

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安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	10
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
§ 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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55

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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12	投资组合报告附注.....	56
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8	其他重大事件.....	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录.....	60
12.2	存放地点.....	60
12.3	查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧沪深 300 指数增强	
基金主代码	015387	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 29 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	308,651,815.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧沪深 300 指数增强 A	中欧沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015387	015388
报告期末下属分级基金的份额总额	245,716,652.43 份	62,935,162.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争控制本基金与业绩比较基准之间的跟踪偏离度。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
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	021-38917599-5

传真	021-33830351	021-38677819
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	窦玉明	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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)	
	中欧沪深 300 指数增强 A	中欧沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	-773,829.30	-504,843.98
本期利润	-907,978.51	286,759.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0036	0.0041
本期加权平均净值利润率	-0.38%	0.44%
本期基金份额净值增长率	-1.06%	-1.36%
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	-20,558,202.36	-5,701,988.96
期末可供分配基	-0.0837	-0.0906

金份额利润		
期末基金资产净值	225,158,450.07	57,233,173.81
期末基金份额净值	0.9163	0.9094
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	-8.37%	-9.06%

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

中欧沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.45%	0.78%	1.10%	0.83%	1.35%	-0.05%
过去三个月	-4.27%	0.78%	-4.88%	0.79%	0.61%	-0.01%
过去六个月	-1.06%	0.76%	-0.69%	0.80%	-0.37%	-0.04%
过去一年	-13.80%	0.88%	-13.60%	0.94%	-0.20%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-8.37%	0.92%	-6.92%	1.04%	-1.45%	-0.12%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧沪深 300 指数增强 C

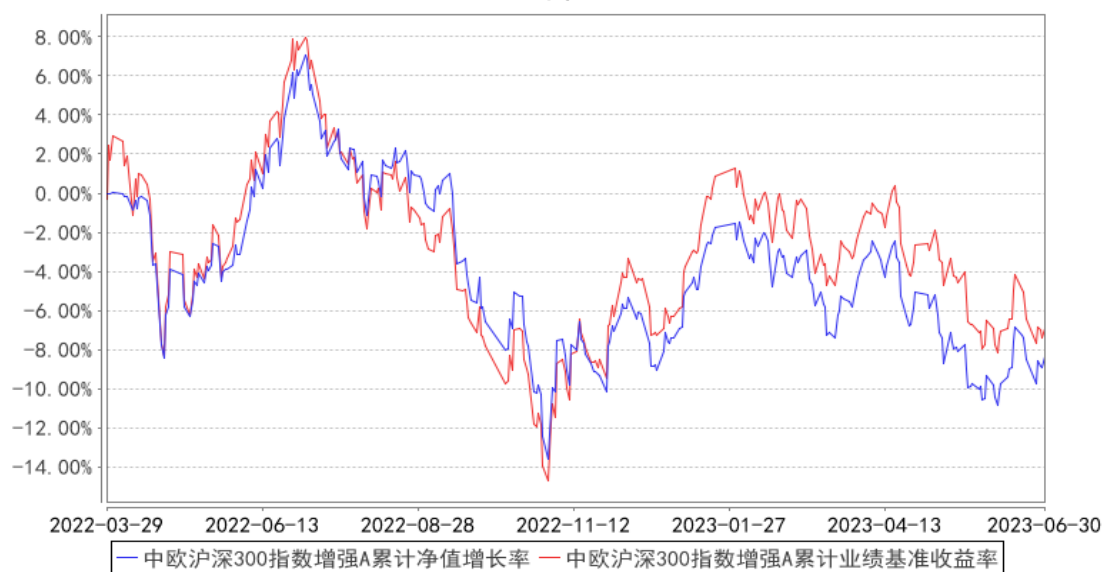
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	2.40%	0.78%	1.10%	0.83%	1.30%	-0.05%
过去三个月	-4.41%	0.78%	-4.88%	0.79%	0.47%	-0.01%
过去六个月	-1.36%	0.76%	-0.69%	0.80%	-0.67%	-0.04%
过去一年	-14.31%	0.88%	-13.60%	0.94%	-0.71%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	-9.06%	0.92%	-6.92%	1.04%	-2.14%	-0.12%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

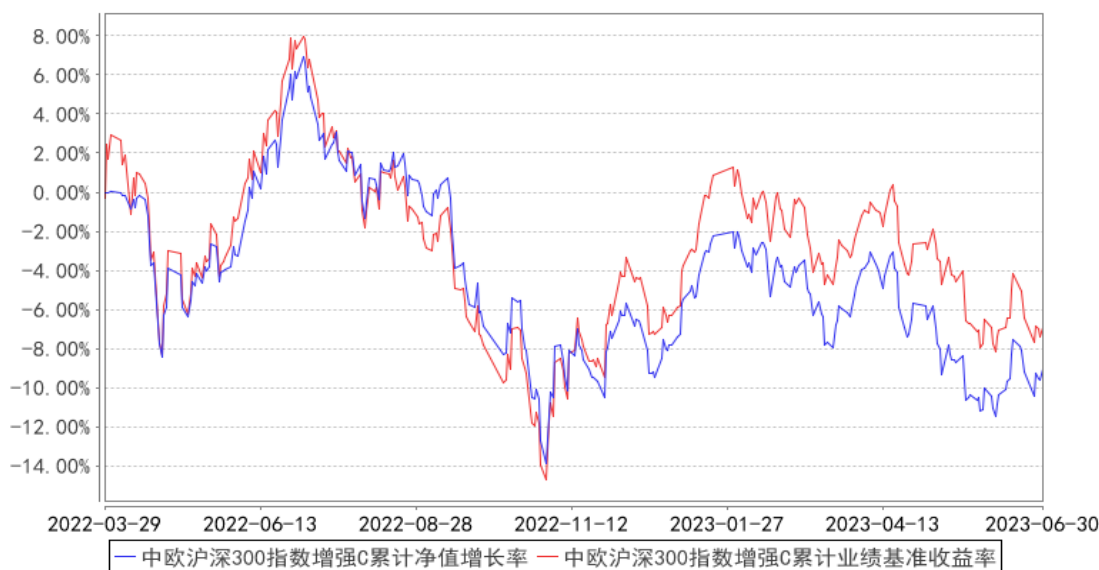
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 29 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。

