

# 中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：海通证券股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70

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.....	70
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.....	70
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.....	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12 投资组合报告附注.....	71
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>72</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	75
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>75</b>
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 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

## § 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	海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	710,080,068.62 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	243,188,781.88 份	466,891,286.74 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	海通证券股份有限公司
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	95553
传真	021-33830351	021-23187700
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市广东路 689 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	上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
邮政编码	200120	200011
法定代表人	窦玉明	周杰

## 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(2023 年 1 月 1 日-2023 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	1,429,041.23	1,763,663.62
本期利润	6,322,528.91	8,622,797.28
加权平均基金份额本期利润	0.0299	0.0409
本期加权平均净值利润率	2.95%	4.06%
本期基金份额净值增长率	1.79%	1.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-5,140,526.66	-13,533,166.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0211	-0.0290
期末基金资产净值	238,048,255.22	453,358,120.72

期末基金份额净值	0.9789	0.9710
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-0.10%	-0.90%

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、所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	1.94%	0.89%	1.02%	0.74%	0.92%	0.15%
过去三个月	-3.43%	0.80%	-3.41%	0.68%	-0.02%	0.12%
过去六个月	1.79%	0.76%	1.76%	0.67%	0.03%	0.09%
过去一年	-9.61%	0.89%	-7.48%	0.80%	-2.13%	0.09%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.94%	-10.51%	0.99%	10.41%	-0.05%

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

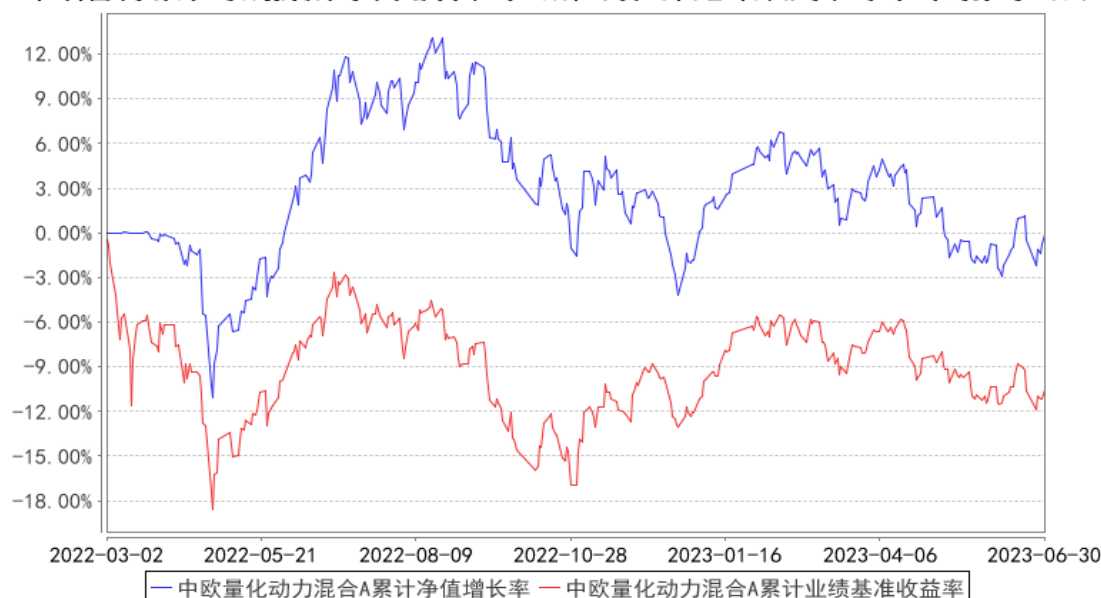
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.88%	0.89%	1.02%	0.74%	0.86%	0.15%
过去三个月	-3.58%	0.80%	-3.41%	0.68%	-0.17%	0.12%

过去六个月	1.49%	0.76%	1.76%	0.67%	-0.27%	0.09%
过去一年	-10.15%	0.89%	-7.48%	0.80%	-2.67%	0.09%
自基金合同生效起 至今	-0.90%	0.95%	-10.51%	0.99%	9.61%	-0.04%

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

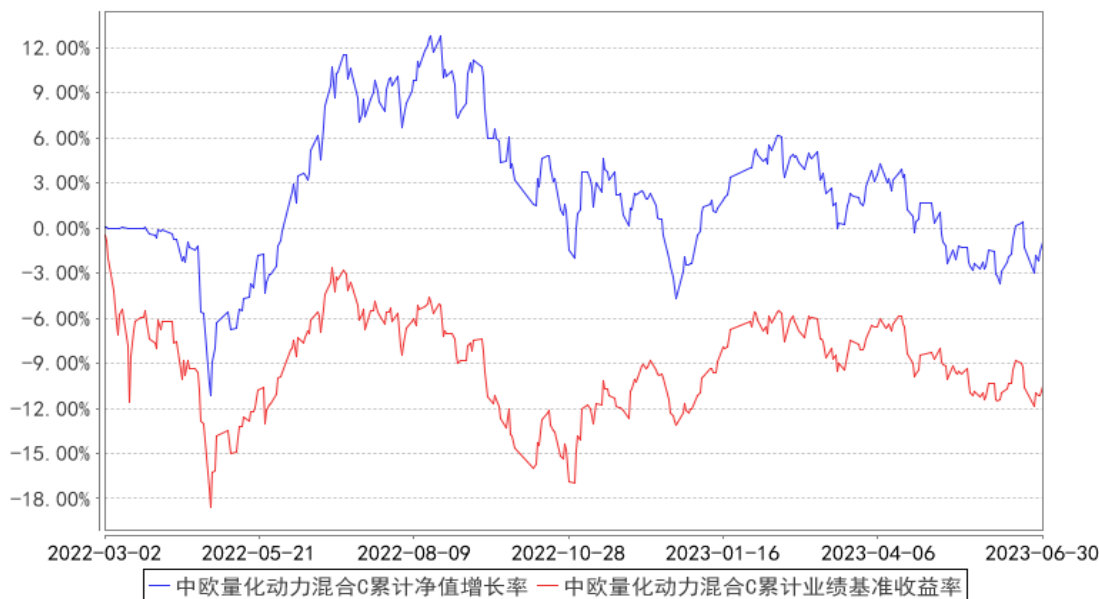
中欧量化动力混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 2 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。



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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 2 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-03-02	-	16 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	7	6,329,179,335.99	2016年1月13日
	私募资产管理计划	2	245,811,705.77	2021年12月14日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	6,574,991,041.76	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：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69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，市场波动加剧，在宏观经济实现恢复性增长的背景下，各行业景气程度较为分化。非制造业 PMI 连续处于荣枯线上方，反映了消费和服务业的景气复苏强于制造业。在我国高质量发展的大原则下，对于传统的刺激政策较为克制，避免了大规模的低效投资，财政政策向战略新兴产业倾斜，彰显了产业结构转型的决心。同时，叠加中美交流加深，国际航线的逐步恢复，以及美联储加息进入尾声，我们认为展望未来，应保持比年初更为乐观的心态，在短期波动中逢低布局权益投资。

在报告期内，我们以偏股混合型基金量化特征作为抓手，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。我们遵循基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式，以企业未来一个季度到一年的业绩为抓手，期待的是业绩持续景气，或者业绩的反转超过了市场预期，而带来的股价上涨的收益。报告期内，我们加深了与行业专家的交流，以提高对行业和个股判断的前瞻性。未来我们将借鉴优秀的主动投资者的较为长期的投资视角，将他们对行业和行业周期的逻辑纳入量化体系内，推动基本面量化策略向更前瞻性的视角演进。今年很多基本面驱动的模式，超额收益都不甚理想。我们必须承认，任何一种寻找 Alpha 方式，都有顺风的市场环境，也会有逆风市场环境。回顾上半年，微盘股，以及传统技术指标，包括反转因子，都体现了更好的超额收益。但我们认为，如果盲目去追求近期最强势的量化风格，往往切换在了高点。我们最终选择坚持中长期有效的 Alpha 来源，根据自己的禀赋和研究资源，将自己更擅长的基本面逻辑模型更上一层，通过多元量化模型，选择优秀的企业，相信他们的收入和利润增长，会映射到合理的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%；基金 C 类份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

## 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，我们认为宏观经济仍会维持复苏趋势，股债相比，更看好股票的性价比。当前，货币政策较为宽松；财政政策相对稳健，财政工具箱中储备仍多；政策对经济的呵护也愈发明显，逆周期调节在逐步推出。我们认为小盘成长板块和顺周期板块，会有更多投资机会，本基金也将依据量化模型进行配置。

## 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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

#### 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，本基金托管人在中欧量化动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，中欧量化动力混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，以上内容真实、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	84,195,346.40	14,918,165.25
结算备付金		5,355,079.78	6,445,753.12
存出保证金		8,160,506.40	1,311,072.00
交易性金融资产	6.4.7.2	539,324,387.50	186,960,927.05
其中：股票投资		528,126,619.55	176,489,622.94
基金投资		-	-
债券投资		11,197,767.95	10,471,304.11
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	14,993,130.42	-
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		155,086.51	-
应收股利		192,095.65	-
应收申购款		40,166,896.12	193,821.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		692,542,528.78	209,829,739.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

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		2,809.30	347,198.92
应付赎回款		260,018.83	25,627.55
应付管理人报酬		549,339.65	277,920.45
应付托管费		54,933.97	27,792.03
应付销售服务费		119,017.59	28,465.73
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	150,033.50	150,033.73
负债合计		1,136,152.84	857,038.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	710,080,068.62	213,184,420.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-18,673,692.68	-4,211,719.81
净资产合计		691,406,375.94	208,972,700.76
负债和净资产总计		692,542,528.78	209,829,739.17

