

中欧量化先锋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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67

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.....	67
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.....	67
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.....	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12 投资组合报告附注.....	68
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化先锋混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化先锋混合	
基金主代码	014995	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 16 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	332,952,380.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
下属分级基金的交易代码	014995	014996
报告期末下属分级基金的份额总额	150,992,450.48 份	181,959,929.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	李欣然
	联系电话	021-68609600	025-83388339
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	lixinran@htsc.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95597
传真		021-33830351	025-83387215
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	江苏省南京市江东中路 228 号

	家嘴环路 479 号 8 层	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	200120	210009
法定代表人	窦玉明	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
本期已实现收益	-2,443,407.07	-3,385,650.07
本期利润	1,959,112.19	3,405,747.12
加权平均基金份额本期利润	0.0124	0.0176
本期加权平均净值利润率	1.31%	1.87%
本期基金份额净值增长率	1.54%	1.24%
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	-10,824,312.79	-14,431,808.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0717	-0.0793
期末基金资产净	140,168,137.69	167,528,120.85

值		
期末基金份额净值	0.9283	0.9207
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	-7.17%	-7.93%

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

中欧量化先锋混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.21%	0.93%	1.02%	0.74%	1.19%	0.19%
过去三个月	-2.99%	0.80%	-3.41%	0.68%	0.42%	0.12%
过去六个月	1.54%	0.76%	1.76%	0.67%	-0.22%	0.09%
过去一年	-10.19%	0.89%	-7.48%	0.80%	-2.71%	0.09%
自基金合同生效起至今	-7.17%	0.99%	-9.50%	0.99%	2.33%	0.00%

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

中欧量化先锋混合 C

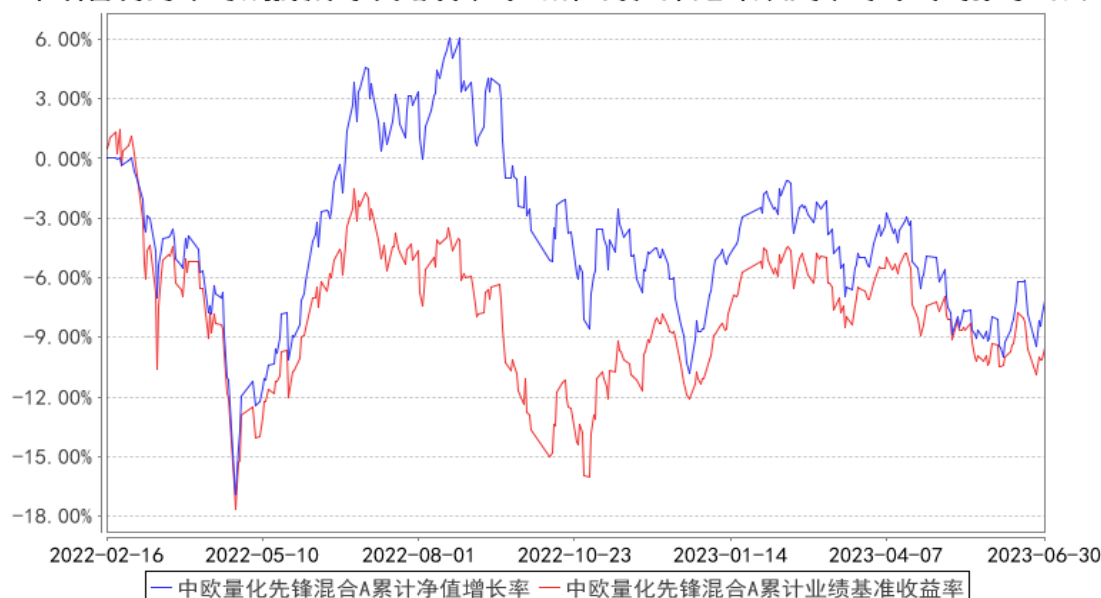
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.18%	0.93%	1.02%	0.74%	1.16%	0.19%
过去三个月	-3.12%	0.80%	-3.41%	0.68%	0.29%	0.12%

过去六个月	1.24%	0.76%	1.76%	0.67%	-0.52%	0.09%
过去一年	-10.72%	0.89%	-7.48%	0.80%	-3.24%	0.09%
自基金合同生效起 至今	-7.93%	0.99%	-9.50%	0.99%	1.57%	0.00%

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

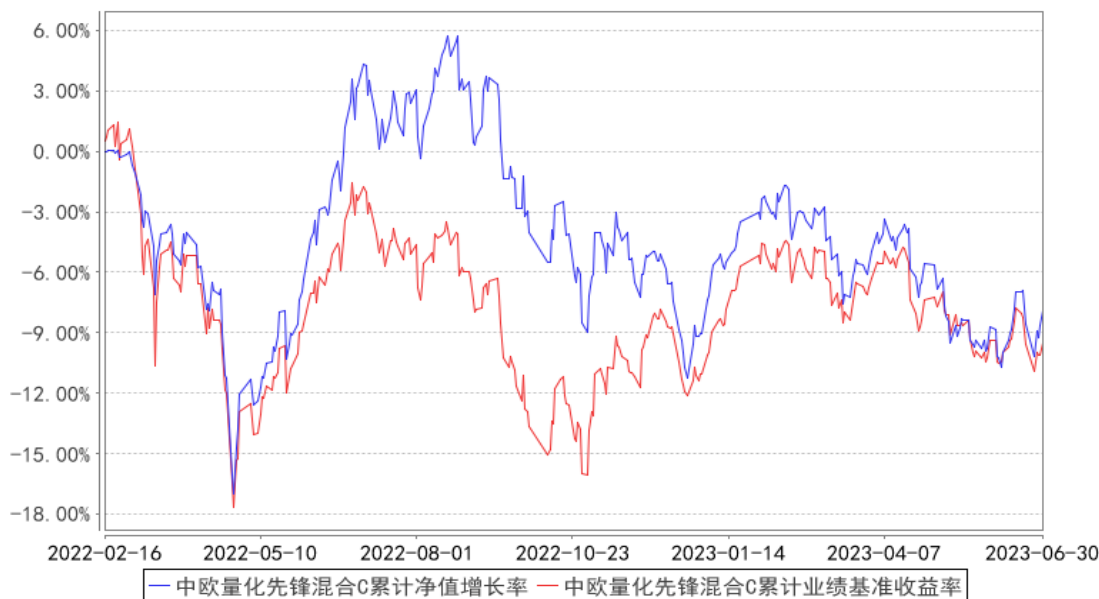
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧量化先锋混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 2 月 16 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。

中欧量化先锋混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 2 月 16 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		
钱亚婷	基金经理	2022-04-12	-	7 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-02-16	-	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模型，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 1.54%，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 1.24%，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，防止估值被歪曲而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，在托管基金的过程中，本基金托管人—华泰证券股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	24,454,624.13	28,821,861.71
结算备付金		1,936,755.47	3,133,794.89
存出保证金		2,178,508.80	1,719,192.00
交易性金融资产	6.4.7.2	279,108,238.72	295,730,393.88
其中：股票投资		261,293,607.90	278,110,411.00
基金投资		-	-
债券投资		17,814,630.82	17,619,982.88
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	-7,256.44	-
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		527,661.32	-
应收股利		140,294.62	-
应收申购款		204,424.88	728,295.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		308,543,251.50	330,133,537.99
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	549,887.74
应付赎回款		212,458.52	267,799.05
应付管理人报酬		381,467.89	429,553.95
应付托管费		38,146.76	42,955.37
应付销售服务费		83,457.25	98,126.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	131,462.54	180,002.28
负债合计		846,992.96	1,568,325.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	332,952,380.01	360,484,579.97
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-25,256,121.47	-31,919,367.36
净资产合计		307,696,258.54	328,565,212.61
负债和净资产总计		308,543,251.50	330,133,537.99

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 332,952,380.01 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9283 元，基金份额总额 150,992,450.48 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9207 元，基金份额总额 181,959,929.53 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 02 月 16 日生效，上年度可比期间自 2022 年 02 月 16 日至 2022 年 06 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：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 2 月 16 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,733,036.64	9,542,758.22
1. 利息收入		298,967.25	885,772.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	100,530.39	768,568.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-