中欧沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 3 月 29 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	2022-03-29	-	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。

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》第 9 页 共 60 页

》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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，市场先扬后抑，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。在我国产业结构转型，高质量发展的大背景下，决策层对于经济刺激的政策比较克制，没有进行大规模的低效投资，因此上游资源品需求不足，PPI 相对较弱，财政政策相对更加向战略新兴产业倾斜。展望下半年，我们当前的观点是“聚焦实业复苏，在短期波动中逢低布局”。

本基金是以沪深 300 指数为主要基准的指数增强基金，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。我们的投资策略有以下演进空间，这也是当前我们正在努力实践的方向：首先，加深对基本面的理解。虽然我们做了多年的基本面研究，但我们仍然需要不断加深对基本面的理解。因为基本面是一个不断变化的过程，行业也在不断变化。由此行业模型需要定期更新，在模型中加入一些新的元素。因此，我们要根据

行业发展和变化，及时对模型进行调整，而不是抓住一个指标就用到底。这是基本面量化策略演进的空间之一。其次，同时我们加深了与基本面投研和行业专家的交流：以提高对行业和个股判断的前瞻性。因为目前可用于判断的基本面指标相对较短，如公司盈利预期的变化或今年的产能规划等。但其实优秀的主动投资者通常具有更长远的投资视角，他们对行业和行业周期的判断，以及更前瞻性的视角是我们需要学习的方向。这也是我们的演进空间。最后从投资层面说，我们觉得要更加扎实地理解基本面，这有利于我们进一步提高投资的集中度。目前我们的投资分散程度跟传统量化策略比较相似，相比于主动基金还是过于分散。因此，在更深入理解基本面的基础上，提高投资的集中度，才能进一步提高超额收益的锐度。

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-1.06%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%；基金 C 类份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

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，我们认为宏观经济可能会维持“弱复苏”的趋势，同时货币政策相对较为宽松，为宏观经济的恢复性增长继续提供流动性。在这种环境下，人工智能、新能源产业技术升级、工业自动化等新兴产业的活跃度高于传统周期产业，复苏的方向依然是向上的，一方面是库存周期自身的运行节奏会在今年筑底复苏，另一方面是财政政策和货币政策后续的支持值得期待。我们看好后续稳增长政策在制造业投资、扩大新能源产业发展优势、扶持专精特新企业的方向上会有更多的落实，从而让财政政策对经济既有长效的托底作用，又有产业转型的支持作用。因此我们认为，在经济基本面的复苏、二级市场估值修复的大背景下，每一次调整都是机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL

形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧沪深 300 指数增强基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	33,048,812.33	23,123,623.44
结算备付金		2,175,924.31	504,557.65
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	267,448,482.26	304,365,182.69
其中：股票投资		264,415,192.94	300,289,447.90
基金投资		-	-
债券投资		3,033,289.32	4,075,734.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		987,728.39	1,099,539.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		303,660,947.29	329,092,902.81
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		-	-
应付赎回款		20,885,742.40	34,156.79
应付管理人报酬		239,035.90	280,367.99
应付托管费		23,903.56	28,036.79
应付销售服务费		36,337.57	36,048.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.42	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,302.56	150,000.00
负债合计		21,269,323.41	528,609.61
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	308,651,815.20	355,119,892.30
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-26,260,191.32	-26,555,599.10
净资产合计		282,391,623.88	328,564,293.20
负债和净资产总计		303,660,947.29	329,092,902.81

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 308,651,815.20 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9163 元，基金份额总额 245,716,652.43 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9094 元，基金份额总额 62,935,162.77 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 03 月 29 日生效，上年度可比期间自 2022 年 03 月 29 日至 2022 年 06 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 29 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,346,788.13	19,478,098.01
1. 利息收入		79,432.00	508,788.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	79,390.26	359,778.69
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		-	149,010.22
证券出借利息收入		41.74	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		597,771.22	-3,008,362.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,639,196.87	-5,754,955.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,238.37	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-138,611.15	700,639.03
股利收益	6.4.7.14	2,357,340.87	2,045,954.72
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	657,453.92	21,971,464.45
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	12,130.99	6,206.86
减：二、营业总支出		1,968,007.49	1,472,608.25
1. 管理人报酬		1,524,031.76	1,058,684.45
2. 托管费		152,403.16	105,868.44
3. 销售服务费		195,604.65	253,609.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,593.48	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,593.48	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		71.88	2,526.48
8. 其他费用	6.4.7.18	93,302.56	51,919.58
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-621,219.36	18,005,489.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-621,219.36	18,005,489.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-621,219.36	18,005,489.76

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金

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)	355,119,892.30	-	-26,555,599.10	328,564,293.20
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)	355,119,892.30	-	-26,555,599.10	328,564,293.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,468,077.10	-	295,407.78	-46,172,669.32
(一)、综合收益总额	-	-	-621,219.36	-621,219.36
(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)	-46,468,077.10	-	916,627.14	-45,551,449.96
其中: 1. 基金申购款	168,202,487.76	-	-9,984,072.60	158,218,415.16
2. 基金赎回款	-214,670,564.86	-	10,900,699.74	-203,769,865.12
(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)	308,651,815.20	-	-26,260,191.32	282,391,623.88
项目	上年度可比期间			
	2022年3月29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)	458,006,211.15	-	-	458,006,211.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-179,614,970.55	-	17,413,629.22	-162,201,341.33