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 710,080,068.62 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9789 元，基金份额总额 243,188,781.88 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9710 元，基金份额总额 466,891,286.74 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 03 月 02 日生效，上年度可比期间自 2022 年 03 月 02 日至 2022 年 06 月 30 日，下同。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		19,270,598.49	16,665,461.95
1. 利息收入		411,370.09	427,639.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	216,396.60	303,296.34
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		194,973.49	124,342.69
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,801,213.31	6,335,697.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	79,112.31	8,171,083.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	102,391.62	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	2,061,764.64	-3,170,838.21
股利收益	6.4.7.14	2,557,944.74	1,335,451.71
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	11,752,621.34	9,739,300.68
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	2,305,393.75	162,825.15
<b>减：二、营业总支出</b>		4,325,272.30	1,903,692.78
1. 管理人报酬		3,244,905.47	1,367,185.61
2. 托管费		324,490.56	136,718.52
3. 销售服务费		652,940.30	339,480.85
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		9,182.40	-
8. 其他费用	6.4.7.18	93,753.57	60,307.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,945,326.19	14,761,769.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,945,326.19	14,761,769.17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		14,945,326.19	14,761,769.17

### 6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	496,895,648.05	-	-14,461,972.87	482,433,675.18
（一）、综合收益总额	-	-	14,945,326.19	14,945,326.19
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	496,895,648.05	-	-21,867,547.54	475,028,100.51
其中：1. 基金申购款	1,116,988,613.77	-	-4,617,298.23	1,112,371,315.54
2. 基金赎回款	-620,092,965.72	-	-17,250,249.31	-637,343,215.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-7,539,751.52	-7,539,751.52
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	710,080,068.62	-	-18,673,692.68	691,406,375.94



项目	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 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（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	324,069,096.67	-	-	324,069,096.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-196,443,671.15	-	13,278,734.04	-183,164,937.11
（一）、综合收益总额	-	-	14,761,769.17	14,761,769.17
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-196,443,671.15	-	-1,483,035.13	-197,926,706.28
其中：1. 基金申购款	4,789,590.21	-	113,107.54	4,902,697.75
2. 基金赎回款	-201,233,261.36	-	-1,596,142.67	-202,829,404.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	127,625,425.52	-	13,278,734.04	140,904,159.56

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。

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。

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2023年06月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023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‰;

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	39,708,062.58
等于：本金	39,703,836.48
加：应计利息	4,226.10
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	44,487,283.82
等于：本金	44,483,908.60
加：应计利息	3,375.22
减：坏账准备	-
合计	84,195,346.40

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

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	522,003,170.92	-	528,126,619.55	6,123,448.63	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,979,017.00	198,867.95	11,197,767.95	19,883.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,979,017.00	198,867.95	11,197,767.95	19,883.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	532,982,187.92	198,867.95	539,324,387.50	6,143,331.63	

### 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
----	-----

	2023 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	67,796,260.00	-	-	
其中: 股指 期货投资	67,796,260.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	67,796,260.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股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。

#### 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
IC2312	IC2312	6.00	7,109,040.00	-150,080.00
IH2307	IH2307	1.00	743,520.00	-420.00
IH2309	IH2309	1.00	746,640.00	-48,240.00
IH2312	IH2312	1.00	751,500.00	-4,140.00
IM2307	IM2307	1.00	1,314,960.00	23,680.00
IM2309	IM2309	28.00	36,603,840.00	321,760.00
IM2312	IM2312	16.00	20,734,720.00	65,400.00
合计				207,960.00
减：可抵销期货 暂收款				207,960.00
净额				0.00

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,993,130.42	-
银行间市场	-	-
合计	14,993,130.42	-

#### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42.14
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	-
其他	65,688.80
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	150,033.50

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	159,114,765.45	159,114,765.45
本期申购	261,264,607.53	261,264,607.53
本期赎回（以“-”号填列）	-177,190,591.10	-177,190,591.10
本期末	243,188,781.88	243,188,781.88

##### 中欧量化动力混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,069,655.12	54,069,655.12
本期申购	855,724,006.24	855,724,006.24
本期赎回（以“-”号填列）	-442,902,374.62	-442,902,374.62
本期末	466,891,286.74	466,891,286.74

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	7,122,636.62	-10,066,190.57	-2,943,553.95
本期利润	1,429,041.23	4,893,487.68	6,322,528.91
本期基金份额交易产生的变动数	-139,377.46	-4,463,893.28	-4,603,270.74
其中：基金申购款	10,671,487.63	-8,485,221.72	2,186,265.91
基金赎回款	-10,810,865.09	4,021,328.44	-6,789,536.65
本期已分配利润	-3,916,230.88	-	-3,916,230.88
本期末	4,496,069.51	-9,636,596.17	-5,140,526.66

## 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	2,140,881.21	-3,409,047.07	-1,268,165.86
本期利润	1,763,663.62	6,859,133.66	8,622,797.28
本期基金份额交易产生的变动数	4,641,630.34	-21,905,907.14	-17,264,276.80
其中：基金申购款	24,346,035.86	-31,149,600.00	-6,803,564.14
基金赎回款	-19,704,405.52	9,243,692.86	-10,460,712.66
本期已分配利润	-3,623,520.64	-	-3,623,520.64
本期末	4,922,654.53	-18,455,820.55	-13,533,166.02

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	80,605.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	47,275.14
结算备付金利息收入	88,516.43
其他	-
合计	216,396.60

## 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,193,487,105.32
减：卖出股票成本总额	2,188,073,356.04
减：交易费用	5,334,636.97
买卖股票差价收入	79,112.31

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	102,395.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	102,391.62

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	4.00
买卖债券差价收入	-4.00

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	2,061,764.64

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,557,944.74
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	2,557,944.74

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,220,661.34
股票投资	11,201,431.34
债券投资	19,230.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	531,960.00
权证投资	-
期货投资	531,960.00
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	11,752,621.34

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,301,350.73
基金转换费收入	359.78
其他	3,683.24
合计	2,305,393.75

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	451.01
合计	93,753.57

#### 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

本报告期内，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

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

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

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：

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）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

##### 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、登记机构
海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 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 （%）
海通证券	1,338,551,191.91	28.39	965,362,721.45	65.88

###### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至 2022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 （%）
海通证券	938,160,000.00	42.16	272,000,000.00	69.39

## 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 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（%）
海通证券	706,417.51	25.75	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合同生效日）至2022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	738,431.30	73.77	-	-

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年3月2日（基金合 同生效日）至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,244,905.47	1,367,185.61
其中：支付销售机构的客户维护费	1,201,397.39	535,515.54

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	324,490.56	136,718.52

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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 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		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	-	170,558.93	170,558.93
中欧基金	-	95,514.82	95,514.82
中欧财富	-	91.63	91.63
合计	-	266,165.38	266,165.38
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 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	-	319,299.96	319,299.96
中欧基金	-	75.74	75.74
合计	-	319,375.70	319,375.70

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。

#### 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。

##### 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

中欧量化动力混合 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例

自然人股东	1,076,494.02	0.44%	100,024.11	0.06%
-------	--------------	-------	------------	-------

注：1、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2022 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
海通证券股份有限公司	48,576,525.69	90,443.42	4,810,061.48	183,964.45

注：本基金的银行存款由基金托管人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

单位：人民币元

中欧量化动力混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 4 月 14 日	-	2023 年 4 月 14 日	0.2080	3,673,2 66.21	242,964. 67	3,916,2 30.88	-
合计	-	-	-	0.2080	3,673,2 66.21	242,964. 67	3,916,2 30.88	-
中欧量化动力混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 4 月 14 日	-	2023 年 4 月 14 日	0.2070	2,746,3 13.22	877,207. 42	3,623,5 20.64	-



合计	-	-	-	0.2070	2,746,313.22	877,207.42	3,623,520.64	-
----	---	---	---	--------	--------------	------------	--------------	---

#### 6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国	2023	6个月	新股	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

	泰环保	年3月28日		流通受限						
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	257	14,875.16	12,636.69	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	509	25,450.00	15,631.39	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	412	12,710.20	9,735.56	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	475	14,354.50	12,112.50	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川	2022	6个月	新股	5.00	8.96	1,904	9,520.00	17,059.84	-

	宁生物	2023年12月20日		流通受限						
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	556	14,039.00	10,947.64	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	504	16,299.36	16,057.44	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	269	18,098.32	17,600.67	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	470	9,714.90	12,299.90	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	220	8,593.20	8,659.20	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	178	13,670.40	19,215.10	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	778	11,522.18	10,681.94	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛	2023	6个月	新股	73.45	46.64	163	11,972.35	7,602.32	-

	涛车业	2023年3月10日		流通受限						
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	435	10,339.95	18,657.15	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	204	6,880.92	6,497.40	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	389	9,258.20	12,774.76	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301399	英	2023	6个月	新股	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

	特科技	年5月16日		流通受限						
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	551	11,014.49	9,311.90	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,445	140,978.70	140,978.70	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	272	15,683.52	15,683.52	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
603172	浙江万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	2,086	41,427.96	37,673.16	-

	成	日									
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	740	10,478.40	11,995.40	-	
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	376	8,873.60	24,315.92	-	
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688472	阿特斯阳光电力	2023年6月2日	6个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	1,399	15,528.90	23,838.96	-	
688479	用友汽车信息科技	2023年5月4日	6个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	252	8,565.48	7,431.48	-	
688512	慧智微电子	2023年5月8日	6个月	新股 流通 受限	20.92	19.16	505	10,564.60	9,675.80	-	
688523	航天环宇科技	2023年5月26日	6个月	新股 流通 受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股 流通 受限	43.67	53.05	273	11,921.91	14,482.65	-	
688552	航	2023	6个月	新股	21.17	23.50	478	10,119.26	11,233.00	-	

	天南湖	年5月8日		流通受限						
688562	航天软件股份	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	385	11,650.10	9,752.05	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	132	17,925.60	15,894.12	-
688581	安杰思医学	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	89	11,196.20	10,504.67	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	430	11,498.20	17,492.40	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	868	9,704.24	12,664.12	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	95	11,958.60	8,245.05	-
688629	四川华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	308	7,786.24	9,199.96	-