买入返售金融资产收入		198,436.86	117,204.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,220,210.56	-23,727,071.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,325,442.90	-21,987,902.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	163,147.94	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	879,344.89	-4,835,141.21
股利收益	6.4.7.14	2,062,739.51	3,095,971.79
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	11,193,916.45	32,113,287.57
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	460,363.50	270,769.52
减：二、营业总支出		3,368,177.33	4,379,124.94
1. 管理人报酬		2,469,742.35	3,208,643.93
2. 托管费		246,974.22	320,864.36
3. 销售服务费		543,972.53	772,640.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		3,789.38	-
8. 其他费用	6.4.7.18	103,698.85	76,976.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,364,859.31	5,163,633.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,364,859.31	5,163,633.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,364,859.31	5,163,633.28

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：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）	360,484,579.97	-	-31,919,367.36	328,565,212.61
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）	360,484,579.97	-	-31,919,367.36	328,565,212.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,532,199.96	-	6,663,245.89	-20,868,954.07
（一）、综合收益总额	-	-	5,364,859.31	5,364,859.31
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-27,532,199.96	-	1,298,386.58	-26,233,813.38
其中：1. 基金申购款	149,879,573.07	-	-7,597,161.77	142,282,411.30
2. 基金赎回款	-177,411,773.03	-	8,895,548.35	-168,516,224.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（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）	332,952,380.01	-	-25,256,121.47	307,696,258.54
项目	上年度可比期间			

	2022 年 2 月 16 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）	669,882,390.06	-	-	669,882,390.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-210,558,007.11	-	14,857,091.67	-195,700,915.44
（一）、综合收益总额	-	-	5,163,633.28	5,163,633.28
（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）	-210,558,007.11	-	9,693,458.39	-200,864,548.72
其中：1. 基金申购款	19,474,698.33	-	-1,183,829.02	18,290,869.31
2. 基金赎回款	-230,032,705.44	-	10,877,287.41	-219,155,418.03
（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）	459,324,382.95	-	14,857,091.67	474,181,474.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]78号文《关于准予中欧量化先锋混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化先锋混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 669,842,619.14 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化先锋混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 2 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 669,882,390.06 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 39,770.92 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 261,184,433.19 份，包含认购利息折合 18,989.03 份；C 类基金的基金份额总额为 408,697,956.87 份，包含认购利息折合 20,781.89 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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

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

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+

银行活期存款利率（税后）×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 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、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）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	1,991,906.36
等于：本金	1,991,273.00
加：应计利息	633.36
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	22,462,717.77
等于：本金	22,462,129.20
加：应计利息	588.57
减：坏账准备	-
合计	24,454,624.13

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	258,374,937.91	-	261,293,607.90	2,918,669.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,465,941.00	316,380.82	17,814,630.82	32,309.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,465,941.00	316,380.82	17,814,630.82	32,309.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	275,840,878.91	316,380.82	279,108,238.72	2,950,978.99	

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	18,123,457.14	-	-	
其中：股指期货投资	18,123,457.14	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	18,123,457.14	-	-	

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
IM2309	IM2309	1.00	1,307,280.00	11,080.00
IM2312	IM2312	13.00	16,846,960.00	19,702.86
合计				30,782.86
减：可抵销期货暂收款				30,782.86
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	-7,256.44	-
银行间市场	-	-
合计	-7,256.44	-

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	0.59
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	37,242.40
预提费用-审计费	34,712.18
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	131,462.54

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化先锋混合 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	154,563,934.62	154,563,934.62
本期申购	53,300,223.48	53,300,223.48
本期赎回（以“-”号填列）	-56,871,707.62	-56,871,707.62
本期末	150,992,450.48	150,992,450.48

中欧量化先锋混合 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	205,920,645.35	205,920,645.35
本期申购	96,579,349.59	96,579,349.59
本期赎回（以“-”号填列）	-120,540,065.41	-120,540,065.41
本期末	181,959,929.53	181,959,929.53

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧量化先锋混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,951,407.03	-7,310,704.83	-13,262,111.86
本期利润	-2,443,407.07	4,402,519.26	1,959,112.19
本期基金份额交易产生的变动数	317,827.60	160,859.28	478,686.88
其中：基金申购款	-1,414,685.04	-894,841.66	-2,309,526.70
基金赎回款	1,732,512.64	1,055,700.94	2,788,213.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,076,986.50	-2,747,326.29	-10,824,312.79

中欧量化先锋混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,953,216.86	-9,704,038.64	-18,657,255.50
本期利润	-3,385,650.07	6,791,397.19	3,405,747.12
本期基金份额交易产生的变动数	1,215,947.46	-396,247.76	819,699.70
其中：基金申购款	-2,893,741.39	-2,393,893.68	-5,287,635.07
基金赎回款	4,109,688.85	1,997,645.92	6,107,334.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,122,919.47	-3,308,889.21	-14,431,808.68

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	22,868.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	30,281.55
结算备付金利息收入	47,380.24
其他	-
合计	100,530.39

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	1,612,831,369.76
减：卖出股票成本总额	1,615,612,351.50
减：交易费用	3,544,461.16
买卖股票差价收入	-6,325,442.90

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	163,147.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
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	163,147.94

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	879,344.89

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	2,062,739.51
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	2,062,739.51

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	10,889,942.16
股票投资	10,858,442.16
债券投资	31,500.00
资产支持证券投资	—

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	303,974.29
权证投资	-
期货投资	303,974.29
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	11,193,916.45

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	460,246.25
基金转换费收入	117.25
合计	460,363.50

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	34,712.18
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	479.30
合计	103,698.85

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
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
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2 月 16 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（%）
华泰证券	2,348,524,004.10	73.53	2,856,888,973.10	78.97

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 2 月 16 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（%）

华泰证券	1,365,300,000.00	66.80	363,999,000.00	100.00
------	------------------	-------	----------------	--------

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	1,225,937.87	73.74	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年2月16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 (%)
华泰证券	1,460,730.68	78.88	-	-

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2月16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	2,469,742.35	3,208,643.93
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,007,971.94	1,284,378.61

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。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。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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 2 月 16 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	246,974.22	320,864.36

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C	合计
华泰证券	-	371,521.88	371,521.88
中欧财富	-	809.09	809.09
中欧基金	-	8,965.30	8,965.30
合计	-	381,296.27	381,296.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 2 月 16 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		
	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C	合计
华泰证券	-	569,602.98	569,602.98
中欧基金	-	607.63	607.63
合计	-	570,210.61	570,210.61

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

中欧量化先锋混合 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	1,178,146.79	0.78%	99,988.00	0.06%

份额单位：份

中欧量化先锋混合 C

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	107,829.50	0.06%	165,605.47	0.08%

注：本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本

基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年2月16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
华泰证券股份有限公司	1,991,906.36	22,868.60	10,373,922.65	442,404.28

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（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	2023	6个月	新	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

	纬科技	年 5 月 9 日		股流通受限						
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	247	8,398.00	8,627.71	-
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	2,586	66,770.52	66,770.52	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	288	7,436.16	7,436.16	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通	57.88	49.17	206	11,923.28	10,129.02	-

				受限						
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	397	19,850.00	12,191.87	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	644	19,867.40	15,217.72	-
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	1,750	64,575.00	64,575.00	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	195	7,195.50	7,195.50	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	429	12,964.38	10,939.50	-
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	4,647	92,893.53	92,893.53	-
301292	海科	2023年6	6个月	新股	19.99	19.99	517	10,334.83	10,334.83	-

	新源	月 29 日		流通受限						
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	306	9,057.60	21,854.52	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,936	14,680.00	26,306.56	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	519	13,104.75	10,219.11	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	431	13,938.54	13,731.66	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	250	16,820.00	16,357.50	-
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	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

				受限						
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	203	7,929.18	7,990.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	164	12,595.20	17,703.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	745	11,033.45	10,228.85	-
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	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	126	9,254.70	5,876.64	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	539	9,459.45	9,028.25	-

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	397	9,436.69	17,027.33	-
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	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	392	9,666.72	8,823.92	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	366	8,710.80	12,019.44	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	330	9,896.70	7,850.70	-
301395	仁信	2023年6月	1个月内(含)	新股	26.68	26.68	4,091	109,147.88	109,147.88	-