(一)、综合收益总额	-	-	18,005,489.76	18,005,489.76
(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)	-179,614,970.55	-	-591,860.54	-180,206,831.09
其中：1. 基金申购款	40,977,713.65	-	1,560,393.17	42,538,106.82
2. 基金赎回款	-220,592,684.20	-	-2,152,253.71	-222,744,937.91
(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)	278,391,240.60	-	17,413,629.22	295,804,869.82

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

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]420 号文《关于准予中欧沪深 300 指数增强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《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 457,941,377.28 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_B24 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 29

日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 458,006,211.15 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 64,833.87 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 266,814,800.45 份，包含认购利息折合 36,894.40 份；C 类基金的基金份额总额为 191,191,410.70 份，包含认购利息折合 27,939.47 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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、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）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 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	20,413,641.21
等于：本金	20,411,956.08
加：应计利息	1,685.13
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	12,635,171.12
等于：本金	12,632,205.16
加：应计利息	2,965.96
减：坏账准备	-
合计	33,048,812.33

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	268,837,546.67	-	264,415,192.94	-4,422,353.73	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,998,290.00	27,589.32	3,033,289.32	7,410.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,998,290.00	27,589.32	3,033,289.32	7,410.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	271,835,836.67	27,589.32	267,448,482.26	-4,414,943.73	

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

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	84,302.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧沪深 300 指数增强 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	281,563,579.40	281,563,579.40
本期申购	70,893,308.32	70,893,308.32
本期赎回（以“-”号填列）	-106,740,235.29	-106,740,235.29
本期末	245,716,652.43	245,716,652.43

中欧沪深 300 指数增强 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	73,556,312.90	73,556,312.90
本期申购	97,309,179.44	97,309,179.44
本期赎回（以“-”号填列）	-107,930,329.57	-107,930,329.57
本期末	62,935,162.77	62,935,162.77

注：申购份额含红利再投份额、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

中欧沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,005,308.97	-13,802,052.08	-20,807,361.05
本期利润	-773,829.30	-134,149.21	-907,978.51
本期基金份额交易产生的变动数	492,397.13	664,740.07	1,157,137.20
其中：基金申购款	-1,133,809.17	-2,902,202.69	-4,036,011.86
基金赎回款	1,626,206.30	3,566,942.76	5,193,149.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,286,741.14	-13,271,461.22	-20,558,202.36

中欧沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-2,147,544.19	-3,600,693.86	-5,748,238.05
本期利润	-504,843.98	791,603.13	286,759.15
本期基金份额交易产生的变动数	341,277.65	-581,787.71	-240,510.06
其中：基金申购款	-2,033,696.53	-3,914,364.21	-5,948,060.74
基金赎回款	2,374,974.18	3,332,576.50	5,707,550.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,311,110.52	-3,390,878.44	-5,701,988.96

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	17,345.50	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	52,664.62	
结算备付金利息收入	9,380.14	
其他	-	
合计	79,390.26	

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	879,627,464.74	
减：卖出股票成本总额	879,352,385.73	
减：交易费用	1,914,275.88	
买卖股票差价收入	-1,639,196.87	

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	26,038.37	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,800.00	
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	18,238.37	

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	4,089,600.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,007,800.00
减：应计利息总额	89,600.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-7,800.00

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	-138,611.15

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	2,357,340.87
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	2,357,340.87

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	657,453.92
股票投资	643,843.92
债券投资	13,610.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
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	657,453.92

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	12,034.19
基金转换费收入	96.80
合计	12,130.99

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
合计	93,302.56

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
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	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

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 29 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（%）
国泰君安证券	1,053,165,992.65	61.40	801,144,534.75	70.30

6.4.10.1.2 债券交易

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 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
国泰君安证券	3,015,306.16	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 29 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 (%)
国泰君安证券	14,000,000.00	100.00	276,000,000.00	85.45

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 (%)
国泰君安证券	549,027.69	61.21	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年3月29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 (%)
国泰君安证券	413,707.43	68.99	-	-

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29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	1,524,031.76	1,058,684.45
其中：支付销售机构的客户维护费	355,979.40	341,368.29

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 3 月 29 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	152,403.16	105,868.44

注：注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	中欧沪深 300 指数增强 A	中欧沪深 300 指数增强 C	合计
国泰君安证券	-	123,741.51	123,741.51
中欧财富	-	1,364.44	1,364.44
中欧基金	-	11,603.61	11,603.61
合计	-	136,709.56	136,709.56
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 29 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		
	中欧沪深 300 指数增强 A	中欧沪深 300 指数增强 C	合计
国泰君安证券	-	175,568.99	175,568.99
中欧基金	-	90.21	90.21

合计	-	175,659.20	175,659.20
----	---	------------	------------

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提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人

根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的

账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

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

中欧沪深 300 指数增强 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	107,231.88	0.04%	155,379.68	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、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均未持有本基金 C 类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 3 月 29 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
国泰君安证券股份有限公司	26,283,322.49	48,640.21	15,505,605.51	160,888.54

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安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	258	10,629.60	11,014.02	-
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	216	7,344.00	7,544.88	-
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	2,442	63,052.44	63,052.44	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	272	7,023.04	7,023.04	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	221	10,194.73	7,602.40	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	192	11,112.96	9,440.64	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	366	18,300.00	11,239.86	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	631	19,466.35	14,910.53	-
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	1,648	60,811.20	60,811.20	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	184	6,789.60	6,789.60	-

301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	374	11,302.28	9,537.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.54	25.10	332	10,470.66	8,333.20	-
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	4,367	87,296.33	87,296.33	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	486	9,715.14	9,715.14	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	283	8,376.80	20,211.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,851	14,255.00	25,544.96	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	448	11,312.00	8,821.12	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	394	12,741.96	12,552.84	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	218	14,667.04	14,263.74	-
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	694	14,344.98	18,161.98	-