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 2023 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 2023 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 2023 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的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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	84,195,346.40	-	-	-	84,195,346.40
结算备付金	5,355,079.78	-	-	-	5,355,079.78
存出保证金	-	-	-	8,160,506.40	8,160,506.40
交易性金融资产	11,197,767.95	-	-	-528,126,619.55	539,324,387.50
买入返售金融资产	14,993,130.42	-	-	-	14,993,130.42
应收股利	-	-	-	192,095.65	192,095.65
应收申购款	-	-	-	40,166,896.12	40,166,896.12
应收清算款	-	-	-	155,086.51	155,086.51
资产总计	115,741,324.55	-	-	-576,801,204.23	692,542,528.78
负债					

应付赎回款	-	-	-	260,018.83	260,018.83
应付管理人报酬	-	-	-	549,339.65	549,339.65
应付托管费	-	-	-	54,933.97	54,933.97
应付清算款	-	-	-	2,809.30	2,809.30
应付销售服务费	-	-	-	119,017.59	119,017.59
其他负债	-	-	-	150,033.50	150,033.50
负债总计	-	-	-	1,136,152.84	1,136,152.84
利率敏感度缺口	115,741,324.55	-	-	-575,665,051.39	691,406,375.94
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,918,165.25	-	-	-	14,918,165.25
结算备付金	6,445,753.12	-	-	-	6,445,753.12
存出保证金	-	-	-	1,311,072.00	1,311,072.00
交易性金融资产	10,471,304.11	-	-	-176,489,622.94	186,960,927.05
应收申购款	-	-	-	193,821.75	193,821.75
资产总计	31,835,222.48	-	-	-177,994,516.69	209,829,739.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,627.55	25,627.55
应付管理人报酬	-	-	-	277,920.45	277,920.45
应付托管费	-	-	-	27,792.03	27,792.03
应付清算款	-	-	-	347,198.92	347,198.92
应付销售服务费	-	-	-	28,465.73	28,465.73
其他负债	-	-	-	150,033.73	150,033.73
负债总计	-	-	-	857,038.41	857,038.41
利率敏感度缺口	31,835,222.48	-	-	-177,137,478.28	208,972,700.76

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 2023 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 1.62%（2022 年 12 月 31 日：5.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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 2023 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	-	16,322,155.84	-	16,322,155.84
应收股利	-	192,095.65	-	192,095.65
资产合计	-	16,514,251.49	-	16,514,251.49
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	-	16,514,251.49	-	16,514,251.49
项目	上年度末 2022 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	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53
资产合计	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53
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	-	10,703,308.53	-	10,703,308.53

#### 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汇率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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬	-816,107.79	-535,165.43

	值 5%		
	港币相对人民币升值 5%	816, 107. 79	535, 165. 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	528, 126, 619. 55	76. 38	176, 489, 622. 94	84. 46
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	528, 126, 619. 55	76. 38	176, 489, 622. 94	84. 46

##### 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	36, 432, 118. 60	10, 433, 447. 86

	业绩比较基准下降 5%	-36,432,118.60	-10,433,447.86
--	----------------	----------------	----------------

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	526,754,074.97	176,218,528.72
第二层次	11,882,497.99	10,471,304.11
第三层次	687,814.54	271,094.22
合计	539,324,387.50	186,960,927.05

###### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。本财务报表已于 2023 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	528,126,619.55	76.26
	其中：股票	528,126,619.55	76.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,197,767.95	1.62
	其中：债券	11,197,767.95	1.62
	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	14,993,130.42	2.16
	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	89,550,426.18	12.93
8	其他各项资产	48,674,584.68	7.03
9	合计	692,542,528.78	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 16,322,155.84 元，占基金资产净值比例 2.36%。

### 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	5,388,764.00	0.78
B	采矿业	9,540,944.00	1.38
C	制造业	361,770,810.76	52.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,613,429.24	2.11
E	建筑业	5,610,748.50	0.81
F	批发和零售业	22,164,565.45	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	6,306,618.20	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,991,618.48	7.23

J	金融业	9,367,418.78	1.35
K	房地产业	2,761,460.00	0.40
L	租赁和商务服务业	6,597,101.25	0.95
M	科学研究和技术服务业	4,168,113.55	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	9,048,817.64	1.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	641,358.00	0.09
Q	卫生和社会工作	714,243.86	0.10
R	文化、体育和娱乐业	2,841,742.00	0.41
S	综合	276,710.00	0.04
	合计	511,804,463.71	74.02

### 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	-	-
消费者非必需品	2,953,750.09	0.43
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	4,143,710.03	0.60
医疗保健	389,444.35	0.06
工业	-	-
信息技术	940,880.59	0.14
电信服务	7,177,900.12	1.04
公用事业	716,470.66	0.10
地产业	-	-
合计	16,322,155.84	2.36

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	000063	中兴通讯	172,700	7,864,758.00	1.14
2	002572	索菲亚	344,054	5,993,420.68	0.87
3	00700	腾讯控股	15,500	4,738,792.80	0.69
4	000568	泸州老窖	22,400	4,694,368.00	0.68
5	002643	万润股份	263,400	4,585,794.00	0.66
6	002555	三七互娱	125,400	4,373,952.00	0.63
7	300638	广和通	187,660	4,256,128.80	0.62
8	02328	中国财险	516,000	4,143,710.03	0.60
9	300502	新易盛	58,200	3,955,854.00	0.57
10	600519	贵州茅台	2,300	3,889,300.00	0.56
11	600886	国投电力	297,700	3,765,905.00	0.54
12	300308	中际旭创	25,100	3,700,995.00	0.54



13	688393	安必平医药	104,090	3,487,015.00	0.50
14	300747	锐科激光	106,500	3,246,120.00	0.47
15	000066	中国长城	233,900	3,234,837.00	0.47
16	603516	淳中科技	145,900	3,217,095.00	0.47
17	688503	聚和材料股份公司	32,400	3,159,000.00	0.46
18	600483	福能股份	270,300	3,121,965.00	0.45
19	002230	科大讯飞	45,900	3,119,364.00	0.45
20	300315	掌趣科技	395,800	3,087,240.00	0.45
21	301376	致欧科技	130,016	3,080,879.40	0.45
22	603369	今世缘	57,800	3,051,840.00	0.44
23	002212	天融信	296,500	2,876,050.00	0.42
24	688186	张家港广大特材	87,827	2,857,012.31	0.41
25	601100	恒立液压	43,700	2,811,221.00	0.41
26	603611	诺力股份	106,000	2,792,040.00	0.40
27	300540	蜀道装备	102,200	2,767,576.00	0.40
28	688687	北京凯因科技	93,754	2,765,743.00	0.40
29	603713	密尔克卫	30,100	2,681,609.00	0.39
30	002728	特一药业	171,920	2,621,780.00	0.38
31	601208	东材科技	202,500	2,571,750.00	0.37
32	300811	铂科新材	43,040	2,558,297.60	0.37
33	600732	爱旭股份	82,800	2,546,100.00	0.37
34	601138	工业富联	98,200	2,474,640.00	0.36
35	600729	重庆百货	78,600	2,471,184.00	0.36
36	300613	富瀚微	42,300	2,400,102.00	0.35
37	300413	芒果超媒	70,000	2,394,700.00	0.35
38	688223	晶科能源	167,000	2,348,020.00	0.34
39	002518	科士达	58,100	2,324,581.00	0.34
40	600452	DR 涪陵电力	108,358	2,305,858.24	0.33
41	000661	长春高新	16,600	2,262,580.00	0.33
42	601633	长城汽车	89,700	2,257,749.00	0.33
43	000888	峨眉山 A	195,800	2,243,868.00	0.32
44	000915	华特达因	63,300	2,233,857.00	0.32
45	688793	倍轻松科技	41,353	2,228,926.70	0.32
46	600116	三峡水利	244,000	2,215,520.00	0.32
47	300592	华凯易佰	80,700	2,196,654.00	0.32
48	002262	恩华药业	70,700	2,179,681.00	0.32
49	605168	三人行	25,200	2,165,688.00	0.31
50	603076	乐惠国际	45,100	2,156,231.00	0.31
51	000778	新兴铸管	520,200	2,122,416.00	0.31
52	000409	云鼎科技	211,400	2,111,886.00	0.31
53	603757	大元泵业	70,100	2,091,784.00	0.30
54	002833	弘亚数控	105,100	2,066,266.00	0.30

55	600132	重庆啤酒	22,400	2,064,384.00	0.30
56	600835	上海机电	116,000	1,992,880.00	0.29
57	03690	美团-W	17,610	1,985,671.09	0.29
58	002536	飞龙股份	129,400	1,941,000.00	0.28
59	688568	中科星图公司	24,060	1,938,754.80	0.28
60	603707	健友股份	142,500	1,923,750.00	0.28
61	002602	世纪华通	252,200	1,914,198.00	0.28
62	300419	浩丰科技	305,100	1,909,926.00	0.28
63	000333	美的集团	32,400	1,909,008.00	0.28
64	688658	悦康药业	90,200	1,877,062.00	0.27
65	603300	华铁应急	342,675	1,867,578.75	0.27
66	600353	旭光电子	224,680	1,842,376.00	0.27
67	603801	志邦家居	55,200	1,822,704.00	0.26
68	002959	小熊电器	21,500	1,795,250.00	0.26
69	002174	游族网络	105,800	1,777,440.00	0.26
70	600845	宝信软件	34,580	1,757,009.80	0.25
71	603040	新坐标	66,000	1,754,940.00	0.25
72	000977	浪潮信息	35,217	1,708,024.50	0.25
73	002129	TCL 中环	50,125	1,664,150.00	0.24
74	603551	奥普家居	128,600	1,662,798.00	0.24
75	002885	京泉华	74,560	1,628,390.40	0.24
76	605077	华康股份	61,100	1,617,928.00	0.23
77	000921	海信家电	59,700	1,608,915.00	0.23
78	000811	冰轮环境	101,500	1,599,640.00	0.23
79	300845	捷安高科	72,900	1,584,117.00	0.23
80	002234	民和股份	86,400	1,573,344.00	0.23
81	603477	巨星农牧	47,100	1,570,785.00	0.23
82	002334	英威腾	123,100	1,568,294.00	0.23
83	002714	牧原股份	36,900	1,555,335.00	0.22
84	688239	贵州航宇科技	22,200	1,552,890.00	0.22
85	002056	横店东磁	85,100	1,549,671.00	0.22
86	688569	铁科轨道	36,600	1,539,762.00	0.22
87	605123	派克新材	14,100	1,531,965.00	0.22
88	002311	海大集团	32,700	1,531,668.00	0.22
89	002439	启明星辰	51,100	1,520,736.00	0.22
90	688458	美芯晟科技	15,800	1,519,486.00	0.22
91	600941	中国移动	13,400	1,250,220.00	0.18
91	00941	中国移动	4,500	265,737.69	0.04
92	300443	金雷股份	42,700	1,513,715.00	0.22
93	000739	普洛药业	85,100	1,509,674.00	0.22
94	601168	西部矿业	143,200	1,505,032.00	0.22
95	603667	五洲新春	99,900	1,486,512.00	0.21
96	000860	顺鑫农业	44,100	1,485,729.00	0.21

