700	316,503.00	0.09
216	688370	从麟科技	16,556	316,385.16	0.09
217	002234	民和股份	38,800	316,220.00	0.09
218	603051	鹿山新材	11,100	316,128.00	0.09
219	600128	苏豪弘业	28,900	315,588.00	0.09
220	000419	通程控股	55,400	315,226.00	0.09
221	001333	光华股份	15,400	314,930.00	0.09
222	688338	赛科希德	12,500	314,750.00	0.09
223	600470	六国化工	50,500	314,615.00	0.09
224	688657	浩辰软件	7,400	314,278.00	0.09
225	002370	亚太药业	82,700	314,260.00	0.09
226	002671	龙泉股份	68,300	314,180.00	0.09
227	002790	瑞尔特	43,200	314,064.00	0.09
228	002799	环球印务	36,400	313,768.00	0.09
229	002811	郑中设计	29,700	313,632.00	0.09
230	001358	兴欣新材	13,100	313,483.00	0.09
231	603180	金牌家居	16,100	313,467.00	0.09
232	002330	得利斯	68,400	313,272.00	0.09
233	300745	欣锐科技	16,400	313,076.00	0.09
234	603810	丰山集团	19,200	312,384.00	0.09
235	003023	彩虹集团	15,400	312,312.00	0.09
236	002682	龙洲股份	65,200	312,308.00	0.09

237	688420	美腾科技	13,100	312,304.00	0.09
238	001331	胜通能源	31,920	312,177.60	0.09
239	000757	浩物股份	68,900	312,117.00	0.09
240	600573	惠泉啤酒	25,500	311,610.00	0.09
241	688597	煜邦电力	39,780	311,477.40	0.09
242	603192	汇得科技	14,900	311,410.00	0.09
243	603221	爱丽家居	28,400	311,264.00	0.09
244	688448	磁谷科技	10,600	310,474.00	0.09
245	600333	长春燃气	63,800	310,068.00	0.09
246	603518	锦泓集团	31,200	308,256.00	0.09
247	300557	理工光科	11,390	307,530.00	0.09
248	605169	洪通燃气	28,900	307,207.00	0.09
249	688210	统联精密	13,300	303,240.00	0.09
250	601555	东吴证券	33,500	293,125.00	0.08
251	603233	大参林	17,540	285,902.00	0.08
252	600299	安迪苏	29,500	284,675.00	0.08
253	300573	兴齐眼药	5,320	275,522.80	0.08
254	002916	深南电路	2,540	273,837.40	0.08
255	002970	锐明技术	5,500	271,700.00	0.08
256	002668	TCL 智家	27,700	270,629.00	0.08
257	06160	百济神州	2,000	269,572.42	0.08
258	688313	仕佳光子	6,900	262,545.00	0.08
259	600276	恒瑞医药	5,000	259,500.00	0.07
260	600674	川投能源	15,200	243,808.00	0.07
261	603444	吉比特	800	241,560.00	0.07
262	600398	海澜之家	34,500	240,120.00	0.07
263	000728	国元证券	30,400	239,856.00	0.07
264	600055	万东医疗	13,700	236,736.00	0.07
265	688573	信宇人	6,800	235,280.00	0.07
266	688199	久日新材	9,800	231,280.00	0.07
267	688303	大全能源	10,800	230,256.00	0.07
268	300009	安科生物	27,500	230,175.00	0.07
269	600057	厦门象屿	32,500	228,475.00	0.07
270	603929	亚翔集成	6,500	228,150.00	0.07
271	002286	保龄宝	20,100	227,733.00	0.07
272	688503	聚和材料	5,500	227,645.00	0.07
273	301308	江波龙	2,600	227,474.00	0.07
274	300548	长芯博创	3,400	227,018.00	0.07
275	300750	宁德时代	900	226,998.00	0.07
276	300457	赢合科技	9,800	225,400.00	0.06
277	600732	爱旭股份	17,200	225,320.00	0.06
278	603345	安井食品	2,800	225,176.00	0.06
279	600666	奥瑞德	62,500	225,000.00	0.06