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	174	6,796.44	6,848.64	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	150	11,520.00	16,192.50	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	649	9,611.69	8,910.77	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	218	7,106.80	6,620.66	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	116	8,520.20	5,410.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	459	8,055.45	7,688.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	178	8,900.00	8,613.42	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	386	9,175.22	16,555.54	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	128	9,200.64	11,852.80	-
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	343	8,458.38	7,720.93	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	327	7,782.60	10,738.68	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	306	9,176.94	7,279.74	-
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	3,818	101,864.24	101,864.24	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	425	11,339.00	11,339.00	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	241	10,601.59	12,428.37	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	702	11,400.48	11,898.90	-
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	396	7,916.04	6,692.40	-
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	1,813	104,537.58	104,537.58	-

301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	202	11,647.32	11,647.32	-
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	2,288	91,016.64	91,016.64	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	255	10,143.90	10,143.90	-
603172	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	1,703	33,821.58	30,756.18	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	615	8,708.40	9,969.15	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	332	6,374.40	8,475.96	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	477	18,068.76	14,066.73	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	2,981	16,961.89	16,127.21	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,169	12,975.90	19,919.76	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	325	12,996.75	11,930.75	-

688512	慧 智 微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	20.92	19.16	426	8,911.92	8,162.16	-
688523	航 天 环 宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股 流通 受限	21.86	23.85	399	8,722.14	9,516.15	-
688531	日 联 科 技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	152.38	135.97	99	15,085.62	13,461.03	-
688535	华 海 诚 科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航 天 南 湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	21.17	23.50	403	8,531.51	9,470.50	-
688562	航 天 软 件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	12.68	22.31	584	7,405.12	13,029.04	-
688570	天 玛 智 控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	30.26	25.33	304	9,199.04	7,700.32	-
688576	西 山 科 技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	135.80	120.41	103	13,987.40	12,402.23	-
688581	安 杰 思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	125.80	118.03	75	9,435.00	8,852.25	-
688582	芯 动 联 科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	26.74	40.68	321	8,583.54	13,058.28	-
688593	新 相 微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	11.18	14.59	692	7,736.56	10,096.28	-

688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	838	8,949.84	10,340.92	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	75	9,441.00	6,509.25	-
688629	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	230	5,814.40	6,870.10	-

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

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本

基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查的检查和反馈。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公司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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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	33,048,812.33	-	-	-	33,048,812.33
结算备付金	2,175,924.31	-	-	-	2,175,924.31
交易性金融资产	3,033,289.32	-	-	-264,415,192.94	267,448,482.26
应收申购款	-	-	-	987,728.39	987,728.39
资产总计	38,258,025.96	-	-	-265,402,921.33	303,660,947.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,885,742.40	20,885,742.40
应付管理人报酬	-	-	-	239,035.90	239,035.90
应付托管费	-	-	-	23,903.56	23,903.56
应付销售服务费	-	-	-	36,337.57	36,337.57
应交税费	-	-	-	1.42	1.42
其他负债	-	-	-	84,302.56	84,302.56
负债总计	-	-	-	21,269,323.41	21,269,323.41
利率敏感度缺口	38,258,025.96	-	-	-244,133,597.92	282,391,623.88
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	23,123,623.44	-	-	-	23,123,623.44
结算备付金	504,557.65	-	-	-	504,557.65
交易性金融资产	4,075,734.79	-	-	-300,289,447.90	304,365,182.69
应收申购款	-	-	-	1,099,539.03	1,099,539.03
资产总计	27,703,915.88	-	-	-301,388,986.93	329,092,902.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,156.79	34,156.79
应付管理人报酬	-	-	-	280,367.99	280,367.99
应付托管费	-	-	-	28,036.79	28,036.79
应付销售服务费	-	-	-	36,048.04	36,048.04
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	528,609.61	528,609.61
利率敏感度缺口	27,703,915.88	-	-	-300,860,377.32	328,564,293.20

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 1.07%（2022 年 12 月 31 日：1.24%），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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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	264,415,192.94	93.63	300,289,447.90	91.39
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	264,415,192.94	93.63	300,289,447.90	91.39

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	12,865,997.19	14,691,987.38

	5%		
	业绩比较基准下降	-12,865,997.19	-14,691,987.38
	5%		

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	263,187,267.62	299,471,193.17
第二层次	3,598,525.75	4,075,734.79
第三层次	662,688.89	818,254.73
合计	267,448,482.26	304,365,182.69

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	264,415,192.94	87.08
	其中：股票	264,415,192.94	87.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,033,289.32	1.00
	其中：债券	3,033,289.32	1.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	35,224,736.64	11.60
8	其他各项资产	987,728.39	0.33
9	合计	303,660,947.29	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,698,105.00	2.02
B	采矿业	5,996,581.00	2.12
C	制造业	126,230,065.44	44.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,117,349.60	2.17
E	建筑业	5,447,152.80	1.93
F	批发和零售业	1,389,131.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	4,387,505.00	1.55
H	住宿和餐饮业	1,257,498.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,079,344.74	3.92
J	金融业	51,924,727.90	18.39
K	房地产业	7,509,450.00	2.66
L	租赁和商务服务业	254,219.00	0.09

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	623,280.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	516,571.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	228,430,980.48	80.89

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,178,190.00	0.42
C	制造业	30,164,345.15	10.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,151,500.00	0.41
F	批发和零售业	442,516.83	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,106,436.00	0.39
J	金融业	1,444,520.00	0.51
K	房地产业	290,178.00	0.10
L	租赁和商务服务业	137,074.30	0.05
M	科学研究和技术服务业	32,816.80	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	16,423.52	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,211.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,984,212.46	12.74