97	002459	晶澳科技	35,439	1,477,806.30	0.21
98	603083	剑桥科技	23,300	1,465,337.00	0.21
99	603896	寿仙谷	32,800	1,453,040.00	0.21
100	300593	新雷能	63,100	1,445,621.00	0.21
101	002463	沪电股份	69,000	1,444,860.00	0.21
102	601699	潞安环能	88,500	1,444,320.00	0.21
103	688078	龙软科技	27,325	1,408,603.75	0.20
104	603105	芯能科技	83,000	1,401,870.00	0.20
105	600323	瀚蓝环境	71,800	1,359,174.00	0.20
106	300729	乐歌股份	75,020	1,338,356.80	0.19
107	601636	旗滨集团	155,000	1,336,100.00	0.19
108	002371	北方华创	4,206	1,336,035.90	0.19
109	601225	陕西煤业	72,800	1,324,232.00	0.19
110	600546	山煤国际	91,200	1,319,664.00	0.19
111	603059	倍加洁	57,900	1,316,646.00	0.19
112	300750	宁德时代	5,700	1,304,103.00	0.19
113	300532	今天国际	62,400	1,282,944.00	0.19
114	000733	振华科技	13,300	1,274,805.00	0.18
115	002737	葵花药业	51,600	1,255,944.00	0.18
116	002179	中航光电	27,670	1,254,834.50	0.18
117	605218	伟时电子	80,600	1,249,300.00	0.18
118	003011	海象新材	38,700	1,248,075.00	0.18
119	603328	依顿电子	149,700	1,239,516.00	0.18
120	603338	浙江鼎力	22,000	1,232,220.00	0.18
121	300037	新宙邦	23,600	1,224,604.00	0.18
122	300009	安科生物	121,300	1,213,000.00	0.18
123	00772	阅文集团	39,200	1,190,866.25	0.17
124	603529	爱玛科技	36,630	1,180,218.60	0.17
125	300274	阳光电源	10,100	1,177,963.00	0.17
126	003012	东鹏控股	140,700	1,138,263.00	0.16
127	603129	春风动力	7,000	1,133,300.00	0.16
128	301030	仕净科技	16,400	1,133,240.00	0.16
129	002508	老板电器	44,700	1,130,463.00	0.16
130	688590	新致软件	49,437	1,123,703.01	0.16
131	002727	一心堂	42,400	1,119,360.00	0.16
132	605196	华通线缆	156,300	1,112,856.00	0.16
133	603215	比依股份	61,700	1,106,898.00	0.16
134	601339	百隆东方	197,500	1,106,000.00	0.16
135	605009	豪悦护理	22,800	1,094,400.00	0.16
136	300408	三环集团	37,200	1,091,820.00	0.16
137	600522	中天科技	68,200	1,085,062.00	0.16
138	600276	恒瑞医药	22,600	1,082,540.00	0.16
139	688276	长春百克生物 科技	17,288	1,082,228.80	0.16

140	002880	卫光生物	28,700	1,081,990.00	0.16
141	688566	吉贝尔药业	27,428	1,069,966.28	0.15
142	601899	紫金矿业	92,700	1,053,999.00	0.15
143	300724	捷佳伟创	9,300	1,044,855.00	0.15
144	300832	新产业	17,700	1,044,300.00	0.15
145	603023	威帝股份	255,800	1,043,664.00	0.15
146	603209	兴通股份	49,020	1,039,714.20	0.15
147	688670	金迪克生物	22,080	1,039,526.40	0.15
148	601336	新华保险	28,100	1,033,237.00	0.15
149	603659	璞泰来	26,965	1,030,602.30	0.15
150	601021	春秋航空	17,700	1,017,219.00	0.15
151	000533	顺钠股份	238,900	1,015,325.00	0.15
152	002372	伟星新材	49,300	1,012,622.00	0.15
153	600963	岳阳林纸	137,100	1,010,427.00	0.15
154	002605	姚记科技	21,700	1,007,531.00	0.15
155	300779	惠城环保	18,900	1,007,181.00	0.15
156	603778	乾景园林	186,200	1,005,480.00	0.15
157	600488	津药药业	178,900	1,005,418.00	0.15
158	002469	三维化学	163,400	1,004,910.00	0.15
159	603811	诚意药业	80,480	1,000,366.40	0.14
160	688026	浩特生物股份	54,750	1,000,282.50	0.14
161	603810	丰山集团	72,000	991,440.00	0.14
162	603669	灵康药业	212,500	988,125.00	0.14
163	600988	赤峰黄金	73,400	987,964.00	0.14
164	300771	智莱科技	90,600	986,634.00	0.14
165	000626	远大控股	131,900	982,655.00	0.14
166	603429	集友股份	110,900	982,574.00	0.14
167	01024	快手-W	19,900	982,503.38	0.14
168	603444	吉比特	2,000	982,220.00	0.14
169	600725	云维股份	364,700	981,043.00	0.14
170	300417	南华仪器	91,300	980,562.00	0.14
171	002141	贤丰控股	298,000	980,420.00	0.14
172	000820	神雾节能	262,400	978,752.00	0.14
173	600746	江苏索普	149,500	976,235.00	0.14
174	300103	达刚控股	158,400	972,576.00	0.14
175	600053	九鼎投资	78,594	972,207.78	0.14
176	300405	科隆股份	177,600	971,472.00	0.14
177	300795	米奥会展	23,250	969,757.50	0.14
178	09868	小鹏汽车-W	21,000	968,079.00	0.14
179	300385	雪浪环境	158,100	967,572.00	0.14
180	300333	兆日科技	145,700	965,991.00	0.14
181	300389	艾比森	47,400	965,538.00	0.14
182	002271	东方雨虹	35,400	965,004.00	0.14

183	300819	聚杰微纤	70,300	963,813.00	0.14
184	300281	金明精机	179,600	962,656.00	0.14
185	603421	鼎信通讯	92,000	961,400.00	0.14
186	300004	南风股份	178,000	961,200.00	0.14
187	002887	绿茵生态	105,700	960,813.00	0.14
188	300126	锐奇股份	147,700	958,573.00	0.14
189	300521	爱司凯	75,000	957,750.00	0.14
190	000663	永安林业	78,500	956,130.00	0.14
191	600287	江苏舜天	185,200	946,372.00	0.14
192	300546	雄帝科技	51,300	945,459.00	0.14
193	002631	德尔未来	174,700	943,380.00	0.14
194	002767	先锋电子	67,500	942,975.00	0.14
195	002370	亚太药业	230,900	942,072.00	0.14
196	603214	爱婴室	57,900	942,033.00	0.14
197	002066	瑞泰科技	78,700	940,465.00	0.14
198	600272	开开实业	104,100	940,023.00	0.14
199	300387	富邦股份	129,000	939,120.00	0.14
200	002730	电光科技	98,000	938,840.00	0.14
201	600857	宁波中百	94,700	937,530.00	0.14
202	600807	济南高新	317,100	935,445.00	0.14
203	600128	弘业股份	113,500	932,970.00	0.13
204	003017	大洋生物	27,700	932,105.00	0.13
205	300411	金盾股份	142,000	930,100.00	0.13
206	001216	华瓷股份	70,600	929,096.00	0.13
207	300265	通光线缆	89,400	927,972.00	0.13
208	600004	白云机场	64,700	927,798.00	0.13
209	300462	华铭智能	78,900	926,286.00	0.13
210	002779	中坚科技	35,200	926,112.00	0.13
211	002616	长青集团	180,800	925,696.00	0.13
212	000554	泰山石油	164,200	924,446.00	0.13
213	600101	明星电力	97,100	923,421.00	0.13
214	300926	博俊科技	40,360	921,822.40	0.13
215	688335	复洁环保科技	37,455	919,145.70	0.13
216	600426	华鲁恒升	30,000	918,900.00	0.13
217	300034	钢研高纳	23,200	913,848.00	0.13
218	300717	华信新材	53,500	912,175.00	0.13
219	300316	晶盛机电	12,826	909,363.40	0.13
220	603602	纵横通信	73,900	908,231.00	0.13
221	300838	浙江力诺	49,600	906,192.00	0.13
222	688120	华海清科	3,576	901,330.80	0.13
223	603090	宏盛股份	40,500	901,125.00	0.13
224	002850	科达利	6,800	899,300.00	0.13
225	002356	赫美集团	206,200	899,032.00	0.13