280	688170	德龙激光	8,900	224,280.00	0.06
281	688778	厦钨新能	4,000	223,680.00	0.06
282	01211	比亚迪股份	2,000	223,427.75	0.06
283	601890	亚星锚链	21,900	223,161.00	0.06
284	688197	首药控股	6,148	222,557.60	0.06
285	603300	海南华铁	19,900	221,885.00	0.06
286	301323	新莱福	5,000	221,800.00	0.06
287	600483	福能股份	22,900	220,756.00	0.06
288	001206	依依股份	10,500	220,500.00	0.06
289	300130	新国都	6,200	220,286.00	0.06
290	688152	麒麟信安	4,700	220,242.00	0.06
291	600536	中国软件	4,700	219,819.00	0.06
292	603776	永安行	10,900	219,635.00	0.06
293	301216	万凯新材	17,600	219,472.00	0.06
294	301511	德福科技	10,600	219,420.00	0.06
295	601595	上海电影	7,400	219,336.00	0.06
296	300308	中际旭创	1,500	218,790.00	0.06
297	688300	联瑞新材	4,700	218,785.00	0.06
298	603619	中曼石油	10,900	218,763.00	0.06
299	000768	中航西飞	8,000	218,720.00	0.06
300	603086	先达股份	22,300	218,540.00	0.06
301	300037	新宙邦	6,200	218,240.00	0.06
302	688518	联赢激光	10,700	218,173.00	0.06
303	600367	红星发展	13,900	218,091.00	0.06
304	002179	中航光电	5,400	217,944.00	0.06
305	301219	腾远钴业	4,100	217,792.00	0.06
306	688182	灿勤科技	7,900	217,724.00	0.06
307	000403	派林生物	12,000	217,560.00	0.06
308	603567	珍宝岛	18,500	217,375.00	0.06
309	600746	江苏索普	27,800	217,118.00	0.06
310	688458	美芯晟	4,600	216,936.00	0.06
311	002027	分众传媒	29,700	216,810.00	0.06
312	600795	国电电力	44,700	216,348.00	0.06
313	002395	双象股份	12,200	215,940.00	0.06
314	002846	英联股份	10,800	215,568.00	0.06
315	301165	锐捷网络	3,500	215,110.00	0.06
316	300870	欧陆通	1,700	215,050.00	0.06
317	603725	天安新材	25,000	215,000.00	0.06
318	600529	山东药玻	9,700	214,758.00	0.06
319	000719	中原传媒	17,300	214,693.00	0.06
320	301392	汇成真空	1,800	214,578.00	0.06
321	603286	日盈电子	7,200	214,416.00	0.06
321	688333	铂力特	3,600	214,416.00	0.06

322	000989	九芝堂	23,900	214,383.00	0.06
323	002182	宝武镁业	17,500	214,200.00	0.06
324	000899	赣能股份	24,800	214,024.00	0.06
325	600900	长江电力	7,100	213,994.00	0.06
326	300633	开立医疗	7,200	213,984.00	0.06
327	603565	中谷物流	22,400	213,920.00	0.06
328	000963	华东医药	5,300	213,908.00	0.06
329	300450	先导智能	8,600	213,710.00	0.06
330	300859	西域旅游	5,300	213,431.00	0.06
331	603099	长白山	5,600	213,136.00	0.06
332	603281	江瀚新材	8,500	213,010.00	0.06
333	600170	上海建工	89,000	212,710.00	0.06
334	300698	万马科技	4,600	212,428.00	0.06
335	301038	深水规院	12,700	212,090.00	0.06
336	600025	华能水电	22,200	212,010.00	0.06
337	688607	康众医疗	11,300	211,875.00	0.06
338	300085	银之杰	4,800	211,488.00	0.06
339	688372	伟测科技	3,500	211,400.00	0.06
340	000408	藏格矿业	4,900	209,083.00	0.06
341	000623	吉林敖东	12,300	208,485.00	0.06
342	605319	无锡振华	6,100	208,376.00	0.06
343	688499	利元亨	5,000	208,050.00	0.06
344	600570	恒生电子	6,200	207,948.00	0.06
345	000596	古井贡酒	1,500	199,725.00	0.06
346	300206	理邦仪器	16,300	195,926.00	0.06
347	605598	上海港湾	8,400	179,508.00	0.05
348	600987	航民股份	23,700	167,559.00	0.05
349	600160	巨化股份	5,700	163,476.00	0.05
350	001696	宗申动力	7,000	157,150.00	0.05
351	300649	杭州园林	8,100	154,710.00	0.04
352	002815	崇达技术	12,900	146,157.00	0.04
353	300628	亿联网络	3,800	132,088.00	0.04
354	002517	恺英网络	6,700	129,377.00	0.04
355	002407	多氟多	10,300	125,557.00	0.04
356	300168	万达信息	13,100	100,477.00	0.03
357	002841	视源股份	2,900	100,340.00	0.03
358	605077	华康股份	5,900	95,462.00	0.03
359	605116	奥锐特	4,200	87,780.00	0.03
360	603083	剑桥科技	1,500	70,950.00	0.02
361	600578	京能电力	15,800	70,942.00	0.02
362	300627	华测导航	1,780	62,300.00	0.02
363	300611	美力科技	2,500	58,225.00	0.02
364	300738	奥飞数据	2,700	56,511.00	0.02