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	263,700	12,235,680.00	4.33
2	600519	贵州茅台	4,900	8,285,900.00	2.93
3	300750	宁德时代	30,500	6,978,095.00	2.47
4	000063	中兴通讯	134,900	6,143,346.00	2.18
5	600150	中国船舶	157,600	5,186,616.00	1.84
6	002714	牧原股份	122,300	5,154,945.00	1.83
7	002459	晶澳科技	120,060	5,006,502.00	1.77
8	601628	中国人寿	139,700	4,883,912.00	1.73
9	600600	青岛啤酒	42,500	4,404,275.00	1.56
10	600011	华能国际	421,300	3,901,238.00	1.38
11	000568	泸州老窖	16,300	3,415,991.00	1.21
12	688223	晶科能源	234,136	3,291,952.16	1.17
13	002142	宁波银行	128,400	3,248,520.00	1.15
14	000938	紫光股份	87,500	2,786,875.00	0.99
15	300408	三环集团	93,500	2,744,225.00	0.97
16	002920	德赛西威	16,400	2,555,284.00	0.90
17	001979	招商蛇口	192,600	2,509,578.00	0.89
18	000596	古井贡酒	10,000	2,473,800.00	0.88
19	600926	杭州银行	208,900	2,454,575.00	0.87
20	600426	华鲁恒升	79,400	2,432,022.00	0.86
21	300274	阳光电源	19,800	2,309,274.00	0.82
22	603486	科沃斯	28,800	2,239,776.00	0.79
23	603369	今世缘	42,100	2,222,880.00	0.79
24	600036	招商银行	64,900	2,126,124.00	0.75
25	600309	万华化学	24,200	2,125,728.00	0.75
26	002555	三七互娱	58,100	2,026,528.00	0.72
27	300433	蓝思科技	170,000	1,999,200.00	0.71
28	300059	东方财富	133,380	1,893,996.00	0.67
29	600048	保利发展	141,600	1,845,048.00	0.65
30	600276	恒瑞医药	37,700	1,805,830.00	0.64
31	601601	中国太保	68,800	1,787,424.00	0.63
32	601865	福莱特	43,900	1,690,589.00	0.60
33	601336	新华保险	45,900	1,687,743.00	0.60
34	601377	兴业证券	275,400	1,685,448.00	0.60
35	000069	华侨城 A	381,800	1,679,920.00	0.59
36	600115	中国东航	351,800	1,674,568.00	0.59

37	300033	同花顺	9,400	1,647,632.00	0.58
38	600845	宝信软件	32,140	1,633,033.40	0.58
39	002371	北方华创	5,100	1,620,015.00	0.57
40	300124	汇川技术	24,600	1,579,566.00	0.56
41	000333	美的集团	25,900	1,526,028.00	0.54
42	002129	TCL 中环	45,100	1,497,320.00	0.53
43	000002	万科 A	105,200	1,474,904.00	0.52
44	600028	中国石化	226,500	1,440,540.00	0.51
45	601800	中国交建	130,400	1,422,664.00	0.50
46	600030	中信证券	71,605	1,416,346.90	0.50
47	600085	同仁堂	24,400	1,404,464.00	0.50
48	002709	天赐材料	34,000	1,400,460.00	0.50
49	603659	璞泰来	36,500	1,395,030.00	0.49
50	600183	生益科技	98,000	1,391,600.00	0.49
51	000661	长春高新	10,100	1,376,630.00	0.49
52	603899	晨光股份	30,400	1,357,056.00	0.48
53	601390	中国中铁	173,900	1,318,162.00	0.47
54	601668	中国建筑	227,300	1,304,702.00	0.46
55	688012	中微公司	8,325	1,302,446.25	0.46
56	000425	徐工机械	190,600	1,290,362.00	0.46
57	600754	锦江酒店	29,700	1,257,498.00	0.45
58	002007	华兰生物	55,000	1,232,550.00	0.44
59	600570	恒生电子	27,546	1,220,012.34	0.43
60	688036	传音控股	8,240	1,211,280.00	0.43
61	600809	山西汾酒	6,500	1,202,955.00	0.43
62	002236	大华股份	60,800	1,200,800.00	0.43
63	601288	农业银行	336,800	1,188,904.00	0.42
64	000977	浪潮信息	24,500	1,188,250.00	0.42
65	600958	东方证券	119,500	1,159,150.00	0.41
66	600875	东方电气	62,000	1,156,300.00	0.41
67	002475	立讯精密	35,600	1,155,220.00	0.41
68	600584	长电科技	37,000	1,153,290.00	0.41
69	601728	中国电信	204,000	1,148,520.00	0.41
70	601899	紫金矿业	100,100	1,138,137.00	0.40
71	600919	江苏银行	154,700	1,137,045.00	0.40
72	000338	潍柴动力	90,600	1,128,876.00	0.40
73	601138	工业富联	44,200	1,113,840.00	0.39
74	600989	宝丰能源	86,100	1,085,721.00	0.38
75	002179	中航光电	22,900	1,038,515.00	0.37
76	601857	中国石油	137,300	1,025,631.00	0.36
77	300316	晶盛机电	14,200	1,006,780.00	0.36
78	601939	建设银行	154,600	967,796.00	0.34
79	688599	天合光能	22,521	959,619.81	0.34