	新材	月 21 日		未上市						
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	455	12,139.40	12,139.40	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	281	12,361.19	14,491.17	-
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	430	8,595.70	7,267.00	-
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	1,932	111,399.12	111,399.12	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	215	12,396.90	12,396.90	-

301488	豪恩 汽电	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 汽电	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 集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	1,827	36,284.22	32,995.62	-
688334	西高 院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	669	9,473.04	10,844.49	-
688361	中科 飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	366	8,637.60	23,669.22	-
688443	智翔 金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	546	20,682.48	16,101.54	-
688479	用友 汽	2023 年 5 月 4	6 个月	新股 流	33.99	29.49	233	7,919.67	6,871.17	-

	车 信 息 科 技	日		通 受 限						
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	462	10,099.32	11,018.70	-
688543	国 科 军 工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	43.67	53.05	219	9,563.73	11,617.95	-
688552	航 天 南 湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.17	23.50	451	9,547.67	10,598.50	-
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	677	8,584.36	15,103.87	-
688570	天 玛 智 控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.26	25.33	354	10,712.04	8,966.82	-
688576	西 山 科 技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	135.80	120.41	120	16,296.00	14,449.20	-
688581	安 杰 思	2023 年 5 月 12	6 个月	新 股 流	125.80	118.03	85	10,693.00	10,032.55	-

	医学	日		通受限						
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	345	9,225.30	14,034.60	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	802	8,966.36	11,701.18	-
688620	安凯微电子	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	957	10,220.76	11,809.38	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	87	10,951.56	7,550.73	-
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	248	6,269.44	7,407.76	-

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	24,454,624.13	-	-	-	24,454,624.13
结算备付金	1,936,755.47	-	-	-	1,936,755.47
存出保证金	-	-	-	2,178,508.80	2,178,508.80
交易性金融资产	17,814,630.82	-	-	-261,293,607.90	279,108,238.72
买入返售金融资产	-7,256.44	-	-	-	-7,256.44
应收股利	-	-	-	140,294.62	140,294.62
应收申购款	-	-	-	204,424.88	204,424.88
应收清算款	-	-	-	527,661.32	527,661.32
资产总计	44,198,753.98	-	-	-264,344,497.52	308,543,251.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	212,458.52	212,458.52
应付管理人报酬	-	-	-	381,467.89	381,467.89
应付托管费	-	-	-	38,146.76	38,146.76
应付销售服务费	-	-	-	83,457.25	83,457.25
其他负债	-	-	-	131,462.54	131,462.54
负债总计	-	-	-	846,992.96	846,992.96
利率敏感度缺口	44,198,753.98	-	-	-263,497,504.56	307,696,258.54
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	28,821,861.71	-	-	28,821,861.71
结算备付金	3,133,794.89	-	-	3,133,794.89
存出保证金	-	-	1,719,192.00	1,719,192.00
交易性金融资产	17,619,982.88	-	-278,110,411.00	295,730,393.88
应收申购款	-	-	728,295.51	728,295.51
资产总计	49,575,639.48	-	-280,557,898.51	330,133,537.99
负债				
应付赎回款	-	-	267,799.05	267,799.05
应付管理人报酬	-	-	429,553.95	429,553.95
应付托管费	-	-	42,955.37	42,955.37
应付清算款	-	-	549,887.74	549,887.74
应付销售服务费	-	-	98,126.99	98,126.99
其他负债	-	-	180,002.28	180,002.28
负债总计	-	-	1,568,325.38	1,568,325.38
利率敏感度缺口	49,575,639.48	-	-278,989,573.13	328,565,212.61

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 5.79%（2022 年 12 月 31 日：5.36%），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	-	11,910,136.72	-	11,910,136.72
应收股利	-	140,294.62	-	140,294.62

资产合计	-	12,050,431.34	-	12,050,431.34
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	-	12,050,431.34	-	12,050,431.34
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	-	17,941,086.75	-	17,941,086.75
资产合计	-	17,941,086.75	-	17,941,086.75
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	-	17,941,086.75	-	17,941,086.75

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）
	港币相对人民币贬值 5%	-595,506.84	-897,054.34
	港币相对人民币升值 5%	595,506.84	897,054.34

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	261,293,607.90	84.92	278,110,411.00	84.64
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	261,293,607.90	84.92	278,110,411.00	84.64

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%	16,290,738.80	16,702,238.42
	业绩比较基准下降5%	-16,290,738.80	-16,702,238.42

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	260,043,229.85	274,537,957.43
第二层次	18,413,063.70	17,619,982.88
第三层次	651,945.17	3,572,453.57
合计	279,108,238.72	295,730,393.88

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。

§ 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	261,293,607.90	84.69
	其中：股票	261,293,607.90	84.69
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	17,814,630.82	5.77
	其中：债券	17,814,630.82	5.77
	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	-7,256.44	-0.00
	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	26,391,379.60	8.55
8	其他各项资产	3,050,889.62	0.99
9	合计	308,543,251.50	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 11,910,136.72 元，占基金资产净值比例 3.87%。

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	2,716,022.00	0.88
B	采矿业	5,282,657.00	1.72
C	制造业	177,197,978.16	57.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,524,285.00	2.77
E	建筑业	2,643,254.25	0.86
F	批发和零售业	9,696,506.92	3.15
G	交通运输、仓储和邮政业	3,673,066.46	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,755,638.30	7.40
J	金融业	5,159,068.00	1.68
K	房地产业	1,534,510.00	0.50
L	租赁和商务服务业	3,443,005.60	1.12
M	科学研究和技术服务业	1,393,238.24	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	3,250,654.12	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	190,032.00	0.06
Q	卫生和社会工作	528,313.13	0.17
R	文化、体育和娱乐业	1,279,868.00	0.42
S	综合	115,374.00	0.04
	合计	249,383,471.18	81.05

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	2,303,229.59	0.75
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	2,200,342.15	0.72
医疗保健	32,453.70	0.01
工业	-	-
信息技术	1,475,601.33	0.48
电信服务	5,287,624.44	1.72
公用事业	610,885.51	0.20
地产业	-	-
合计	11,910,136.72	3.87

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	88,350	4,023,459.00	1.31
2	00700	腾讯控股	10,700	3,271,295.68	1.06
3	600886	国投电力	225,600	2,853,840.00	0.93
4	000568	泸州老窖	13,100	2,745,367.00	0.89
5	600519	贵州茅台	1,500	2,536,500.00	0.82
6	002572	索菲亚	127,300	2,217,566.00	0.72
7	02328	中国财险	274,000	2,200,342.15	0.72
8	600483	福能股份	189,800	2,192,190.00	0.71
9	300638	广和通	95,120	2,157,321.60	0.70
10	300308	中际旭创	14,100	2,079,045.00	0.68
11	601633	长城汽车	74,500	1,875,165.00	0.61
12	002555	三七互娱	52,600	1,834,688.00	0.60
13	002728	特一药业	115,220	1,757,105.00	0.57
14	603369	今世缘	32,100	1,694,880.00	0.55
15	03690	美团-W	14,580	1,644,013.89	0.53
16	688393	安必平医药	47,200	1,581,200.00	0.51
17	002518	科士达	39,100	1,564,391.00	0.51
18	002536	飞龙股份	99,200	1,488,000.00	0.48
19	300747	锐科激光	48,300	1,472,184.00	0.48
20	000066	中国长城	105,900	1,464,597.00	0.48
21	605168	三人行	16,790	1,442,932.60	0.47
22	300811	铂科新材	24,260	1,442,014.40	0.47
23	688503	聚和材料股份	14,700	1,433,250.00	0.47