365	301018	申菱环境	1,300	49,322.00	0.01
366	300119	瑞普生物	2,500	48,550.00	0.01
367	002938	鹏鼎控股	1,400	44,842.00	0.01
368	688775	影石创新	326	40,476.16	0.01
369	688411	海博思创	448	37,403.52	0.01
370	688472	阿特斯	3,514	32,153.10	0.01
371	601900	南方传媒	2,000	31,280.00	0.01
372	301536	星辰科技	481	29,004.30	0.01
373	688545	兴福电子	738	19,889.10	0.01
374	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
375	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
376	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
377	001388	C 信通电子	937	15,385.54	0.00
378	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
379	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.00
380	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
381	301277	新天地	867	12,458.79	0.00
382	301275	汉朔科技	215	12,080.85	0.00
383	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
384	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
385	603072	天和磁材	206	11,216.70	0.00
386	300926	博俊科技	400	10,588.00	0.00
387	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
388	300400	劲拓股份	600	10,104.00	0.00
389	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
390	301381	赛维时代	500	9,975.00	0.00
391	301501	恒鑫生活	206	9,315.32	0.00
392	001356	富岭股份	643	9,284.92	0.00
393	605168	三人行	300	8,829.00	0.00
394	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
395	002714	牧原股份	200	8,402.00	0.00
396	603049	中策橡胶	189	8,098.65	0.00
397	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
398	002636	金安国纪	800	7,584.00	0.00
399	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
400	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
401	001359	平安电工	184	6,417.92	0.00
402	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
403	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
404	603202	天有为	61	5,530.26	0.00
405	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
406	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
407	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00

408	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
409	603271	永杰新材	106	3,718.48	0.00
410	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
411	603409	XD 汇通控	88	2,932.16	0.00
412	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
413	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
414	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
415	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
416	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
417	603383	顶点软件	20	848.00	0.00
418	600168	武汉控股	20	93.00	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	00700	腾讯控股	18,939,296.16	8.20
2	002335	科华数据	14,322,628.00	6.20
3	03690	美团-W	12,436,153.95	5.39
4	00981	中芯国际	8,067,888.39	3.49
4	688981	中芯国际	2,549,914.08	1.10
5	300972	万辰集团	9,902,170.00	4.29
6	600941	中国移动	6,615,034.00	2.86
6	00941	中国移动	3,131,908.43	1.36
7	002487	大金重工	9,575,877.00	4.15
8	300502	新易盛	8,869,859.40	3.84
9	002624	完美世界	8,704,908.54	3.77
10	002847	盐津铺子	8,383,196.00	3.63
11	300395	菲利华	8,113,258.00	3.51
12	000425	徐工机械	8,031,642.03	3.48
13	000596	古井贡酒	7,902,767.00	3.42
14	601208	东材科技	7,861,492.20	3.40
15	000729	燕京啤酒	7,768,397.00	3.36
16	600875	东方电气	6,968,227.00	3.02
16	01072	东方电气	770,707.56	0.33
17	601579	会稽山	7,599,366.00	3.29
18	600887	伊利股份	7,269,298.00	3.15
19	605208	永茂泰	7,233,764.00	3.13
20	600292	远达环保	7,026,234.00	3.04
21	600861	北京人力	7,009,883.69	3.04
22	605117	德业股份	6,971,626.00	3.02
23	603859	能科科技	6,887,973.24	2.98
24	002991	甘源食品	6,853,159.00	2.97