80	601688	华泰证券	69,200	952,884.00	0.34
81	601838	成都银行	77,200	942,612.00	0.33
82	601066	中信建投	38,500	931,700.00	0.33
83	601633	长城汽车	37,000	931,290.00	0.33
84	600803	新奥股份	48,900	928,122.00	0.33
85	002460	赣锋锂业	15,100	920,496.00	0.33
86	605499	东鹏饮料	5,300	916,370.00	0.32
87	000858	五粮液	5,528	904,214.96	0.32
88	600031	三一重工	54,000	898,020.00	0.32
89	002230	科大讯飞	13,200	897,072.00	0.32
90	600941	中国移动	9,600	895,680.00	0.32
91	601360	三六零	71,200	892,848.00	0.32
92	600346	恒力石化	62,000	888,460.00	0.31
93	600547	山东黄金	37,700	885,196.00	0.31
94	601600	中国铝业	160,600	881,694.00	0.31
95	002271	东方雨虹	32,200	877,772.00	0.31
96	300957	贝泰妮	9,700	862,136.00	0.31
97	601009	南京银行	106,500	852,000.00	0.30
98	600406	国电南瑞	36,400	840,840.00	0.30
99	601166	兴业银行	51,900	812,235.00	0.29
100	000786	北新建材	32,600	799,026.00	0.28
101	000001	平安银行	70,100	787,223.00	0.28
102	603195	公牛集团	8,016	770,016.96	0.27
103	000725	京东方 A	187,900	768,511.00	0.27
104	601766	中国中车	115,100	748,150.00	0.26
105	000963	华东医药	17,200	745,964.00	0.26
106	603290	斯达半导	3,400	731,680.00	0.26
107	601398	工商银行	149,200	719,144.00	0.25
108	601878	浙商证券	71,600	707,408.00	0.25
109	601012	隆基绿能	24,100	690,947.00	0.24
110	603833	欧派家居	7,200	689,760.00	0.24
111	002304	洋河股份	5,200	683,020.00	0.24
112	600029	南方航空	106,800	644,004.00	0.23
113	601607	上海医药	28,700	643,167.00	0.23
114	601111	中国国航	76,200	627,888.00	0.22
115	300015	爱尔眼科	33,600	623,280.00	0.22
116	600900	长江电力	28,100	619,886.00	0.22
117	002415	海康威视	18,600	615,846.00	0.22
118	688111	金山办公	1,300	613,886.00	0.22
119	601229	上海银行	106,200	610,650.00	0.22
120	000733	振华科技	6,300	603,855.00	0.21
121	601699	潞安环能	36,300	592,416.00	0.21
122	002756	永兴材料	8,830	552,846.30	0.20

123	600176	中国巨石	39,000	552,240.00	0.20
124	600436	片仔癀	1,900	544,084.00	0.19
125	300498	温氏股份	29,600	543,160.00	0.19
126	002493	荣盛石化	46,200	537,768.00	0.19
127	300413	芒果超媒	15,100	516,571.00	0.18
128	600588	用友网络	25,100	514,550.00	0.18
129	601021	春秋航空	8,900	511,483.00	0.18
130	601100	恒立液压	7,800	501,774.00	0.18
131	600690	海尔智家	20,800	488,384.00	0.17
132	601816	京沪高铁	92,100	484,446.00	0.17
133	600039	四川路桥	48,880	479,512.80	0.17
134	002648	卫星化学	32,000	478,720.00	0.17
135	600886	国投电力	37,824	478,473.60	0.17
136	603993	洛阳钼业	89,700	478,101.00	0.17
137	002311	海大集团	9,800	459,032.00	0.16
138	600009	上海机场	9,800	445,116.00	0.16
139	601225	陕西煤业	24,000	436,560.00	0.15
140	300223	北京君正	4,500	397,395.00	0.14
141	300454	深信服	3,500	396,375.00	0.14
142	688981	中芯国际	7,800	394,056.00	0.14
143	605117	德业股份	2,600	388,830.00	0.14
144	601328	交通银行	64,000	371,200.00	0.13
145	600837	海通证券	39,800	366,956.00	0.13
146	688126	沪硅产业	16,500	344,850.00	0.12
147	601618	中国中冶	86,600	343,802.00	0.12
148	300122	智飞生物	7,100	313,820.00	0.11
149	601186	中国铁建	31,100	306,335.00	0.11
150	600016	民生银行	80,300	301,125.00	0.11
151	002736	国信证券	34,100	297,693.00	0.11
152	600999	招商证券	21,900	297,183.00	0.11
153	601788	光大证券	18,600	295,554.00	0.10
154	000166	申万宏源	61,200	282,744.00	0.10
155	601995	中金公司	7,900	280,608.00	0.10
156	000776	广发证券	18,500	272,135.00	0.10
157	600606	绿地控股	98,900	271,975.00	0.10
158	601319	中国人保	46,500	271,560.00	0.10
159	603019	中科曙光	5,300	269,770.00	0.10
160	601818	光大银行	85,900	263,713.00	0.09
161	603392	万泰生物	3,900	260,403.00	0.09
162	601888	中国中免	2,300	254,219.00	0.09
163	002821	凯莱英	2,100	247,506.00	0.09
164	000100	TCL 科技	62,300	245,462.00	0.09
165	601901	方正证券	36,600	239,364.00	0.08