226	002733	雄韬股份	51,800	895,622.00	0.13
227	002533	金杯电工	109,500	893,520.00	0.13
228	688529	大连豪森股份	34,000	888,080.00	0.13
229	301068	大地海洋	26,400	887,304.00	0.13
230	000922	佳电股份	66,800	879,088.00	0.13
231	002709	天赐材料	21,175	872,198.25	0.13
232	688097	博众精工科技	27,900	847,044.00	0.12
233	603606	东方电缆	17,200	843,316.00	0.12
234	601939	建设银行	133,400	835,084.00	0.12
235	300212	易华录	25,100	834,073.00	0.12
236	301257	普蕊斯	14,800	831,760.00	0.12
237	601288	农业银行	235,000	829,550.00	0.12
238	601233	桐昆股份	62,500	828,125.00	0.12
239	688550	瑞联新材料	20,820	824,472.00	0.12
240	002648	卫星化学	54,700	818,312.00	0.12
241	002517	恺英网络	51,600	812,184.00	0.12
242	688981	中芯国际	15,900	803,268.00	0.12
243	002003	伟星股份	85,700	802,152.00	0.12
244	600566	济川药业	27,600	801,504.00	0.12
245	002966	苏州银行	122,200	800,410.00	0.12
246	002777	久远银海	22,300	790,981.00	0.11
247	688019	安集科技	4,791	789,700.53	0.11
248	301256	华融化学	89,100	789,426.00	0.11
249	300723	一品红	26,900	788,170.00	0.11
250	601668	中国建筑	137,200	787,528.00	0.11
251	300908	仲景食品	17,300	784,555.00	0.11
252	688676	海南金盘智能 科技	25,900	784,511.00	0.11
253	600098	广州发展	126,700	783,006.00	0.11
254	600761	安徽合力	39,200	781,256.00	0.11
255	002937	兴瑞科技	31,700	779,820.00	0.11
256	603889	新澳股份	103,680	778,636.80	0.11
257	000404	长虹华意	112,500	778,500.00	0.11
258	603093	南华期货	71,400	777,546.00	0.11
259	603711	香飘飘	37,700	773,981.00	0.11
260	300033	同花顺	4,400	771,232.00	0.11
261	300059	东方财富	54,240	770,208.00	0.11
262	003006	百亚股份	44,200	763,776.00	0.11
263	002674	兴业科技	61,200	755,820.00	0.11
264	002829	星网宇达	17,200	755,596.00	0.11
265	688697	纽威数控装备	28,700	741,321.00	0.11
266	301004	嘉益股份	19,100	741,080.00	0.11
267	300418	昆仑万维	18,300	737,124.00	0.11
268	600085	同仁堂	12,700	731,012.00	0.11

269	002050	三花智控	23,700	717,162.00	0.10
270	01071	华电国际电力股份	190,000	716,470.66	0.10
271	300842	帝科股份	7,800	713,232.00	0.10
272	002790	瑞尔特	74,200	712,320.00	0.10
273	002389	航天彩虹	32,000	710,720.00	0.10
274	600129	太极集团	11,900	707,931.00	0.10
275	002831	裕同科技	28,800	702,432.00	0.10
276	000962	东方钽业	57,300	701,925.00	0.10
277	600570	恒生电子	15,800	699,782.00	0.10
278	605377	华旺科技	38,600	696,730.00	0.10
279	688525	佰维存储	8,700	695,043.00	0.10
280	603993	洛阳钼业	130,100	693,433.00	0.10
281	000516	国际医学	82,100	690,461.00	0.10
282	002772	众兴菌业	61,000	689,300.00	0.10
283	300745	欣锐科技	15,600	689,052.00	0.10
284	600547	山东黄金	29,300	687,964.00	0.10
285	688636	智明达电子	12,500	687,500.00	0.10
286	002917	金奥博	55,500	685,980.00	0.10
287	300130	新国都	24,100	682,753.00	0.10
288	002027	分众传媒	100,200	682,362.00	0.10
289	688103	国力股份	11,346	679,738.86	0.10
290	300491	通合科技	23,600	677,320.00	0.10
291	002957	科瑞技术	33,300	674,991.00	0.10
292	603676	卫信康	48,700	673,034.00	0.10
293	688305	科德数控	6,700	671,742.00	0.10
294	600066	宇通客车	45,100	664,774.00	0.10
295	688722	同益中新材料	35,605	660,116.70	0.10
296	002039	黔源电力	46,900	659,883.00	0.10
297	603878	武进不锈	77,372	653,793.40	0.09
298	000014	沙河股份	57,000	652,080.00	0.09
299	600251	冠农股份	72,200	651,966.00	0.09
300	603699	纽威股份	43,600	648,768.00	0.09
301	603929	亚翔集成	38,560	647,808.00	0.09
302	300161	华中数控	12,100	647,592.00	0.09
303	002057	中钢天源	61,600	646,800.00	0.09
304	688291	金橙子科技	20,400	645,864.00	0.09
305	600833	第一医药	46,400	644,960.00	0.09
306	002046	国机精工	50,500	644,380.00	0.09
307	605098	行动教育	16,200	641,358.00	0.09
308	002352	顺丰控股	14,200	640,278.00	0.09
309	000683	远兴能源	88,500	636,315.00	0.09
310	300407	凯发电气	69,400	633,622.00	0.09
311	300280	紫天科技	13,200	630,564.00	0.09

312	601600	中国铝业	114,800	630,252.00	0.09
313	300951	博硕科技	11,450	625,513.50	0.09
314	300882	万胜智能	22,000	624,360.00	0.09
315	600984	建设机械	137,900	623,308.00	0.09
316	605598	上海港湾	11,800	621,388.00	0.09
317	001979	招商蛇口	47,600	620,228.00	0.09
318	600592	龙溪股份	58,400	619,040.00	0.09
319	603199	九华旅游	17,900	618,445.00	0.09
320	003000	劲仔食品	49,000	616,910.00	0.09
321	603109	神驰机电	34,400	614,040.00	0.09
322	300622	博士眼镜	26,000	613,600.00	0.09
323	603586	金麒麟	38,200	610,054.00	0.09
324	301391	卡莱特	5,200	609,284.00	0.09
325	600572	康恩贝	88,700	607,595.00	0.09
326	300812	易天股份	24,300	607,500.00	0.09
327	002448	中原内配	86,300	604,100.00	0.09
328	002130	沃尔核材	74,000	600,880.00	0.09
329	688698	伟创电气	15,000	599,700.00	0.09
330	002852	道道全	46,300	598,659.00	0.09
331	603081	大丰实业	32,500	597,350.00	0.09
332	001255	博菲电气	15,600	594,672.00	0.09
333	603357	设计总院	56,500	593,250.00	0.09
334	603217	元利科技	22,900	589,675.00	0.09
335	300105	龙源技术	87,400	586,454.00	0.08
336	600861	北京人力	25,240	585,568.00	0.08
337	300718	长盛轴承	26,200	582,950.00	0.08
338	603161	科华控股	40,000	582,800.00	0.08
339	301129	瑞纳智能	7,900	581,993.00	0.08
340	600490	鹏欣资源	157,500	579,600.00	0.08
341	688156	路德环境	20,200	579,134.00	0.08
342	000729	燕京啤酒	46,400	578,608.00	0.08
343	301085	亚康股份	8,200	578,428.00	0.08
344	301328	维峰电子	10,150	577,941.00	0.08
345	688621	阳光诺和	9,800	576,436.00	0.08
346	300349	金卡智能	41,500	576,020.00	0.08
347	688143	长盈通光电	15,220	573,794.00	0.08
348	603163	圣晖系统集成 集团	12,450	570,583.50	0.08
349	600686	金龙汽车	69,800	568,172.00	0.08
350	688668	鼎通科技	5,800	567,240.00	0.08
351	688111	金山办公	1,200	566,664.00	0.08
352	605016	百龙创园	22,880	566,508.80	0.08
353	000534	万泽股份	33,600	563,472.00	0.08
354	600926	杭州银行	47,800	561,650.00	0.08



355	301162	国能日新	7,100	560,048.00	0.08
356	688085	三友医疗	21,131	554,900.06	0.08
357	600663	陆家嘴	56,100	553,707.00	0.08
358	600458	时代新材	46,100	552,739.00	0.08
359	03888	金山软件	19,400	551,795.81	0.08
360	605289	罗曼股份	14,400	551,664.00	0.08
361	002338	奥普光电	12,900	543,735.00	0.08
362	301286	侨源股份	18,400	542,800.00	0.08
363	300262	巴安水务	203,300	540,778.00	0.08
364	688601	力芯微股份	11,321	533,219.10	0.08
365	000715	中兴商业	71,800	530,602.00	0.08
366	603909	建发合诚	38,950	519,203.50	0.08
367	300294	博雅生物	14,200	515,176.00	0.07
368	688337	普源精电	8,000	482,080.00	0.07
369	300689	澄天伟业	20,600	481,422.00	0.07
370	002731	萃华珠宝	33,500	478,045.00	0.07
371	300777	中简科技	10,100	477,326.00	0.07
372	301092	争光股份	18,100	473,858.00	0.07
373	002136	安纳达	41,500	472,270.00	0.07
374	300117	嘉寓股份	152,300	472,130.00	0.07
375	603856	东宏股份	35,700	470,883.00	0.07
376	000913	钱江摩托	25,800	470,334.00	0.07
377	600379	宝光股份	45,900	468,180.00	0.07
378	603227	雪峰科技	56,300	466,164.00	0.07
379	300807	天迈科技	15,900	465,075.00	0.07
380	301106	骏成科技	13,000	463,060.00	0.07
381	002877	智能自控	45,600	462,384.00	0.07
382	603027	千禾味业	21,800	460,416.00	0.07
383	688012	中微半导体设备	2,942	460,275.90	0.07
384	003008	开普检测	16,000	459,680.00	0.07
385	000928	中钢国际	47,500	458,375.00	0.07
386	300950	德固特	21,600	457,920.00	0.07
387	002611	东方精工	79,700	457,478.00	0.07
388	603177	德创环保	36,500	455,520.00	0.07
389	002270	华明装备	41,400	453,330.00	0.07
390	600971	恒源煤电	58,000	451,820.00	0.07
391	301076	新瀚新材	23,000	451,260.00	0.07
392	300270	中威电子	58,800	449,820.00	0.07
393	003036	泰坦股份	33,300	448,884.00	0.06
394	002161	远望谷	86,100	448,581.00	0.06
395	002940	昂利康	23,300	447,593.00	0.06
396	300711	广哈通信	29,900	447,304.00	0.06
397	002629	仁智股份	122,200	446,030.00	0.06