25	600938	中国海油	4,802,593.49	2.08
25	00883	中国海洋石油	2,049,981.69	0.89
26	300723	一品红	6,793,094.00	2.94
27	09988	阿里巴巴-W	6,698,775.91	2.90
28	600998	九州通	6,612,514.00	2.86
29	300014	亿纬锂能	6,498,609.00	2.81
30	688196	卓越新能	6,430,756.31	2.78
31	300731	科创新源	6,384,558.00	2.76
32	600163	中闽能源	6,370,993.00	2.76
33	000902	新洋丰	6,337,115.00	2.74
34	300850	新强联	6,200,575.38	2.69
35	002080	中材科技	6,198,147.00	2.68
36	301510	固高科技	6,193,844.00	2.68
37	01024	快手-W	6,179,137.82	2.68
38	601168	西部矿业	6,151,004.00	2.66
39	600866	星湖科技	6,121,515.00	2.65
40	600673	东阳光	6,091,382.00	2.64
41	600027	华电国际	3,676,513.00	1.59
41	01071	华电国际电力股份	2,405,056.24	1.04
42	000063	中兴通讯	3,936,712.00	1.70
42	00763	中兴通讯	2,124,766.37	0.92
43	002838	道恩股份	6,057,841.00	2.62
44	01810	小米集团-W	6,053,055.44	2.62
45	300738	奥飞数据	5,938,104.00	2.57
46	002345	潮宏基	5,915,824.00	2.56
47	300570	太辰光	5,907,451.00	2.56
48	601319	中国人保	4,320,738.00	1.87
48	01339	中国人民保险集团	1,486,559.85	0.64
49	600893	航发动力	5,761,001.00	2.49
50	688123	聚辰股份	5,753,147.54	2.49
51	600761	安徽合力	5,712,504.00	2.47
52	300207	欣旺达	5,690,308.00	2.46
53	600499	科达制造	5,666,816.00	2.45
54	601991	大唐发电	3,079,267.00	1.33
54	00991	大唐发电	2,552,979.94	1.11
55	301210	金杨股份	5,597,472.59	2.42
56	000600	建投能源	5,523,802.00	2.39
57	002831	裕同科技	5,495,157.00	2.38
58	003000	劲仔食品	5,494,537.00	2.38
59	603102	百合股份	5,468,943.00	2.37
60	600166	福田汽车	5,449,154.00	2.36
61	600585	海螺水泥	5,440,780.76	2.36

62	300033	同花顺	5,385,193.00	2.33
63	301280	珠城科技	5,363,262.28	2.32
64	000786	北新建材	5,314,477.00	2.30
65	002979	雷赛智能	5,303,585.00	2.30
66	600276	恒瑞医药	5,300,496.52	2.30
67	603707	健友股份	5,241,765.00	2.27
68	600873	梅花生物	5,221,749.00	2.26
69	300416	苏试试验	5,154,061.00	2.23
70	300870	欧陆通	5,150,922.00	2.23
71	605599	菜百股份	5,122,970.00	2.22
72	300913	兆龙互连	5,122,084.00	2.22
73	000938	紫光股份	5,106,360.00	2.21
74	601138	工业富联	5,092,564.00	2.21
75	300911	亿田智能	5,083,933.00	2.20
76	300910	瑞丰新材	5,060,022.00	2.19
77	688182	灿勤科技	5,053,823.90	2.19
78	300383	光环新网	5,049,197.00	2.19
79	002568	百润股份	5,034,255.00	2.18
80	601998	中信银行	3,165,582.00	1.37
80	00998	中信银行	1,841,812.34	0.80
81	002739	万达电影	4,964,347.00	2.15
82	300806	斯迪克	4,938,794.00	2.14
83	688550	瑞联新材	4,927,746.07	2.13
84	01801	信达生物	4,921,655.12	2.13
85	01211	比亚迪股份	3,981,049.70	1.72
85	002594	比亚迪	923,486.00	0.40
86	688382	益方生物	4,900,338.01	2.12
87	603296	华勤技术	4,893,080.00	2.12
88	301367	瑞迈特	4,856,994.00	2.10
89	002851	麦格米特	4,846,181.00	2.10
90	002706	良信股份	4,841,816.00	2.10
91	603218	日月股份	4,830,258.00	2.09
92	300777	中简科技	4,810,968.00	2.08
93	000915	华特达因	4,789,636.00	2.07
94	688787	海天瑞声	4,771,935.26	2.07
95	300638	广和通	4,763,000.00	2.06
96	688629	华丰科技	4,747,935.95	2.06
97	688041	海光信息	4,744,624.22	2.05
98	688322	奥比中光	4,742,800.33	2.05
99	603300	海南华铁	4,732,750.00	2.05
100	300765	新诺威	4,718,046.00	2.04
101	603112	XD 华翔股	4,680,583.00	2.03
102	603918	金桥信息	4,672,026.00	2.02