		公司			
24	002230	科大讯飞	20,700	1,406,772.00	0.46
25	300315	掌趣科技	179,300	1,398,540.00	0.45
26	600353	旭光电子	168,280	1,379,896.00	0.45
27	300502	新易盛	20,000	1,359,400.00	0.44
28	601636	旗滨集团	157,100	1,354,202.00	0.44
29	601208	东材科技	104,500	1,327,150.00	0.43
30	688223	晶科能源	94,100	1,323,046.00	0.43
31	301376	致欧科技	55,692	1,319,433.92	0.43
32	688186	张家港广大特材	40,400	1,314,212.00	0.43
33	000661	长春高新	9,600	1,308,480.00	0.43
34	002056	横店东磁	71,200	1,296,552.00	0.42
35	000333	美的集团	22,000	1,296,240.00	0.42
36	603516	淳中科技	58,300	1,285,515.00	0.42
37	601100	恒立液压	19,800	1,273,734.00	0.41
38	600452	涪陵电力	59,800	1,272,544.00	0.41
39	601138	工业富联	49,300	1,242,360.00	0.40
40	603713	密尔克卫	13,900	1,238,351.00	0.40
41	300592	华凯易佰	45,200	1,230,344.00	0.40
42	603611	诺力股份	46,600	1,227,444.00	0.40
43	688568	中科星图公司	15,100	1,216,758.00	0.40
44	600729	重庆百货	38,600	1,213,584.00	0.39
45	002262	恩华药业	39,300	1,211,619.00	0.39
46	600941	中国移动	8,500	793,050.00	0.26
46	00941	中国移动	7,000	413,369.73	0.13
47	002602	世纪华通	157,600	1,196,184.00	0.39
48	300613	富瀚微	20,700	1,174,518.00	0.38
49	600132	重庆啤酒	12,600	1,161,216.00	0.38
50	603757	大元泵业	38,400	1,145,856.00	0.37
51	603338	浙江鼎力	20,400	1,142,604.00	0.37
52	000778	新兴铸管	277,600	1,132,608.00	0.37
53	300413	芒果超媒	33,000	1,128,930.00	0.37
54	300443	金雷股份	31,800	1,127,310.00	0.37
55	688687	北京凯因科技	37,421	1,103,919.50	0.36
56	601699	潞安环能	66,400	1,083,648.00	0.35
57	688793	倍轻松科技	19,600	1,056,440.00	0.34
58	002459	晶澳科技	25,180	1,050,006.00	0.34
59	002885	京泉华	47,040	1,027,353.60	0.33
60	000915	华特达因	29,100	1,026,939.00	0.33
61	002463	沪电股份	48,700	1,019,778.00	0.33
62	002714	牧原股份	24,000	1,011,600.00	0.33
63	600116	三峡水利	110,500	1,003,340.00	0.33
64	002311	海大集团	20,900	978,956.00	0.32

65	300845	捷安高科	44,700	971,331.00	0.32
66	00772	阅文集团	31,800	966,059.86	0.31
67	000921	海信家电	35,600	959,420.00	0.31
68	002371	北方华创	3,000	952,950.00	0.31
69	300540	蜀道装备	34,700	939,676.00	0.31
70	601225	陕西煤业	51,400	934,966.00	0.30
71	000811	冰轮环境	59,100	931,416.00	0.30
72	000733	振华科技	9,700	929,745.00	0.30
73	300593	新雷能	40,300	923,273.00	0.30
74	002212	天融信	94,900	920,530.00	0.30
75	603477	巨星农牧	27,400	913,790.00	0.30
76	600835	上海机电	53,000	910,540.00	0.30
77	603551	奥普家居	69,700	901,221.00	0.29
78	000977	浪潮信息	18,500	897,250.00	0.29
79	688569	铁科轨道	21,231	893,188.17	0.29
80	300750	宁德时代	3,900	892,281.00	0.29
81	603300	华铁应急	160,600	875,270.00	0.28
82	03888	金山软件	30,600	870,358.34	0.28
83	000409	云鼎科技	86,200	861,138.00	0.28
84	600522	中天科技	54,100	860,731.00	0.28
85	300274	阳光电源	7,300	851,399.00	0.28
86	002508	老板电器	33,000	834,570.00	0.27
87	603707	健友股份	61,600	831,600.00	0.27
88	000860	顺鑫农业	24,500	825,405.00	0.27
89	000739	普洛药业	46,000	816,040.00	0.27
90	002727	一心堂	30,800	813,120.00	0.26
91	002643	万润股份	46,700	813,047.00	0.26
92	300408	三环集团	27,100	795,385.00	0.26
93	002833	弘亚数控	40,400	794,264.00	0.26
94	600546	山煤国际	54,400	787,168.00	0.26
95	601336	新华保险	21,300	783,201.00	0.25
96	002334	英威腾	61,200	779,688.00	0.25
97	603076	乐惠国际	16,300	779,303.00	0.25
98	603801	志邦家居	23,600	779,272.00	0.25
99	002174	游族网络	46,200	776,160.00	0.25
100	002129	TCL 中环	23,179	769,542.80	0.25
101	601899	紫金矿业	67,000	761,790.00	0.25
102	600323	瀚蓝环境	40,100	759,093.00	0.25
103	600732	爱旭股份	24,500	753,375.00	0.24
104	603896	寿仙谷	17,000	753,100.00	0.24
105	603040	新坐标	28,300	752,497.00	0.24
106	300417	南华仪器	69,700	748,578.00	0.24
107	688658	悦康药业	35,647	741,814.07	0.24

108	603444	吉比特	1,500	736,665.00	0.24
109	603215	比依股份	41,000	735,540.00	0.24
110	600276	恒瑞医药	15,300	732,870.00	0.24
111	002179	中航光电	16,158	732,765.30	0.24
112	601021	春秋航空	12,700	729,869.00	0.24
113	300037	新宙邦	14,060	729,573.40	0.24
114	688239	贵州航宇科技	10,100	706,495.00	0.23
115	605123	派克新材	6,500	706,225.00	0.23
116	002271	东方雨虹	25,700	700,582.00	0.23
117	003012	东鹏控股	86,200	697,358.00	0.23
118	600761	安徽合力	34,600	689,578.00	0.22
119	688276	长春百克生物 科技	11,000	688,600.00	0.22
120	605077	华康股份	25,900	685,832.00	0.22
121	600004	白云机场	47,500	681,150.00	0.22
122	603659	璞泰来	17,255	659,486.10	0.21
123	09868	小鹏汽车-W	14,300	659,215.70	0.21
124	002850	科达利	4,900	648,025.00	0.21
125	002372	伟星新材	31,400	644,956.00	0.21
126	601168	西部矿业	61,300	644,263.00	0.21
127	600426	华鲁恒升	20,900	640,167.00	0.21
128	002737	葵花药业	26,300	640,142.00	0.21
129	688078	龙软科技	12,400	639,220.00	0.21
130	002517	恺英网络	40,500	637,470.00	0.21
131	01024	快手-W	12,900	636,899.17	0.21
132	688458	美芯晟科技	6,600	634,722.00	0.21
133	603529	爱玛科技	19,440	626,356.80	0.20
134	002709	天赐材料	15,100	621,969.00	0.20
135	603209	兴通股份	28,900	612,969.00	0.20
136	01071	华电国际电力 股份	162,000	610,885.51	0.20
137	002733	雄韬股份	35,200	608,608.00	0.20
138	300729	乐歌股份	34,000	606,560.00	0.20
139	02382	舜宇光学科技	8,400	605,242.99	0.20
140	603059	倍加洁	26,500	602,610.00	0.20
141	300419	浩丰科技	95,000	594,700.00	0.19
142	002966	苏州银行	89,700	587,535.00	0.19
143	300009	安科生物	58,500	585,000.00	0.19
144	300033	同花顺	3,300	578,424.00	0.19
145	603328	依顿电子	69,700	577,116.00	0.19
146	300532	今天国际	28,000	575,680.00	0.19
147	300385	雪浪环境	92,900	568,548.00	0.18
148	601668	中国建筑	99,000	568,260.00	0.18
149	002605	姚记科技	12,200	566,446.00	0.18