398	002624	完美世界	26,400	445,896.00	0.06
399	600250	南纺股份	71,700	445,257.00	0.06
400	300107	建新股份	90,800	444,012.00	0.06
401	002783	凯龙股份	53,200	443,688.00	0.06
402	603266	天龙股份	31,800	442,338.00	0.06
403	600036	招商银行	13,500	442,260.00	0.06
404	600356	恒丰纸业	56,400	441,612.00	0.06
405	603158	腾龙股份	57,500	440,450.00	0.06
406	300757	罗博特科	5,000	440,050.00	0.06
407	688350	富淼科技	25,900	440,041.00	0.06
408	000423	东阿阿胶	8,200	438,290.00	0.06
409	300157	恒泰艾普	136,100	438,242.00	0.06
410	600157	永泰能源	304,600	432,532.00	0.06
411	300490	华自科技	25,100	430,716.00	0.06
412	603998	方盛制药	34,100	430,001.00	0.06
413	002072	凯瑞德	67,900	425,054.00	0.06
414	002475	立讯精密	12,800	415,360.00	0.06
415	301367	怡和嘉业	2,800	415,352.00	0.06
416	300510	金冠股份	59,500	415,310.00	0.06
417	002560	通达股份	43,600	415,072.00	0.06
418	002646	天佑德酒	30,600	412,794.00	0.06
419	600509	天富能源	51,900	405,339.00	0.06
420	600660	福耀玻璃	11,300	405,105.00	0.06
421	603737	三棵树	6,160	402,987.20	0.06
422	002142	宁波银行	15,800	399,740.00	0.06
423	601318	中国平安	8,600	399,040.00	0.06
424	601628	中国人寿	11,400	398,544.00	0.06
425	301188	力诺特玻	23,200	396,256.00	0.06
426	01548	金斯瑞生物科技	24,000	389,444.35	0.06
427	02382	舜宇光学科技	5,400	389,084.78	0.06
428	300384	三联虹普	22,400	380,576.00	0.06
429	688516	奥特维科技	2,000	376,800.00	0.05
430	601601	中国太保	14,500	376,710.00	0.05
431	600327	大东方	81,000	376,650.00	0.05
432	300664	鹏鹞环保	66,100	374,126.00	0.05
433	002920	德赛西威	2,400	373,944.00	0.05
434	603000	人民网	12,800	373,760.00	0.05
435	603187	海容冷链	18,420	368,215.80	0.05
436	688376	美埃科技	9,300	367,257.00	0.05
437	300403	汉宇集团	33,200	364,868.00	0.05
438	300275	梅安森	25,400	353,060.00	0.05
439	301307	美利信	10,404	350,776.44	0.05
440	688551	科威尔股份	5,300	347,574.00	0.05

441	600285	羚锐制药	21,400	343,684.00	0.05
442	603800	道森股份	12,500	340,000.00	0.05
443	002979	雷赛智能	14,200	337,392.00	0.05
444	300314	戴维医疗	15,800	334,012.00	0.05
445	002422	科伦药业	11,200	332,416.00	0.05
446	688310	迈得医疗	10,100	330,977.00	0.05
447	601689	拓普集团	4,100	330,870.00	0.05
448	603867	新化股份	8,110	328,455.00	0.05
449	002353	杰瑞股份	13,000	326,690.00	0.05
450	688126	上海硅产业集团	15,600	326,040.00	0.05
451	300580	贝斯特	13,350	324,271.50	0.05
452	002658	雪迪龙	39,700	322,761.00	0.05
453	688015	交控科技	18,400	321,448.00	0.05
454	300796	贝斯美	26,700	321,201.00	0.05
455	002595	豪迈科技	9,100	319,683.00	0.05
456	002821	凯莱英	2,700	318,222.00	0.05
457	600433	冠豪高新	92,600	315,766.00	0.05
458	600785	新华百货	23,100	313,929.00	0.05
459	300700	岱勒新材	16,400	312,420.00	0.05
460	600089	特变电工	14,000	312,060.00	0.05
461	002870	香山股份	9,400	311,798.00	0.05
462	300918	南山智尚	22,700	311,671.00	0.05
463	300900	广联航空	10,800	311,148.00	0.05
464	688588	凌志软件	19,800	307,890.00	0.04
465	600309	万华化学	3,500	307,440.00	0.04
466	301266	宇邦新材	4,300	302,333.00	0.04
467	002993	奥海科技	8,900	301,888.00	0.04
468	600419	天润乳业	18,300	296,826.00	0.04
469	688121	卓然技术	7,900	295,460.00	0.04
470	300124	汇川技术	4,500	288,945.00	0.04
471	300539	横河精密	19,400	287,314.00	0.04
472	001215	千味央厨	4,300	285,907.00	0.04
473	002891	中宠股份	11,700	282,438.00	0.04
474	688127	蓝特光学	16,000	282,080.00	0.04
475	300688	创业黑马	8,100	281,151.00	0.04
476	688768	容知日新	3,516	280,822.92	0.04
477	300586	美联新材	21,600	278,856.00	0.04
478	605167	利柏特	28,700	277,816.00	0.04
479	688300	联瑞新材	5,921	276,806.75	0.04
480	600212	绿能慧充	29,500	276,710.00	0.04
481	603165	荣晟环保	17,200	275,888.00	0.04
482	603590	康辰药业	8,300	275,560.00	0.04
483	000521	长虹美菱	35,800	273,512.00	0.04

484	000425	徐工机械	40,300	272,831.00	0.04
485	301058	中粮科工	19,500	272,025.00	0.04
486	300235	方直科技	21,500	267,675.00	0.04
487	000923	河钢资源	19,800	267,300.00	0.04
488	300517	海波重科	19,300	267,112.00	0.04
489	300129	泰胜风能	27,500	263,725.00	0.04
490	002918	蒙娜丽莎	17,000	262,480.00	0.04
491	688158	优刻得科技	13,800	260,544.00	0.04
492	688255	凯尔达机器人	7,680	260,044.80	0.04
493	300654	世纪天鸿	19,800	259,776.00	0.04
494	300624	万兴科技	2,200	257,730.00	0.04
495	603639	海利尔	14,300	256,256.00	0.04
496	603121	华培动力	28,700	255,717.00	0.04
497	688072	拓荆科技	600	255,582.00	0.04
498	688217	上海睿昂基因	6,000	240,900.00	0.03
499	002126	银轮股份	13,200	233,640.00	0.03
500	002705	新宝股份	12,913	232,821.39	0.03
501	002006	精功科技	10,400	224,328.00	0.03
502	600584	长电科技	7,100	221,307.00	0.03
503	002897	意华股份	4,600	212,888.00	0.03
504	603486	科沃斯	2,700	209,979.00	0.03
505	688618	三旺通信	2,970	201,128.40	0.03
506	002092	中泰化学	30,900	199,305.00	0.03
507	600346	恒力石化	13,900	199,187.00	0.03
508	688582	芯动联科	4,295	198,567.65	0.03
509	600976	健民集团	2,400	185,016.00	0.03
510	002315	焦点科技	4,600	184,000.00	0.03
511	001269	欧晶科技	2,500	183,825.00	0.03
512	603368	柳药集团	7,400	182,854.00	0.03
513	603589	口子窖	3,700	182,595.00	0.03
514	000999	华润三九	3,000	181,980.00	0.03
515	600812	华北制药	29,600	165,464.00	0.02
516	301486	致尚科技	2,717	156,662.22	0.02
517	002123	梦网科技	11,700	155,493.00	0.02
518	000338	潍柴动力	12,200	152,012.00	0.02
519	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
520	688373	盟科药业	15,700	134,235.00	0.02
521	002965	祥鑫科技	2,400	133,632.00	0.02
522	603859	能科科技	2,600	132,938.00	0.02
523	301210	金杨股份	2,567	131,208.99	0.02
524	603169	兰石重装	17,400	129,456.00	0.02
525	688575	亚辉龙生物	7,000	129,150.00	0.02
526	688378	奥来德光电	2,500	123,500.00	0.02

527	002155	湖南黄金	9,900	120,780.00	0.02
528	600489	中金黄金	11,600	119,828.00	0.02
529	600150	中国船舶	3,600	118,476.00	0.02
530	300068	南都电源	6,100	118,096.00	0.02
531	002446	盛路通信	12,400	117,180.00	0.02
532	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
533	688278	特宝生物	2,642	116,010.22	0.02
534	601390	中国中铁	15,200	115,216.00	0.02
535	002153	石基信息	8,150	114,100.00	0.02
536	601800	中国交建	10,400	113,464.00	0.02
537	601865	福莱特	2,900	111,679.00	0.02
538	000938	紫光股份	3,500	111,475.00	0.02
539	600487	亨通光电	7,500	109,950.00	0.02
540	002544	普天科技	4,700	107,630.00	0.02
541	300133	华策影视	15,000	106,350.00	0.02
542	603267	鸿远电子	1,600	104,480.00	0.02
543	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
544	002151	北斗星通	2,900	101,964.00	0.01
545	603225	新凤鸣	9,200	101,660.00	0.01
546	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
547	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.01
548	600529	山东药玻	3,500	95,270.00	0.01
549	688596	正帆科技	2,200	95,260.00	0.01
550	603899	晨光股份	2,100	93,744.00	0.01
551	688200	华峰测控	606	92,718.00	0.01
552	603179	新泉股份	2,100	92,169.00	0.01
553	002929	润建股份	2,100	91,161.00	0.01
554	002949	华阳国际	6,300	89,586.00	0.01
555	688433	华曙高科	2,600	88,400.00	0.01
556	688472	阿特斯阳光电力	4,913	88,356.00	0.01
557	002007	华兰生物	3,900	87,399.00	0.01
558	301312	智立方	800	84,928.00	0.01
559	002851	麦格米特	2,300	83,881.00	0.01
560	002275	桂林三金	4,500	81,045.00	0.01
561	000681	视觉中国	4,400	80,916.00	0.01
562	688009	中国通号	13,800	80,040.00	0.01
563	688031	星环科技	600	79,944.00	0.01
564	000657	中钨高新	8,200	79,458.00	0.01
565	688007	光峰科技	3,800	79,230.00	0.01
566	600557	康缘药业	2,880	79,084.80	0.01
567	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
568	000989	九芝堂	5,300	73,352.00	0.01
569	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01