103	600153	建发股份	4,663,720.00	2.02
-----	--------	------	--------------	------

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	002335	科华数据	15,029,369.00	6.51
2	03690	美团-W	14,378,632.43	6.23
3	600941	中国移动	9,195,726.00	3.98
3	00941	中国移动	3,248,219.67	1.41
4	01810	小米集团-W	11,661,626.16	5.05
5	300972	万辰集团	9,977,499.80	4.32
6	002847	盐津铺子	9,136,399.00	3.96
7	00700	腾讯控股	8,656,074.88	3.75
8	300502	新易盛	8,608,747.20	3.73
9	300395	菲利华	8,129,475.00	3.52
10	00285	比亚迪电子	8,053,800.52	3.49
11	601579	会稽山	7,875,518.00	3.41
12	605117	德业股份	7,766,468.00	3.36
13	000596	古井贡酒	7,631,810.00	3.31
14	002487	大金重工	7,446,146.00	3.22
15	000729	燕京啤酒	7,198,909.00	3.12
16	002624	完美世界	7,114,917.00	3.08
17	600875	东方电气	6,221,589.00	2.69
17	01072	东方电气	853,966.76	0.37
18	603859	能科科技	7,061,705.20	3.06
19	300207	欣旺达	6,992,765.00	3.03
20	002991	甘源食品	6,891,470.00	2.98
21	600292	远达环保	6,869,847.00	2.98
22	09988	阿里巴巴-W	6,866,131.04	2.97
23	00981	中芯国际	4,359,331.78	1.89
23	688981	中芯国际	2,483,332.59	1.08
24	300723	一品红	6,804,752.00	2.95
25	600887	伊利股份	6,742,590.00	2.92
26	09868	小鹏汽车-W	6,733,127.12	2.92
27	000425	徐工机械	6,623,103.17	2.87
28	605208	永茂泰	6,594,080.30	2.86
29	600163	中闽能源	6,487,312.00	2.81
30	300731	科创新源	6,394,659.00	2.77
31	688196	卓越新能	6,391,379.32	2.77
32	000600	建投能源	6,381,410.00	2.76
33	002838	道恩股份	6,339,514.00	2.75
34	301210	金杨股份	6,285,118.00	2.72

35	600861	北京人力	6,228,014.00	2.70
36	601398	工商银行	4,703,059.00	2.04
36	01398	工商银行	1,426,880.86	0.62
37	002345	潮宏基	6,108,943.00	2.65
38	600027	华电国际	3,711,181.00	1.61
38	01071	华电国际电力股份	2,313,861.15	1.00
39	601288	农业银行	4,805,657.00	2.08
39	01288	农业银行	1,213,822.00	0.53
40	300570	太辰光	6,011,322.00	2.60
41	600276	恒瑞医药	6,003,962.00	2.60
42	600673	东阳光	5,980,974.00	2.59
43	002202	金风科技	4,932,436.00	2.14
43	02208	金风科技	1,042,673.14	0.45
44	600938	中国海油	4,756,166.00	2.06
44	00883	中国海洋石油	1,213,524.60	0.53
45	000063	中兴通讯	3,882,576.00	1.68
45	00763	中兴通讯	2,073,359.22	0.90
46	601988	中国银行	5,902,233.00	2.56
47	002979	雷赛智能	5,819,400.00	2.52
48	01211	比亚迪股份	4,681,091.89	2.03
48	002594	比亚迪	1,083,742.00	0.47
49	000915	华特达因	5,718,397.00	2.48
50	01024	快手-W	5,715,466.01	2.48
51	600893	航发动力	5,710,442.00	2.47
52	300738	奥飞数据	5,700,607.00	2.47
53	600153	建发股份	5,678,757.00	2.46
54	601991	大唐发电	2,987,804.00	1.29
54	00991	大唐发电	2,647,549.86	1.15
55	000776	广发证券	5,602,362.00	2.43
56	301280	珠城科技	5,529,715.96	2.39
57	002851	麦格米特	5,504,119.00	2.38
58	002831	裕同科技	5,497,899.00	2.38
59	605599	菜百股份	5,483,316.00	2.37
60	600761	安徽合力	5,463,662.00	2.37
61	688182	灿勤科技	5,405,721.91	2.34
62	688123	聚辰股份	5,399,971.78	2.34
63	000938	紫光股份	5,336,889.00	2.31
64	600585	海螺水泥	5,312,529.80	2.30
65	002568	百润股份	5,306,319.00	2.30
66	601208	东材科技	5,273,207.60	2.28
67	003000	劲仔食品	5,254,220.00	2.28
68	300033	同花顺	5,241,227.00	2.27
69	300910	瑞丰新材	5,226,026.00	2.26