150	605196	华通线缆	79,400	565,328.00	0.18
151	003011	海象新材	17,500	564,375.00	0.18
152	688981	中芯国际	11,104	560,974.08	0.18
153	603129	春风动力	3,400	550,460.00	0.18
154	002234	民和股份	30,200	549,942.00	0.18
155	603105	芯能科技	32,200	543,858.00	0.18
156	603083	剑桥科技	8,600	540,854.00	0.18
157	000729	燕京啤酒	43,200	538,704.00	0.18
158	600566	济川药业	18,500	537,240.00	0.17
159	603429	集友股份	60,600	536,916.00	0.17
160	300316	晶盛机电	7,500	531,750.00	0.17
161	300389	艾比森	26,000	529,620.00	0.17
162	603810	丰山集团	38,100	524,637.00	0.17
163	688120	华海清科	2,077	523,507.85	0.17
164	300411	金盾股份	79,300	519,415.00	0.17
165	600129	太极集团	8,700	517,563.00	0.17
166	600085	同仁堂	8,947	514,989.32	0.17
167	688019	安集科技	3,120	514,269.60	0.17
168	688590	新致软件	22,600	513,698.00	0.17
169	002631	德尔未来	95,000	513,000.00	0.17
170	000516	国际医学	60,221	506,458.61	0.16
171	601339	百隆东方	89,400	500,640.00	0.16
172	001979	招商蛇口	38,300	499,049.00	0.16
173	688026	洁特生物股份	27,055	494,294.85	0.16
174	002356	赫美集团	111,800	487,448.00	0.16
175	603667	五洲新春	32,200	479,136.00	0.16
176	605218	伟时电子	30,400	471,200.00	0.15
177	300779	惠城环保	8,800	468,952.00	0.15
178	000683	远兴能源	65,000	467,350.00	0.15
179	600845	宝信软件	9,180	466,435.80	0.15
180	002560	通达股份	48,900	465,528.00	0.15
181	601600	中国铝业	84,300	462,807.00	0.15
182	300724	捷佳伟创	4,000	449,400.00	0.15
183	002611	东方精工	78,000	447,720.00	0.15
184	600988	赤峰黄金	33,200	446,872.00	0.15
185	300838	浙江力诺	24,400	445,788.00	0.14
186	300265	通光线缆	42,900	445,302.00	0.14
187	002389	航天彩虹	20,000	444,200.00	0.14
188	300832	新产业	7,500	442,500.00	0.14
189	600098	广州发展	71,400	441,252.00	0.14
190	600066	宇通客车	29,900	440,726.00	0.14
191	000663	永安林业	36,100	439,698.00	0.14
192	002439	启明星辰	14,700	437,472.00	0.14

193	300034	钢研高纳	11,100	437,229.00	0.14
194	300103	达刚控股	71,200	437,168.00	0.14
195	605009	豪悦护理	9,100	436,800.00	0.14
196	301030	仕净科技	6,300	435,330.00	0.14
197	300745	欣锐科技	9,800	432,866.00	0.14
198	600963	岳阳林纸	58,600	431,882.00	0.14
199	688525	佰维存储	5,400	431,406.00	0.14
200	300126	锐奇股份	65,983	428,229.67	0.14
201	300130	新国都	15,100	427,783.00	0.14
202	688335	复洁环保科技	17,340	425,523.60	0.14
203	300281	金明精机	78,800	422,368.00	0.14
204	002141	贤丰控股	126,700	416,843.00	0.14
205	000626	远大控股	55,700	414,965.00	0.13
206	300795	米奥会展	9,900	412,929.00	0.13
207	600926	杭州银行	35,100	412,425.00	0.13
208	002352	顺丰控股	9,100	410,319.00	0.13
209	600128	弘业股份	49,700	408,534.00	0.13
210	600570	恒生电子	9,200	407,468.00	0.13
211	600663	陆家嘴	41,100	405,657.00	0.13
212	300926	博俊科技	17,700	404,268.00	0.13
213	000820	神雾节能	108,100	403,213.00	0.13
214	603214	爱婴室	24,700	401,869.00	0.13
215	002937	兴瑞科技	16,300	400,980.00	0.13
216	002616	长青集团	77,800	398,336.00	0.13
217	301257	普蕊斯	7,000	393,400.00	0.13
218	002674	兴业科技	31,800	392,730.00	0.13
219	002338	奥普光电	9,300	391,995.00	0.13
220	688097	博众精工科技	12,848	390,065.28	0.13
221	600547	山东黄金	16,500	387,420.00	0.13
222	002533	金杯电工	47,200	385,152.00	0.13
223	000715	中兴商业	52,100	385,019.00	0.13
224	002027	分众传媒	56,400	384,084.00	0.12
225	300842	帝科股份	4,200	384,048.00	0.12
226	603606	东方电缆	7,800	382,434.00	0.12
227	688305	科德数控	3,800	380,988.00	0.12
228	002880	卫光生物	10,100	380,770.00	0.12
229	000922	佳电股份	28,800	379,008.00	0.12
230	300212	易华录	11,400	378,822.00	0.12
231	601939	建设银行	60,400	378,104.00	0.12
232	300777	中简科技	8,000	378,080.00	0.12
233	688111	金山办公	800	377,776.00	0.12
234	601288	农业银行	106,500	375,945.00	0.12
235	601233	桐昆股份	28,300	374,975.00	0.12

236	600488	津药药业	66,600	374,292.00	0.12
237	002648	卫星化学	24,700	369,512.00	0.12
238	688550	瑞联新材料	9,301	368,319.60	0.12
239	000554	泰山石油	65,100	366,513.00	0.12
240	300405	科隆股份	66,000	361,020.00	0.12
241	603993	洛阳钼业	67,700	360,841.00	0.12
242	301068	大地海洋	10,700	359,627.00	0.12
243	002003	伟星股份	38,400	359,424.00	0.12
244	002448	中原内配	51,300	359,100.00	0.12
245	002777	久远银海	10,100	358,247.00	0.12
246	002917	金奥博	28,600	353,496.00	0.11
247	000423	东阿阿胶	6,600	352,770.00	0.11
248	600592	龙溪股份	33,200	351,920.00	0.11
249	688529	大连豪森股份	13,405	350,138.60	0.11
250	002469	三维化学	56,800	349,320.00	0.11
251	002767	先锋电子	25,000	349,250.00	0.11
252	000888	峨眉山 A	30,400	348,384.00	0.11
253	002829	星网宇达	7,900	347,047.00	0.11
254	688670	金迪克生物	7,360	346,508.80	0.11
255	603778	乾景园林	64,100	346,140.00	0.11
256	002918	蒙娜丽莎	22,400	345,856.00	0.11
257	300059	东方财富	24,200	343,640.00	0.11
258	001216	华瓷股份	26,000	342,160.00	0.11
259	002066	瑞泰科技	28,600	341,770.00	0.11
260	300819	聚杰微纤	24,900	341,379.00	0.11
261	603602	纵横通信	27,600	339,204.00	0.11
262	002730	电光科技	35,200	337,216.00	0.11
263	301004	嘉益股份	8,642	335,309.60	0.11
264	300387	富邦股份	46,000	334,880.00	0.11
265	603711	香飘飘	16,200	332,586.00	0.11
266	605598	上海港湾	6,300	331,758.00	0.11
267	603669	灵康药业	71,200	331,080.00	0.11
268	002957	科瑞技术	16,200	328,374.00	0.11
269	300521	爱司凯	25,600	326,912.00	0.11
270	605377	华旺科技	18,100	326,705.00	0.11
271	002959	小熊电器	3,900	325,650.00	0.11
272	003006	百亚股份	18,700	323,136.00	0.11
273	002624	完美世界	19,000	320,910.00	0.10
274	000913	钱江摩托	17,600	320,848.00	0.10
275	600807	济南高新	108,400	319,780.00	0.10
276	603889	新澳股份	42,440	318,724.40	0.10
277	600984	建设机械	69,900	315,948.00	0.10
278	002039	黔源电力	22,400	315,168.00	0.10