166	601881	中国银河	20,500	238,005.00	0.08
167	601169	北京银行	51,400	237,982.00	0.08
168	600918	中泰证券	33,800	233,558.00	0.08
169	600760	中航沈飞	5,060	227,700.00	0.08
170	601988	中国银行	57,000	222,870.00	0.08
171	600061	国投资本	30,600	217,872.00	0.08
172	600015	华夏银行	38,400	207,744.00	0.07
173	600460	士兰微	6,800	205,836.00	0.07
174	000625	长安汽车	15,000	193,950.00	0.07
175	300782	卓胜微	2,000	193,260.00	0.07
176	601658	邮储银行	39,000	190,710.00	0.07
177	600674	川投能源	12,600	189,630.00	0.07
178	300896	爱美客	400	177,980.00	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002518	科士达	61,300	2,452,613.00	0.87
2	000739	普洛药业	100,400	1,781,096.00	0.63
3	603338	浙江鼎力	27,600	1,545,876.00	0.55
4	600908	无锡银行	269,500	1,444,520.00	0.51
5	002568	百润股份	39,300	1,428,555.00	0.51
6	688333	铂力特	11,492	1,215,164.08	0.43
7	600583	海油工程	201,400	1,178,190.00	0.42
8	300357	我武生物	34,800	1,170,324.00	0.41
9	002409	雅克科技	15,900	1,158,792.00	0.41
10	000032	深桑达 A	35,000	1,151,500.00	0.41
11	688009	中国通号	197,642	1,146,323.60	0.41
12	300910	瑞丰新材	22,430	1,128,229.00	0.40
13	688617	惠泰医疗	3,000	1,121,250.00	0.40
14	603737	三棵树	16,420	1,074,196.40	0.38
15	000729	燕京啤酒	85,300	1,063,691.00	0.38
16	688551	科威尔	12,365	810,896.70	0.29
17	688516	奥特维	4,100	772,440.00	0.27
18	603027	千禾味业	36,500	770,880.00	0.27
19	002984	森麒麟	23,400	736,164.00	0.26
20	000409	云鼎科技	62,500	624,375.00	0.22
21	603757	大元泵业	19,800	590,832.00	0.21
22	002536	飞龙股份	36,400	546,000.00	0.19
23	603345	安井食品	3,700	543,160.00	0.19
24	002865	钧达股份	3,500	533,855.00	0.19
25	002056	横店东磁	25,800	469,818.00	0.17
26	002959	小熊电器	5,500	459,250.00	0.16
27	603215	比依股份	25,400	455,676.00	0.16

28	002728	特一药业	29,880	455,670.00	0.16
29	000921	海信家电	15,700	423,115.00	0.15
30	600353	旭光电子	47,040	385,728.00	0.14
31	600060	海信视像	14,200	351,450.00	0.12
32	601058	赛轮轮胎	30,300	345,117.00	0.12
33	300314	戴维医疗	14,500	306,530.00	0.11
34	002244	滨江集团	32,900	290,178.00	0.10
35	300532	今天国际	14,000	287,840.00	0.10
36	600785	新华百货	18,700	254,133.00	0.09
37	688722	同益中	13,700	253,998.00	0.09
38	002384	东山精密	9,600	248,640.00	0.09
39	688639	华恒生物	2,700	244,296.00	0.09
40	002600	领益智造	34,800	240,468.00	0.09
41	002595	豪迈科技	6,700	235,371.00	0.08
42	300580	贝斯特	8,700	211,323.00	0.07
43	301367	怡和嘉业	1,400	207,676.00	0.07
44	688410	山外山	3,600	189,000.00	0.07
45	600066	宇通客车	12,500	184,250.00	0.07
46	600230	沧州大化	12,100	177,628.00	0.06
47	603059	倍加洁	7,700	175,098.00	0.06
48	300592	华凯易佰	6,200	168,764.00	0.06
49	600817	宇通重工	14,600	163,374.00	0.06
50	688569	铁科轨道	3,719	156,458.33	0.06
51	002870	香山股份	4,700	155,899.00	0.06
52	002334	英威腾	12,200	155,428.00	0.06
53	603529	爱玛科技	4,700	151,434.00	0.05
54	688582	芯动联科	3,204	148,126.83	0.05
55	605168	三人行	1,595	137,074.30	0.05
56	300624	万兴科技	1,100	128,865.00	0.05
57	002885	京泉华	5,380	117,499.20	0.04
58	301486	致尚科技	2,015	116,184.90	0.04
59	301395	仁信新材	4,243	113,203.24	0.04
60	301488	豪恩汽电	2,543	101,160.54	0.04
61	301210	金杨股份	1,914	97,830.90	0.03
62	301292	海科新源	4,853	97,011.47	0.03
63	688429	时创能源	3,317	94,891.71	0.03
64	301357	北方长龙	1,773	91,681.02	0.03
65	002937	兴瑞科技	3,200	78,720.00	0.03
66	301202	朗威股份	2,714	70,075.48	0.02
67	301261	恒工精密	1,832	67,600.80	0.02
68	688472	阿特斯	3,637	65,232.24	0.02
69	688249	晶合集成	1,703	30,756.18	0.01
70	301301	川宁生物	2,851	25,544.96	0.01

71	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
72	301293	三博脑科	283	20,211.86	0.01
73	301281	科源制药	727	18,753.30	0.01
74	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
75	603235	天新药业	572	17,937.92	0.01
76	301358	湖南裕能	386	16,555.54	0.01
77	301325	曼恩斯特	150	16,192.50	0.01
78	688469	中芯集成	2,981	16,127.21	0.01
79	301260	格力博	631	14,910.53	0.01
80	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
81	301310	鑫宏业	218	14,263.74	0.01
82	688443	智翔金泰	477	14,066.73	0.00
83	688531	日联科技	99	13,461.03	0.00
84	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
85	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
86	688562	航天软件	584	13,029.04	0.00
87	301307	美利信	394	12,552.84	0.00
88	301399	英特科技	241	12,428.37	0.00
89	688576	西山科技	103	12,402.23	0.00
90	301277	新天地	622	12,135.22	0.00
91	688484	南芯科技	325	11,930.75	0.00
92	301408	华人健康	702	11,898.90	0.00
93	301360	荣旗科技	128	11,852.80	0.00
94	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
95	301246	宏源药业	366	11,239.86	0.00
96	301141	中科磁业	258	11,014.02	0.00
97	301382	蜂助手	327	10,738.68	0.00
98	688620	安凯微	838	10,340.92	0.00
99	688593	新相微	692	10,096.28	0.00
100	688334	西高院	615	9,969.15	0.00
101	301262	海看股份	374	9,537.00	0.00
102	688523	航天环宇	399	9,516.15	0.00
103	688552	航天南湖	403	9,470.50	0.00
104	301332	德尔玛	649	8,910.77	0.00
105	688581	安杰思	75	8,852.25	0.00
106	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
107	301305	朗坤环境	448	8,821.12	0.00
108	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
109	688512	慧智微	426	8,162.16	0.00
110	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
111	301376	致欧科技	343	7,720.93	0.00
112	688570	天玛智控	304	7,700.32	0.00
113	301355	南王科技	459	7,688.25	0.00