570	002600	领益智造	10,400	71,864.00	0.01
571	688037	芯源微电子	400	68,380.00	0.01
572	601137	博威合金	4,300	66,908.00	0.01
573	001311	多利科技	1,100	63,173.00	0.01
574	603305	旭升集团	2,200	61,314.00	0.01
575	688533	上声电子股份	1,300	60,749.00	0.01
576	002332	仙琚制药	4,400	58,300.00	0.01
577	000625	长安汽车	4,500	58,185.00	0.01
578	600528	中铁工业	5,700	56,316.00	0.01
579	603997	继峰股份	3,900	55,770.00	0.01
580	002865	钧达股份	358	54,605.74	0.01
581	600549	厦门钨业	2,400	45,672.00	0.01
582	000630	铜陵有色	15,500	44,795.00	0.01
583	601126	四方股份	2,900	44,051.00	0.01
584	688249	晶合集成	2,086	37,673.16	0.01
585	688361	中科飞测	376	24,315.92	0.00
586	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
587	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
588	301325	曼恩斯特	178	19,215.10	0.00
589	301358	湖南裕能	435	18,657.15	0.00
590	301310	鑫宏业	269	17,600.67	0.00
591	301301	川宁生物	1,904	17,059.84	0.00
592	300672	国科微	200	16,670.00	0.00
593	300776	帝尔激光	256	16,614.40	0.00
594	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
595	688576	西山科技	132	15,894.12	0.00
596	603596	伯特利	200	15,852.00	0.00
597	301246	宏源药业	509	15,631.39	0.00
598	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
599	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
600	688543	国科军工	273	14,482.65	0.00
601	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
602	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
603	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
604	301382	蜂助手	389	12,774.76	0.00
605	688593	新相微	868	12,664.12	0.00
606	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
607	301317	鑫磊股份	470	12,299.90	0.00
608	301262	海看股份	475	12,112.50	0.00
609	688334	西高院	740	11,995.40	0.00
610	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
611	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
612	688552	航天南湖	478	11,233.00	0.00

613	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
614	301305	朗坤环境	556	10,947.64	0.00
615	301332	德尔玛	778	10,681.94	0.00
616	688581	安杰思医学	89	10,504.67	0.00
617	688570	天玛智控	385	9,752.05	0.00
618	301260	格力博	412	9,735.56	0.00
619	688512	慧智微电子	505	9,675.80	0.00
620	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
621	301439	泓淋电力	551	9,311.90	0.00
622	688631	莱斯信息	308	9,199.96	0.00
623	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
624	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
625	301323	新莱福	220	8,659.20	0.00
626	301277	新天地	442	8,623.42	0.00
627	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
628	688623	双元科技	95	8,245.05	0.00
629	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
630	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
631	301345	涛涛车业	163	7,602.32	0.00
632	688479	用友汽车信息科技	252	7,431.48	0.00
633	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
634	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
635	301373	凌玮科技	204	6,497.40	0.00
636	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
637	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
638	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
639	603172	浙江万丰股份	122	1,967.86	0.00
640	002139	拓邦股份	1	13.05	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	600546	山煤国际	21,401,903.00	10.24
2	688111	金山办公	20,122,517.13	9.63
3	002459	晶澳科技	18,944,278.20	9.07
4	002230	科大讯飞	18,759,657.00	8.98
5	002271	东方雨虹	18,482,344.29	8.84
6	300593	新雷能	18,403,817.62	8.81
7	000568	泸州老窖	18,063,644.00	8.64
8	300573	兴齐眼药	17,873,285.00	8.55
9	600487	亨通光电	17,821,979.00	8.53

10	300750	宁德时代	17,786,552.00	8.51
11	000661	长春高新	16,386,620.00	7.84
12	600988	赤峰黄金	15,208,535.00	7.28
13	002841	视源股份	14,405,097.00	6.89
14	601225	陕西煤业	14,390,007.00	6.89
15	002371	北方华创	13,703,511.80	6.56
16	002179	中航光电	13,343,290.78	6.39
17	600483	福能股份	12,943,228.00	6.19
18	600050	中国联通	12,535,628.00	6.00
19	600188	兖矿能源	12,007,643.00	5.75
20	603659	璞泰来	11,896,022.69	5.69
21	002508	老板电器	11,816,299.00	5.65
22	300491	通合科技	11,569,076.00	5.54
23	688358	祥生医疗科技	11,509,462.29	5.51
24	600426	华鲁恒升	11,228,508.00	5.37
25	688223	晶科能源	11,106,322.65	5.31
26	600570	恒生电子	10,901,096.80	5.22
27	601702	华峰铝业	10,831,584.00	5.18
28	600028	中国石化	10,771,371.00	5.15
29	600276	恒瑞医药	10,274,324.00	4.92
30	603701	德宏股份	10,137,211.45	4.85
31	300308	中际旭创	9,613,857.40	4.60
32	300217	东方电热	9,561,987.00	4.58
33	600230	沧州大化	9,242,129.00	4.42
34	300551	古鳌科技	9,152,385.00	4.38
35	300502	新易盛	9,053,109.00	4.33
36	601208	东材科技	8,932,876.00	4.27
37	601636	旗滨集团	8,708,909.00	4.17
38	688278	特宝生物	8,585,309.73	4.11
39	000063	中兴通讯	8,577,307.00	4.10
40	300451	创业慧康	8,464,153.00	4.05
41	300638	广和通	8,405,243.20	4.02
42	000425	徐工机械	8,371,590.00	4.01
43	002865	钧达股份	8,269,700.09	3.96
44	000938	紫光股份	8,168,734.00	3.91
45	000516	国际医学	8,141,035.00	3.90
46	000333	美的集团	8,075,522.00	3.86
47	601699	潞安环能	8,071,806.00	3.86
48	600886	国投电力	8,046,794.00	3.85
49	600702	舍得酒业	8,013,906.24	3.83
50	002050	三花智控	7,925,621.00	3.79
51	601899	紫金矿业	7,913,332.00	3.79
52	002324	普利特	7,905,855.00	3.78



53	002129	TCL 中环	7,829,716.00	3.75
54	300014	亿纬锂能	7,773,643.00	3.72
55	600557	康缘药业	7,689,391.60	3.68
56	603198	迎驾贡酒	7,607,654.00	3.64
57	300170	汉得信息	7,597,911.11	3.64
58	603379	三美股份	7,537,782.00	3.61
59	300274	阳光电源	7,431,769.20	3.56
60	603378	亚士创能	7,235,509.94	3.46
61	002043	兔宝宝	7,228,746.98	3.46
62	300122	智飞生物	7,174,102.00	3.43
63	002372	伟星新材	7,064,412.93	3.38
64	603477	巨星农牧	7,011,706.00	3.36
65	603516	淳中科技	6,975,440.00	3.34
66	300450	先导智能	6,792,195.00	3.25
67	601728	中国电信	6,763,477.00	3.24
68	300316	晶盛机电	6,695,897.74	3.20
69	301236	软通动力	6,647,441.50	3.18
70	000921	海信家电	6,597,147.21	3.16
71	603979	金诚信	6,576,720.65	3.15
72	605117	德业股份	6,542,250.00	3.13
73	002643	万润股份	6,540,513.00	3.13
74	600522	中天科技	6,442,646.00	3.08
75	002572	索菲亚	6,396,412.24	3.06
76	002517	恺英网络	6,322,512.02	3.03
77	300454	深信服	6,240,254.00	2.99
78	603859	能科科技	6,227,352.00	2.98
79	300567	精测电子	6,176,099.00	2.96
80	300496	中科创达	6,155,741.40	2.95
81	600519	贵州茅台	6,021,822.00	2.88
82	603187	海容冷链	6,013,964.85	2.88
83	600642	申能股份	6,001,193.00	2.87
84	688046	药康生物	5,989,359.54	2.87
85	000928	中钢国际	5,979,282.00	2.86
86	301162	国能日新	5,941,693.00	2.84
87	688677	青岛海泰新光	5,895,746.00	2.82
88	603529	爱玛科技	5,854,835.00	2.80
89	603737	三棵树	5,817,328.23	2.78
90	002463	沪电股份	5,720,832.64	2.74
91	688023	安恒信息	5,706,658.22	2.73
92	002518	科士达	5,688,348.00	2.72
93	603611	诺力股份	5,576,257.00	2.67
94	600026	中远海能	5,567,525.00	2.66
95	688319	欧林生物	5,530,709.36	2.65