279	300812	易天股份	12,600	315,000.00	0.10
280	688012	中微半导体设备	2,000	312,900.00	0.10
281	000014	沙河股份	27,100	310,024.00	0.10
282	300771	智莱科技	27,800	302,742.00	0.10
283	002831	裕同科技	12,300	299,997.00	0.10
284	300161	华中数控	5,600	299,712.00	0.10
285	000404	长虹华意	43,100	298,252.00	0.10
286	002790	瑞尔特	31,000	297,600.00	0.10
287	601318	中国平安	6,400	296,960.00	0.10
288	300723	一品红	10,050	294,465.00	0.10
289	301256	华融化学	33,200	294,152.00	0.10
290	002050	三花智控	9,700	293,522.00	0.10
291	002142	宁波银行	11,600	293,480.00	0.10
292	603737	三棵树	4,480	293,081.60	0.10
293	000533	顺钠股份	68,800	292,400.00	0.10
294	601628	中国人寿	8,300	290,168.00	0.09
295	603161	科华控股	19,900	289,943.00	0.09
296	603090	宏盛股份	13,000	289,250.00	0.09
297	002046	国机精工	22,600	288,376.00	0.09
298	300908	仲景食品	6,300	285,705.00	0.09
299	603929	亚翔集成	17,000	285,600.00	0.09
300	600746	江苏索普	43,700	285,361.00	0.09
301	603109	神驰机电	15,800	282,030.00	0.09
302	002887	绿茵生态	30,800	279,972.00	0.09
303	688722	同益中新材料	15,100	279,954.00	0.09
304	603811	诚意药业	22,400	278,432.00	0.09
305	688636	智明达电子	5,047	277,585.00	0.09
306	300580	贝斯特	11,400	276,906.00	0.09
307	603093	南华期货	25,400	276,606.00	0.09
308	601601	中国太保	10,600	275,388.00	0.09
309	600089	特变电工	12,300	274,167.00	0.09
310	300951	博硕科技	5,000	273,150.00	0.09
311	002422	科伦药业	9,200	273,056.00	0.09
312	603586	金麒麟	17,000	271,490.00	0.09
313	002353	杰瑞股份	10,800	271,404.00	0.09
314	000534	万泽股份	16,100	269,997.00	0.09
315	603187	海容冷链	13,500	269,865.00	0.09
316	301188	力诺特玻	15,800	269,864.00	0.09
317	300491	通合科技	9,400	269,780.00	0.09
318	301162	国能日新	3,400	268,192.00	0.09
319	600053	九鼎投资	21,600	267,192.00	0.09
320	688566	吉贝尔药业	6,800	265,268.00	0.09
321	688143	长盈通光电	7,017	264,540.90	0.09

322	002595	豪迈科技	7,500	263,475.00	0.09
323	002475	立讯精密	8,100	262,845.00	0.09
324	600157	永泰能源	184,800	262,416.00	0.09
325	002979	雷赛智能	11,000	261,360.00	0.08
326	688698	伟创电气	6,500	259,870.00	0.08
327	601689	拓普集团	3,200	258,240.00	0.08
328	301129	瑞纳智能	3,500	257,845.00	0.08
329	600660	福耀玻璃	7,100	254,535.00	0.08
330	600251	冠农股份	28,100	253,743.00	0.08
331	605289	罗曼股份	6,600	252,846.00	0.08
332	300882	万胜智能	8,900	252,582.00	0.08
333	002370	亚太药业	61,600	251,328.00	0.08
334	688601	力芯微股份	5,329	250,995.90	0.08
335	688085	三友医疗	9,500	249,470.00	0.08
336	301391	卡莱特	2,124	248,869.08	0.08
337	600572	康恩贝	36,200	247,970.00	0.08
338	300718	长盛轴承	11,100	246,975.00	0.08
339	301085	亚康股份	3,500	246,890.00	0.08
340	603023	威帝股份	60,300	246,024.00	0.08
341	300124	汇川技术	3,800	243,998.00	0.08
342	300349	金卡智能	17,500	242,900.00	0.08
343	603199	九华旅游	7,000	241,850.00	0.08
344	688156	路德环境	8,403	240,914.01	0.08
345	002772	众兴菌业	21,300	240,690.00	0.08
346	688551	科威尔股份	3,649	239,301.42	0.08
347	300717	华信新材	14,000	238,700.00	0.08
348	002821	凯莱英	2,000	235,720.00	0.08
349	600785	新华百货	17,300	235,107.00	0.08
350	688697	纽威数控装备	9,100	235,053.00	0.08
351	688668	鼎通科技	2,400	234,720.00	0.08
352	002940	昂利康	12,200	234,362.00	0.08
353	300624	万兴科技	2,000	234,300.00	0.08
354	300280	紫天科技	4,900	234,073.00	0.08
355	002920	德赛西威	1,500	233,715.00	0.08
356	600857	宁波中百	23,200	229,680.00	0.07
357	300262	巴安水务	85,100	226,366.00	0.07
358	603163	圣晖系统集成集团	4,875	223,421.25	0.07
359	000962	东方钼业	18,200	222,950.00	0.07
360	688291	金橙子科技	7,040	222,886.40	0.07
361	300807	天迈科技	7,600	222,300.00	0.07
362	300664	鹏鹞环保	39,000	220,740.00	0.07
363	603227	雪峰科技	26,500	219,420.00	0.07
364	002731	萃华珠宝	15,300	218,331.00	0.07

365	603878	武进不锈	25,480	215,306.00	0.07
366	300622	博士眼镜	9,100	214,760.00	0.07
367	300407	凯发电气	23,500	214,555.00	0.07
368	603081	大丰实业	11,600	213,208.00	0.07
369	002057	中钢天源	20,300	213,150.00	0.07
370	003008	开普检测	7,400	212,602.00	0.07
371	002270	华明装备	19,200	210,240.00	0.07
372	300418	昆仑万维	5,200	209,456.00	0.07
373	300950	德固特	9,800	207,760.00	0.07
374	603676	卫信康	15,000	207,300.00	0.07
375	688516	奥特维科技	1,100	207,240.00	0.07
376	603217	元利科技	8,000	206,000.00	0.07
377	002783	凯龙股份	24,700	205,998.00	0.07
378	300275	梅安森	14,700	204,330.00	0.07
379	600725	云维股份	74,900	201,481.00	0.07
380	000928	中钢国际	20,800	200,720.00	0.07
381	300157	恒泰艾普	62,000	199,640.00	0.06
382	300490	华自科技	11,600	199,056.00	0.06
383	301076	新瀚新材	10,100	198,162.00	0.06
384	002877	智能自控	19,500	197,730.00	0.06
385	300333	兆日科技	29,700	196,911.00	0.06
386	300689	澄天伟业	8,400	196,308.00	0.06
387	300314	戴维医疗	9,200	194,488.00	0.06
388	600356	恒丰纸业	24,800	194,184.00	0.06
389	300757	罗博特科	2,200	193,622.00	0.06
390	600309	万华化学	2,200	193,248.00	0.06
391	300462	华铭智能	16,400	192,536.00	0.06
392	000425	徐工机械	28,400	192,268.00	0.06
393	603121	华培动力	21,500	191,565.00	0.06
394	688126	上海硅产业集团	9,100	190,190.00	0.06
395	605098	行动教育	4,800	190,032.00	0.06
396	603856	东宏股份	14,400	189,936.00	0.06
397	301328	维峰电子	3,300	187,902.00	0.06
398	002126	银轮股份	10,600	187,620.00	0.06
399	600250	南纺股份	30,200	187,542.00	0.06
400	603000	人民网	6,400	186,880.00	0.06
401	688337	普源精电	3,100	186,806.00	0.06
402	301106	骏成科技	5,200	185,224.00	0.06
403	300384	三联虹普	10,900	185,191.00	0.06
404	300270	中威电子	24,000	183,600.00	0.06
405	600509	天富能源	23,500	183,535.00	0.06
406	300403	汉宇集团	16,600	182,434.00	0.06
407	600458	时代新材	15,000	179,850.00	0.06