114	301203	国泰环保	221	7,602.40	0.00
115	301170	锡南科技	216	7,544.88	0.00
116	301386	未来电器	306	7,279.74	0.00
117	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
118	688631	莱斯信息	230	6,870.10	0.00
119	301323	新莱福	174	6,848.64	0.00
120	301439	泓淋电力	396	6,692.40	0.00
121	301337	亚华电子	218	6,620.66	0.00
122	688623	双元科技	75	6,509.25	0.00
123	301345	涛涛车业	116	5,410.24	0.00
124	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
125	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
126	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
127	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	601318	中国平安	17,141,252.00	5.22
2	002371	北方华创	11,977,201.43	3.65
3	603369	今世缘	10,950,224.00	3.33
4	000100	TCL 科技	10,269,789.00	3.13
5	300750	宁德时代	9,232,078.91	2.81
6	600048	保利发展	8,991,113.00	2.74
7	002555	三七互娱	8,667,628.00	2.64
8	000063	中兴通讯	8,107,428.00	2.47
9	300408	三环集团	7,966,239.00	2.42
10	600183	生益科技	7,776,709.00	2.37
11	002920	德赛西威	7,721,284.00	2.35
12	002938	鹏鼎控股	7,618,247.00	2.32
13	600600	青岛啤酒	7,603,901.00	2.31
14	600011	华能国际	7,573,336.00	2.30
15	605117	德业股份	7,383,276.00	2.25
16	000938	紫光股份	7,368,616.00	2.24
17	600926	杭州银行	7,339,420.00	2.23
18	002129	TCL 中环	7,241,358.00	2.20
19	600150	中国船舶	7,111,311.00	2.16
20	300763	锦浪科技	6,930,014.00	2.11
21	002714	牧原股份	6,921,882.00	2.11

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	002371	北方华创	14,973,248.00	4.56
2	002555	三七互娱	13,298,346.00	4.05
3	601066	中信建投	12,933,598.00	3.94
4	600926	杭州银行	12,864,717.00	3.92
5	600837	海通证券	12,685,296.00	3.86
6	600030	中信证券	12,193,333.00	3.71
7	002142	宁波银行	11,192,318.00	3.41
8	000002	万科 A	10,733,813.00	3.27
9	002938	鹏鼎控股	10,364,751.00	3.15
10	600048	保利发展	10,004,851.00	3.05
11	000100	TCL 科技	9,823,713.60	2.99
12	300014	亿纬锂能	8,880,419.00	2.70
13	600570	恒生电子	8,665,492.30	2.64
14	603369	今世缘	8,485,101.00	2.58
15	600150	中国船舶	8,330,009.30	2.54
16	601966	玲珑轮胎	8,041,787.00	2.45
17	300750	宁德时代	7,665,209.40	2.33
18	002841	视源股份	7,397,287.39	2.25
19	300274	阳光电源	7,379,849.00	2.25
20	002129	TCL 中环	7,353,186.00	2.24
21	601138	工业富联	7,113,018.00	2.16
22	002714	牧原股份	6,996,926.20	2.13
23	002594	比亚迪	6,957,417.00	2.12
24	002459	晶澳科技	6,701,520.80	2.04
25	002475	立讯精密	6,637,166.00	2.02
26	300763	锦浪科技	6,635,774.00	2.02
27	600183	生益科技	6,603,049.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	842,834,286.85
卖出股票收入（成交）总额	879,627,464.74

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	3,033,289.32	1.07
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	3,033,289.32	1.07

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	019694	23 国债 01	30,000	3,033,289.32	1.07

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

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	987,728.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	987,728.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧沪深 300 指数 增强 A	2,613	94,036.22	126,889,057.04	51.64%	118,827,595.39	48.36%
中欧沪深 300 指数 增强 C	1,566	40,188.48	391,378.48	0.62%	62,543,784.29	99.38%
合计	4,179	73,857.82	127,280,435.52	41.24%	181,371,379.68	58.76%

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	中欧沪深 300 指数增强 A	120,059.28	0.05%
	中欧沪深 300 指数增强 C	9,795.21	0.02%
	合计	129,854.49	0.04%

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	中欧沪深 300 指数增强 A	0
	中欧沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧沪深 300 指数增强 A	0
	中欧沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧沪深 300 指数增强 A	中欧沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 29 日) 基金份额总额	266,814,800.45	191,191,410.70
本报告期期初基金份额总额	281,563,579.40	73,556,312.90
本报告期基金总申购份额	70,893,308.32	97,309,179.44
减：本报告期基金总赎回份额	106,740,235.29	107,930,329.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	245,716,652.43	62,935,162.77
-------------	----------------	---------------

注：总申购份额含红利再投份额、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 (%)	
国泰君安	3	1,053,165,992.65	61.40	549,027.69	61.21	本报告期新增 1 个
东海证券	2	361,477,276.07	21.08	188,432.79	21.01	-
恒泰证券	3	300,502,000.04	17.52	159,498.38	17.78	-

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 (%)
国泰君安	3,015,306.16	100.00	14,000,000.00	100.00	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧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	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 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	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 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	中国证监会指定媒介	2023-04-22

	2023 年第一季度报告的提示性公告		
7	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 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权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
9	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	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、中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话: 021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日