96	600801	华新水泥	5,518,988.00	2.64
97	600399	抚顺特钢	5,508,850.00	2.64
98	300260	新莱应材	5,464,871.00	2.62
99	688687	北京凯因科技	5,444,349.60	2.61
100	300369	绿盟科技	5,426,873.41	2.60
101	600060	海信视像	5,421,466.00	2.59
102	002531	天顺风能	5,331,883.00	2.55
103	603369	今世缘	5,281,603.00	2.53
104	603255	鼎际得股份	5,280,972.34	2.53
105	300724	捷佳伟创	5,265,956.27	2.52
106	601618	中国中冶	5,246,939.00	2.51
107	300911	亿田智能	5,209,101.00	2.49
108	300996	普联软件	5,114,504.00	2.45
109	002007	华兰生物	5,102,567.00	2.44
110	002555	三七互娱	5,094,831.00	2.44
111	300394	天孚通信	5,074,931.00	2.43
112	601100	恒立液压	5,038,986.00	2.41
113	603197	保隆科技	5,035,818.79	2.41
114	000932	华菱钢铁	5,031,818.00	2.41
115	688012	中微半导体设备	4,911,732.61	2.35
116	300481	濮阳惠成	4,905,137.00	2.35
117	300034	钢研高纳	4,901,601.00	2.35
118	300592	华凯易佰	4,850,185.00	2.32
119	000400	许继电气	4,842,791.00	2.32
120	600309	万华化学	4,832,035.00	2.31
121	300566	激智科技	4,822,271.00	2.31
122	600989	宝丰能源	4,732,202.00	2.26
123	300762	上海瀚讯	4,649,433.00	2.22
124	603128	华贸物流	4,648,781.00	2.22
125	603639	海利尔	4,641,022.00	2.22
126	600926	杭州银行	4,608,784.00	2.21
127	600023	浙能电力	4,602,295.00	2.20
128	300747	锐科激光	4,531,314.65	2.17
129	002389	航天彩虹	4,460,240.00	2.13
130	600004	白云机场	4,394,177.00	2.10
131	002929	润建股份	4,370,207.00	2.09
132	600085	同仁堂	4,367,904.00	2.09
133	002777	久远银海	4,321,994.00	2.07
134	300166	东方国信	4,310,713.00	2.06
135	002605	姚记科技	4,306,995.00	2.06
136	688107	安路科技	4,296,135.24	2.06
137	000893	亚钾国际	4,267,761.00	2.04
138	601939	建设银行	4,225,419.84	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	300573	兴齐眼药	20,782,347.00	9.95
2	600546	山煤国际	20,142,759.00	9.64
3	688111	金山办公	20,000,691.58	9.57
4	300750	宁德时代	18,697,133.60	8.95
5	002271	东方雨虹	18,599,962.60	8.90
6	600487	亨通光电	18,077,302.00	8.65
7	002459	晶澳科技	17,429,182.40	8.34
8	300593	新雷能	17,184,814.64	8.22
9	002230	科大讯飞	16,094,796.72	7.70
10	002179	中航光电	14,905,074.90	7.13
11	002841	视源股份	14,789,061.65	7.08
12	600988	赤峰黄金	14,211,985.00	6.80
13	002371	北方华创	14,198,847.35	6.79
14	000661	长春高新	14,039,071.00	6.72
15	601225	陕西煤业	13,419,908.00	6.42
16	01171	兖矿能源	933,064.10	0.45
17	600188	兖矿能源	12,419,643.00	5.94
18	000568	泸州老窖	13,340,479.00	6.38
19	600050	中国联通	12,723,456.51	6.09
20	300491	通合科技	12,138,833.00	5.81
21	603659	璞泰来	11,549,767.30	5.53
22	688358	祥生医疗科技	11,433,409.67	5.47
23	002508	老板电器	10,872,913.00	5.20
24	601702	华峰铝业	10,828,130.00	5.18
25	600028	中国石化	10,775,347.00	5.16
26	600557	康缘药业	10,600,272.00	5.07
27	600570	恒生电子	10,517,279.10	5.03
28	600426	华鲁恒升	10,441,387.00	5.00
29	688278	特宝生物	10,313,955.79	4.94
30	603701	德宏股份	10,179,568.66	4.87
31	300551	古鳌科技	10,172,850.00	4.87
32	600276	恒瑞医药	9,969,970.60	4.77
33	002043	兔宝宝	9,794,084.00	4.69
34	300217	东方电热	9,758,918.00	4.67
35	600230	沧州大化	9,708,721.60	4.65
36	600483	福能股份	9,638,350.00	4.61
37	002865	钧达股份	9,189,720.56	4.40
38	300451	创业慧康	9,082,406.20	4.35

39	600702	舍得酒业	8,715,893.64	4.17
40	688223	晶科能源	8,325,574.34	3.98
41	300308	中际旭创	8,320,994.00	3.98
42	000938	紫光股份	8,299,362.00	3.97
43	002129	TCL 中环	8,285,045.00	3.96
44	000425	徐工机械	8,013,741.00	3.83
45	300502	新易盛	7,911,507.00	3.79
46	002463	沪电股份	7,799,087.60	3.73
47	300170	汉得信息	7,785,299.00	3.73
48	603379	三美股份	7,740,319.00	3.70
49	603198	迎驾贡酒	7,622,993.00	3.65
50	601899	紫金矿业	7,536,278.00	3.61
51	300496	中科创达	7,516,934.88	3.60
52	002050	三花智控	7,358,260.00	3.52
53	300014	亿纬锂能	7,284,179.00	3.49
54	300122	智飞生物	7,265,357.50	3.48
55	002324	普利特	7,247,876.00	3.47
56	603979	金诚信	6,857,166.43	3.28
57	000516	国际医学	6,809,413.00	3.26
58	301236	软通动力	6,697,664.00	3.21
59	000333	美的集团	6,643,637.00	3.18
60	601636	旗滨集团	6,641,268.00	3.18
61	601699	潞安环能	6,569,790.34	3.14
62	002372	伟星新材	6,568,241.00	3.14
63	300394	天孚通信	6,518,513.40	3.12
64	601728	中国电信	6,513,001.00	3.12
65	603859	能科科技	6,490,478.00	3.11
66	603378	亚士创能	6,479,435.16	3.10
67	002517	恺英网络	6,343,757.00	3.04
68	300454	深信服	6,326,404.00	3.03
69	600060	海信视像	6,314,394.00	3.02
70	601208	东材科技	6,280,523.70	3.01
71	605117	德业股份	6,274,658.00	3.00
72	300450	先导智能	6,253,823.00	2.99
73	300274	阳光电源	6,190,964.00	2.96
74	300316	晶盛机电	6,182,003.00	2.96
75	300567	精测电子	6,143,299.00	2.94
76	002531	天顺风能	5,995,476.00	2.87
77	600642	申能股份	5,956,735.00	2.85
78	688046	药康生物	5,842,452.49	2.80
79	603187	海容冷链	5,715,723.00	2.74
80	688107	安路科技	5,701,505.34	2.73
81	603477	巨星农牧	5,647,974.00	2.70

82	688677	青岛海泰新光	5,636,203.67	2.70
83	000921	海信家电	5,547,192.50	2.65
84	600522	中天科技	5,543,465.00	2.65
85	688319	欧林生物	5,539,792.86	2.65
86	688023	安恒信息	5,486,079.44	2.63
87	300911	亿田智能	5,401,588.96	2.58
88	600801	华新水泥	5,396,402.00	2.58
89	300762	上海瀚讯	5,336,157.00	2.55
90	603529	爱玛科技	5,315,725.00	2.54
91	600026	中远海能	5,251,918.00	2.51
92	301162	国能日新	5,245,262.60	2.51
93	300369	绿盟科技	5,216,025.27	2.50
94	000932	华菱钢铁	5,194,675.00	2.49
95	603737	三棵树	5,091,792.00	2.44
96	300996	普联软件	5,079,306.92	2.43
97	300260	新莱应材	5,019,286.00	2.40
98	603197	保隆科技	5,014,684.00	2.40
99	600399	抚顺特钢	5,011,044.00	2.40
100	600023	浙能电力	4,869,296.00	2.33
101	000928	中钢国际	4,850,574.00	2.32
102	300481	濮阳惠成	4,815,605.00	2.30
103	002007	华兰生物	4,814,037.00	2.30
104	000400	许继电气	4,804,909.00	2.30
105	603255	鼎际得股份	4,804,794.69	2.30
106	600309	万华化学	4,780,857.00	2.29
107	300015	爱尔眼科	4,764,477.85	2.28
108	605399	晨光新材	4,723,176.52	2.26
109	01024	快手-W	4,715,880.96	2.26
110	603128	华贸物流	4,660,779.00	2.23
111	600989	宝丰能源	4,633,605.00	2.22
112	688012	中微半导体设备	4,611,103.04	2.21
113	688099	晶晨半导体	4,578,602.90	2.19
114	601618	中国中冶	4,544,091.00	2.17
115	600886	国投电力	4,539,099.00	2.17
116	002446	盛路通信	4,511,192.70	2.16
117	002929	润建股份	4,496,039.40	2.15
118	002594	比亚迪	4,416,997.00	2.11
119	300566	激智科技	4,324,575.00	2.07
120	601238	广汽集团	4,307,466.00	2.06
121	300166	东方国信	4,300,413.00	2.06
122	603688	石英股份	4,272,910.00	2.04
123	600926	杭州银行	4,269,451.00	2.04
124	002979	雷赛智能	4,229,722.00	2.02

125	000983	山西焦煤	4,185,946.00	2.00
-----	--------	------	--------------	------

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	2,528,508,921.31
卖出股票收入（成交）总额	2,193,487,105.32

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,197,767.95	1.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,197,767.95	1.62

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	110,000	11,197,767.95	1.62

#### 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中，三七互娱网络科技集团股份有限公司于报告期内曾受到中国证监会的立案调查。

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	8,160,506.40
2	应收清算款	155,086.51
3	应收股利	192,095.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,166,896.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,674,584.68

### 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	5,677	42,837.55	2,460,385.46	1.01%	240,728,396.42	98.99%
中欧量化动力混合 C	6,467	72,195.96	14,449,365.69	3.09%	452,441,921.05	96.91%
合计	12,144	58,471.68	16,909,751.15	2.38%	693,170,317.47	97.62%

### 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	1,094,505.18	0.45%
	中欧量化动力混合 C	0.00	0.00%
	合计	1,094,505.18	0.15%

### 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	0
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化动力混合 A	>100
	中欧量化动力混合 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	159,114,765.45	54,069,655.12
本报告期基金总申购份额	261,264,607.53	855,724,006.24
减:本报告期基金总赎回份额	177,190,591.10	442,902,374.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	243,188,781.88	466,891,286.74

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
东北证券	3	2,232,862,388.43	47.36	1,434,699.12	52.31	本报告期新增2个
海通证券	3	1,338,551,191.91	28.39	706,417.51	25.75	本报告期新增1个
方正证券	3	1,143,364,990.13	24.25	601,820.97	21.94	本报告期新增1个

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 (%)
东北证券	-	-	737,100,000.00	33.12	-	-
海通证券	-	-	938,160,000.00	42.16	-	-
方正证券	604,838.22	100.00	549,997,000.00	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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧量化动力混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧量化动力混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧量化动力混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2023-04-12
7	中欧量化动力混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2023-04-13
8	中欧量化动力混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2023-04-14
9	中欧量化动力混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
11	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
12	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	2023-06-29

## § 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、中欧量化动力混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化动力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](http://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

2023 年 8 月 31 日