408	300711	广哈通信	12,020	179,819.20	0.06
409	300294	博雅生物	4,900	177,772.00	0.06
410	002161	远望谷	34,000	177,140.00	0.06
411	603867	XD 新化股份	4,300	174,150.00	0.06
412	603266	天龙股份	12,500	173,875.00	0.06
413	002136	安纳达	15,200	172,976.00	0.06
414	600861	北京人力	7,300	169,360.00	0.06
415	003000	劲仔食品	13,400	168,706.00	0.05
416	600379	宝光股份	16,500	168,300.00	0.05
417	300105	龙源技术	24,900	167,079.00	0.05
418	002006	精功科技	7,700	166,089.00	0.05
419	300700	岱勒新材	8,700	165,735.00	0.05
420	603998	方盛制药	12,900	162,669.00	0.05
421	688376	美埃科技	4,100	161,909.00	0.05
422	002949	华阳国际	11,300	160,686.00	0.05
423	001255	博菲电气	4,200	160,104.00	0.05
424	301286	侨源股份	5,400	159,300.00	0.05
425	002646	天佑德酒	11,800	159,182.00	0.05
426	688582	芯动联科	3,442	159,129.05	0.05
427	300117	嘉寓股份	51,200	158,720.00	0.05
428	002629	仁智股份	43,200	157,680.00	0.05
429	002852	道道全	12,100	156,453.00	0.05
430	688676	海南金盘智能 科技	5,100	154,479.00	0.05
431	300510	金冠股份	22,100	154,258.00	0.05
432	300539	横河精密	10,400	154,024.00	0.05
433	688103	国力股份	2,500	149,775.00	0.05
434	600327	大东方	32,100	149,265.00	0.05
435	301307	美利信	4,431	148,971.66	0.05
436	301367	怡和嘉业	1,000	148,340.00	0.05
437	603909	建发合诚	11,070	147,563.10	0.05
438	002779	中坚科技	5,600	147,336.00	0.05
439	688121	卓然技术	3,900	145,860.00	0.05
440	003036	泰坦股份	10,500	141,540.00	0.05
441	300004	南风股份	26,200	141,480.00	0.05
442	300918	南山智尚	10,300	141,419.00	0.05
443	300900	广联航空	4,900	141,169.00	0.05
444	300796	贝斯美	11,700	140,751.00	0.05
445	002658	雪迪龙	17,100	139,023.00	0.05
446	003017	大洋生物	4,100	137,965.00	0.04
447	603421	鼎信通讯	13,100	136,895.00	0.04
448	603800	道森股份	5,000	136,000.00	0.04
449	002993	奥海科技	4,000	135,680.00	0.04
450	002130	沃尔核材	16,600	134,792.00	0.04

451	600419	天润乳业	8,300	134,626.00	0.04
452	688310	迈得医疗	4,100	134,357.00	0.04
453	002897	意华股份	2,900	134,212.00	0.04
454	600285	羚锐制药	8,300	133,298.00	0.04
455	300517	海波重科	9,600	132,864.00	0.04
456	002870	香山股份	4,000	132,680.00	0.04
457	688300	联瑞新材	2,833	132,442.75	0.04
458	603165	荣晟环保	8,200	131,528.00	0.04
459	688588	凌志软件	8,300	129,065.00	0.04
460	000923	河钢资源	9,500	128,250.00	0.04
461	600272	开开实业	14,000	126,420.00	0.04
462	603590	康辰药业	3,800	126,160.00	0.04
463	300107	建新股份	25,500	124,695.00	0.04
464	600584	长电科技	4,000	124,680.00	0.04
465	002092	中泰化学	19,300	124,485.00	0.04
466	301486	致尚科技	2,147	123,796.02	0.04
467	600346	恒力石化	8,600	123,238.00	0.04
468	000338	潍柴动力	9,800	122,108.00	0.04
469	301395	仁信新材	4,546	121,287.28	0.04
470	001215	千味央厨	1,800	119,682.00	0.04
471	300586	美联新材	9,200	118,772.00	0.04
472	688768	容知日新	1,480	118,207.60	0.04
473	000521	长虹美菱	15,300	116,892.00	0.04
474	002315	焦点科技	2,900	116,000.00	0.04
475	600212	绿能慧充	12,300	115,374.00	0.04
476	600833	第一医药	8,300	115,370.00	0.04
477	603589	口子窖	2,300	113,505.00	0.04
478	603699	纽威股份	7,600	113,088.00	0.04
479	001269	欧晶科技	1,500	110,295.00	0.04
480	605016	百龙创园	4,340	107,458.40	0.03
481	600433	冠豪高新	31,300	106,733.00	0.03
482	301210	金杨股份	2,054	104,986.86	0.03
483	600686	金龙汽车	12,800	104,192.00	0.03
484	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
485	688350	富淼科技	6,100	103,639.00	0.03
486	300129	泰胜风能	10,800	103,572.00	0.03
487	301292	海科新源	5,164	103,228.36	0.03
488	002072	凯瑞德	16,400	102,664.00	0.03
489	600976	健民集团	1,300	100,217.00	0.03
490	300235	方直科技	8,000	99,600.00	0.03
491	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.03
492	000999	华润三九	1,600	97,056.00	0.03
493	688217	上海睿昂基因	2,400	96,360.00	0.03

494	688158	优刻得科技	5,100	96,288.00	0.03
495	603368	柳药集团	3,800	93,898.00	0.03
496	300688	创业黑马	2,700	93,717.00	0.03
497	603486	科沃斯	1,200	93,324.00	0.03
498	600150	中国船舶	2,800	92,148.00	0.03
499	600971	恒源煤电	11,600	90,364.00	0.03
500	605167	利柏特	9,100	88,088.00	0.03
501	603169	兰石重装	11,800	87,792.00	0.03
502	603859	能科科技	1,700	86,921.00	0.03
503	002891	中宠股份	3,600	86,904.00	0.03
504	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.03
505	301058	中粮科工	6,100	85,095.00	0.03
506	688127	蓝特光学	4,804	84,694.52	0.03
507	002965	祥鑫科技	1,500	83,520.00	0.03
508	600812	华北制药	14,800	82,732.00	0.03
509	603177	德创环保	6,400	79,872.00	0.03
510	603225	新凤鸣	7,000	77,350.00	0.03
511	603899	晨光股份	1,700	75,888.00	0.02
512	301202	朗威股份	2,874	74,206.68	0.02
513	300068	南都电源	3,800	73,568.00	0.02
514	601865	福莱特	1,900	73,169.00	0.02
515	002446	盛路通信	7,700	72,765.00	0.02
516	688278	特宝生物	1,642	72,100.22	0.02
517	601390	中国中铁	9,500	72,010.00	0.02
518	603267	鸿远电子	1,100	71,830.00	0.02
519	301261	恒工精密	1,945	71,770.50	0.02
520	002153	石基信息	5,110	71,540.00	0.02
521	601800	中国交建	6,500	70,915.00	0.02
522	002123	梦网科技	5,300	70,437.00	0.02
523	603179	新泉股份	1,600	70,224.00	0.02
524	000938	紫光股份	2,200	70,070.00	0.02
525	688378	奥来德光电	1,400	69,160.00	0.02
526	600487	亨通光电	4,700	68,902.00	0.02
527	688037	芯源微电子	400	68,380.00	0.02
528	002007	华兰生物	3,000	67,230.00	0.02
529	688373	盟科药业	7,800	66,690.00	0.02
530	300133	华策影视	9,400	66,646.00	0.02
531	688031	星环科技	500	66,620.00	0.02
532	002544	普天科技	2,900	66,410.00	0.02
533	002151	北斗星通	1,800	63,288.00	0.02
534	688200	华峰测控	402	61,506.00	0.02
535	688596	正帆科技	1,400	60,620.00	0.02
536	688575	亚辉龙生物	3,200	59,040.00	0.02

537	688433	华曙高科	1,700	57,800.00	0.02
538	600529	山东药玻	2,100	57,162.00	0.02
539	002929	润建股份	1,300	56,433.00	0.02
540	002155	湖南黄金	4,500	54,900.00	0.02
541	301312	智立方	500	53,080.00	0.02
542	000681	视觉中国	2,800	51,492.00	0.02
543	002600	领益智造	7,400	51,134.00	0.02
544	002851	麦格米特	1,400	51,058.00	0.02
545	688007	光峰科技	2,400	50,040.00	0.02
546	688009	中国通号	8,600	49,880.00	0.02
547	603305	旭升集团	1,700	47,379.00	0.02
548	601137	博威合金	3,000	46,680.00	0.02
549	000989	九芝堂	3,300	45,672.00	0.01
550	002275	桂林三金	2,500	45,025.00	0.01
551	000657	中钨高新	4,600	44,574.00	0.01
552	600557	康缘药业	1,600	43,936.00	0.01
553	000625	长安汽车	3,200	41,376.00	0.01
554	002332	仙琚制药	3,100	41,075.00	0.01
555	603997	继峰股份	2,800	40,040.00	0.01
556	600528	中铁工业	4,000	39,520.00	0.01
557	603639	海利尔	2,200	39,424.00	0.01
558	601126	四方股份	2,500	37,975.00	0.01
559	688533	上声电子股份	800	37,384.00	0.01
560	000630	铜陵有色	11,700	33,813.00	0.01
561	688255	凯尔达机器人	981	33,216.66	0.01
562	688249	晶合集成	1,827	32,995.62	0.01
563	300654	世纪天鸿	2,500	32,800.00	0.01
564	01548	金斯瑞生物科技	2,000	32,453.70	0.01
565	600489	中金黄金	3,100	32,023.00	0.01
566	002865	钧达股份	200	30,506.00	0.01
567	600549	厦门钨业	1,400	26,642.00	0.01
568	301301	川宁生物	2,936	26,306.56	0.01
569	688361	中科飞测	366	23,669.22	0.01
570	001311	多利科技	400	22,972.00	0.01
571	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
572	301293	三博脑科	306	21,854.52	0.01
573	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
574	603235	天新药业	572	17,937.92	0.01
575	301325	曼恩斯特	164	17,703.80	0.01
576	301358	湖南裕能	397	17,027.33	0.01
577	301310	鑫宏业	250	16,357.50	0.01
578	688443	智翔金泰	546	16,101.54	0.01
579	688036	传音控股	104	15,288.00	0.00