70	000786	北新建材	5,212,971.00	2.26
71	603918	金桥信息	5,168,814.00	2.24
72	002027	分众传媒	5,137,480.00	2.22
73	300416	苏试试验	5,113,019.00	2.21
74	002739	万达电影	5,062,166.00	2.19
75	688550	瑞联新材	5,034,005.61	2.18
76	300870	欧陆通	5,031,024.00	2.18
77	688322	奥比中光	5,013,437.18	2.17
78	601168	西部矿业	4,985,379.00	2.16
79	300383	光环新网	4,939,443.00	2.14
80	300638	广和通	4,928,441.80	2.13
81	601939	建设银行	4,898,786.00	2.12
82	300806	斯迪克	4,898,778.00	2.12
83	603707	健友股份	4,898,547.00	2.12
84	300913	兆龙互连	4,825,875.00	2.09
85	300765	新诺威	4,815,314.60	2.09
86	603112	XD 华翔股	4,811,091.00	2.08
87	688382	益方生物	4,807,973.87	2.08
88	300945	曼卡龙	4,748,193.00	2.06
89	300911	亿田智能	4,744,528.00	2.05
90	000893	亚钾国际	4,730,108.00	2.05
91	688041	海光信息	4,683,700.51	2.03
92	603218	日月股份	4,679,755.00	2.03
93	300319	麦捷科技	4,636,450.00	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	2,763,256,736.30
卖出股票收入（成交）总额	2,680,259,833.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	700,687.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	293,800.35
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,916.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,028,404.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧量化动力混合 A	4,991	35,375.05	76,846,103.34	43.52%	99,710,764.39	56.48%
中欧量化动力混合 C	2,354	74,617.36	99,367,341.45	56.57%	76,281,930.91	43.43%
合计	7,345	47,951.82	176,213,444.79	50.03%	175,992,695.30	49.97%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧量化动力混合 A	232,249.04	0.13%
	中欧量化动力混合 C	0.00	0.00%
	合计	232,249.04	0.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	10~50
	中欧量化动力混合 C	0

	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧量化动力混合 A	10~50
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
基金合同生效日 （2022 年 3 月 2 日）基金份额总额	115,946,789.67	208,122,307.00
本报告期期初基金 份额总额	120,750,762.56	130,757,063.41
本报告期基金总申 购份额	103,098,906.01	154,838,665.81
减：本报告期基金 总赎回份额	47,292,800.84	109,946,456.86
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	176,556,867.73	175,649,272.36

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-06-10
采取稽查或处罚等措施的机构	上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管局现场检查结束后，公司即成立整改小组，制定整改措施包括制度修订、人员培训宣导和强化内部检查等。针对涉及的问题，公司已按要求及时完成整改，并将整改报告报至上海监管局。
其他	无

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 (%)	
国泰海通	3	1,935,998,117.36	35.58	869,339.10	36.26	-
东北证券	3	1,846,874,035.04	33.94	805,089.36	33.58	-
方正证券	3	1,659,078,307.28	30.49	723,299.69	30.17	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基

础上，选择基金专用交易席位。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券。

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(%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券。

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关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18
2	中欧量化动力混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧量化动力混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-03-17
6	中欧基金管理有限公司关于中欧量	中国证监会指定媒介	2025-03-18

	化动力混合型证券投资基金基金托管人信息变更的提示性公告		
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
8	中欧量化动力混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
9	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金基金托管人法定名称变更并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2025-04-04
11	中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2025-04-04
12	中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2025-04-04
13	中欧量化动力混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2025-04-08
14	中欧量化动力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	2025-04-08
15	中欧量化动力混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
16	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
17	中欧量化动力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	2025-06-03
18	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-03
19	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“海光信息”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-06
20	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09

§ 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、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、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

2025 年 8 月 30 日