580	301260	格力博	644	15,217.72	0.00
581	688562	航天软件股份	677	15,103.87	0.00
582	301399	英特科技	281	14,491.17	0.00
583	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
584	688576	西山科技	120	14,449.20	0.00
585	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
586	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
587	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
588	301246	宏源药业	397	12,191.87	0.00
589	301382	蜂助手	366	12,019.44	0.00
590	688620	安凯微	957	11,809.38	0.00
591	688593	新相微	802	11,701.18	0.00
592	688543	国科军工	219	11,617.95	0.00
593	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
594	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
595	688523	航天环宇科技	462	11,018.70	0.00
596	301262	海看股份	429	10,939.50	0.00
597	688334	C 西高院	669	10,844.49	0.00
598	688552	航天南湖	451	10,598.50	0.00
599	301332	德尔玛	745	10,228.85	0.00
600	301305	朗坤环境	519	10,219.11	0.00
601	688581	安杰思医学	85	10,032.55	0.00
602	301355	南王科技	539	9,028.25	0.00
603	688570	天玛智控	354	8,966.82	0.00
604	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
605	301170	锡南科技	247	8,627.71	0.00
606	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
607	301323	新莱福	203	7,990.08	0.00
608	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
609	301386	未来电器	330	7,850.70	0.00
610	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
611	688623	双元科技	87	7,550.73	0.00
612	688631	莱斯信息	248	7,407.76	0.00
613	301439	泓淋电力	430	7,267.00	0.00
614	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
615	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
616	688479	用友汽车信息 科技	233	6,871.17	0.00
617	301345	涛涛车业	126	5,876.64	0.00
618	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
619	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
620	688358	祥生医疗科技	45	2,295.00	0.00
621	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
622	603172	浙江万丰股份	122	1,967.86	0.00

623	603871	嘉友国际	26	408.46	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	16,307,265.49	4.96
2	002230	科大讯飞	14,004,246.00	4.26
3	688111	金山办公	13,486,665.36	4.10
4	600487	亨通光电	12,792,944.00	3.89
5	300573	兴齐眼药	12,698,300.00	3.86
6	002841	视源股份	11,642,245.00	3.54
7	000661	长春高新	11,526,503.00	3.51
8	002459	晶澳科技	11,242,557.80	3.42
9	600988	赤峰黄金	11,171,260.00	3.40
10	300750	宁德时代	11,099,640.00	3.38
11	000568	泸州老窖	10,957,612.00	3.33
12	002271	东方雨虹	10,582,470.00	3.22
13	300491	通合科技	10,444,461.20	3.18
14	600188	兖矿能源	9,645,217.00	2.94
15	300593	新雷能	9,643,252.40	2.93
16	600050	中国联通	9,542,655.00	2.90
17	603659	璞泰来	9,518,454.45	2.90
18	600028	中国石化	9,374,205.00	2.85
19	002508	老板电器	9,045,804.00	2.75
20	600426	华鲁恒升	8,974,148.43	2.73
21	002371	北方华创	8,819,007.00	2.68
22	601702	华峰铝业	8,546,937.00	2.60
23	688358	祥生医疗科技	8,472,496.40	2.58
24	688223	晶科能源	8,179,637.99	2.49
25	601225	陕西煤业	7,984,798.00	2.43
26	601208	东材科技	7,839,487.00	2.39
27	300454	深信服	7,173,054.00	2.18
28	000516	国际医学	7,069,579.81	2.15
29	601636	旗滨集团	6,879,812.00	2.09
30	600886	国投电力	6,725,194.00	2.05
31	600570	恒生电子	6,671,312.70	2.03
32	300217	东方电热	6,638,784.00	2.02
33	300308	中际旭创	6,594,963.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	17,535,147.37	5.34
2	600546	山煤国际	15,994,747.00	4.87
3	688111	金山办公	13,618,611.51	4.14
4	300750	宁德时代	13,509,857.60	4.11
5	600487	亨通光电	13,181,241.00	4.01
6	002230	科大讯飞	13,040,350.50	3.97
7	002271	东方雨虹	12,135,032.34	3.69
8	600188	兖矿能源	10,488,447.00	3.19
8	01171	兖矿能源	1,459,882.41	0.44
9	002841	视源股份	11,862,025.00	3.61
10	300491	通合科技	10,936,574.00	3.33
11	002459	晶澳科技	10,872,749.60	3.31
12	600988	赤峰黄金	10,780,237.56	3.28
13	000661	长春高新	10,247,367.00	3.12
14	603659	璞泰来	10,038,263.15	3.06
15	002371	北方华创	9,937,992.00	3.02
16	600050	中国联通	9,793,059.00	2.98
17	002179	中航光电	9,488,439.00	2.89
18	600028	中国石化	9,376,787.00	2.85
19	300593	新雷能	9,184,524.28	2.80
20	688358	祥生医疗科技	8,928,331.03	2.72
21	002508	老板电器	8,850,654.00	2.69
22	002043	兔宝宝	8,732,867.00	2.66
23	000568	泸州老窖	8,539,864.00	2.60
24	601702	华峰铝业	8,534,896.00	2.60
25	600426	华鲁恒升	8,527,171.00	2.60
26	600557	康缘药业	8,366,049.00	2.55
27	601225	陕西煤业	7,767,899.00	2.36
28	300454	深信服	7,200,612.00	2.19
29	300217	东方电热	6,829,710.00	2.08
30	600276	恒瑞医药	6,786,503.95	2.07
31	600570	恒生电子	6,689,529.44	2.04

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,587,937,106.24
卖出股票收入（成交）总额	1,612,831,369.76

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	17,814,630.82	5.79
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	17,814,630.82	5.79

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	175,000	17,814,630.82	5.79

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体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收到公开谴责、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	2,178,508.80
2	应收清算款	527,661.32
3	应收股利	140,294.62
4	应收利息	-
5	应收申购款	204,424.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,050,889.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧量化 先锋混合 A	4,079	37,017.03	15,975,465.76	10.58%	135,016,984.72	89.42%
中欧量化 先锋混合 C	20,999	8,665.17	8,771,096.38	4.82%	173,188,833.15	95.18%
合计	25,078	13,276.67	24,746,562.14	7.43%	308,205,817.87	92.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧量化先锋混合 A	1,178,146.79	0.78%
	中欧量化先锋混合 C	107,829.50	0.06%
	合计	1,285,976.29	0.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化先锋混合 A	中欧量化先锋混合 C
基金合同生效日 (2022 年 2 月 16 日) 基金份额总额	261,184,433.19	408,697,956.87
本报告期期初基金份额总额	154,563,934.62	205,920,645.35
本报告期基金总申购份额	53,300,223.48	96,579,349.59
减：本报告期基金总赎回份额	56,871,707.62	120,540,065.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	150,992,450.48	181,959,929.53
-------------	----------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	4	2,348,524,004.10	73.53	1,225,937.87	73.74	-
中泰证券	3	845,439,387.87	26.47	436,578.07	26.26	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	1,365,300,000.00	66.80	-	-
中泰证券	-	-	678,439,000.00	33.20	-	-

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	中欧量化先锋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	中欧量化先锋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
7	中欧量化先锋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
8	中欧基金管理有限公司关于公司股	中国证监会指定媒介	2023-06-03

	权变更的公告		
9	中欧量化先锋混合型证券投资基金 基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	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、中欧量化先锋混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化先锋混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化先锋混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日