

中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 29 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。本年度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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	50

8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧国证 2000 指数增强	
基金主代码	018663	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 18 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,839,842.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018663	018664
报告期末下属分级基金的份额总额	73,062,173.99 份	70,777,668.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以国证 2000 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 8.0%。</p> <p>同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用公司量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合，以争取实现指数增强型基金的目标。</p>
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金为股票型指数增强基金，跟踪国证 2000 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。</p>

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		中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	朱志明
	联系电话	021-68609600	4008-888-108
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700		95587
传真	021-33830351		010-56162085
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层		北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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		北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码	200120		100010
法定代表人	窦玉明		王常青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年 7 月 18 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	1,299,823.77	-255,555.46	-6,227,126.01	-8,995,701.44
本期利润	1,449,259.54	619,658.58	-8,909,756.94	-10,620,409.38
加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0042	-0.0290	-0.0305
本期加权平均净值利润率	0.99%	0.49%	-2.98%	-3.14%
本期基金份额净值增长率	7.62%	6.96%	-2.70%	-2.96%

3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
	期末可供分配利润	1,896,039.67	1,206,002.53	-6,392,590.85
期末可供分配基金份额利润	0.0260	0.0170	-0.0270	-0.0296
期末基金资产净值	74,958,213.66	71,983,671.02	230,536,058.11	187,279,690.69
期末基金份额净值	1.0260	1.0170	0.9730	0.9704
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	基金份额累计净值增长率	4.71%	3.79%	-2.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同自 2023 年 07 月 18 日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

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

中欧国证 2000 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
过去三个月	12.75%	2.25%	5.99%	2.40%	6.76%	-0.15%
过去六个月	28.10%	2.10%	22.48%	2.21%	5.62%	-0.11%
过去一年	7.62%	2.00%	-0.39%	2.12%	8.01%	-0.12%
自基金合同生效起至今	4.71%	1.73%	-6.72%	1.84%	11.43%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 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。

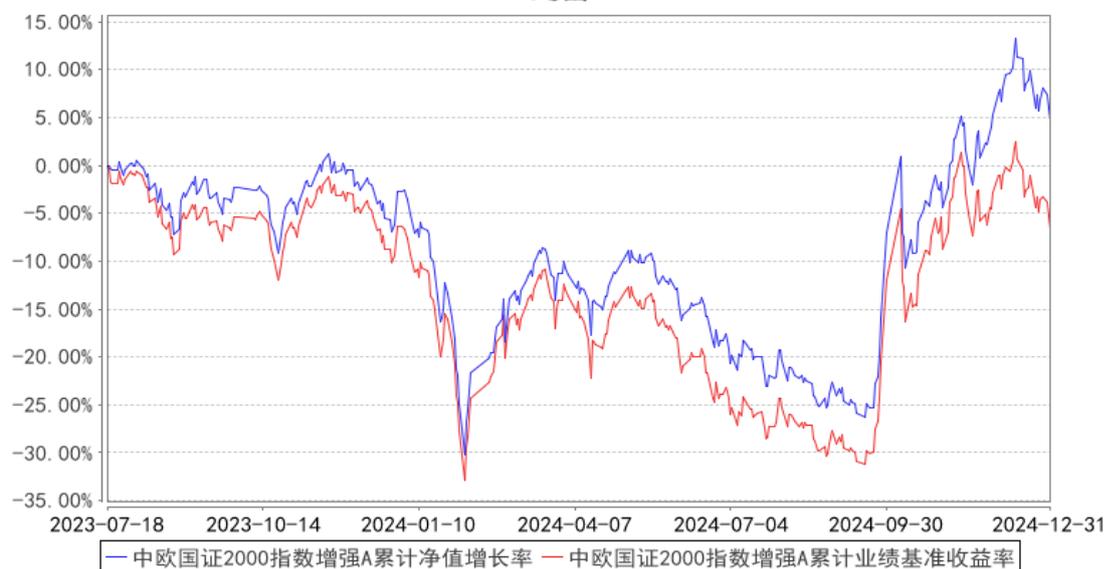
中欧国证 2000 指数增强 C

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
过去三个月	12.57%	2.25%	5.99%	2.40%	6.58%	-0.15%
过去六个月	27.71%	2.10%	22.48%	2.21%	5.23%	-0.11%
过去一年	6.96%	1.99%	-0.39%	2.12%	7.35%	-0.13%
自基金合同生效 起至今	3.79%	1.73%	-6.72%	1.84%	10.51%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 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。

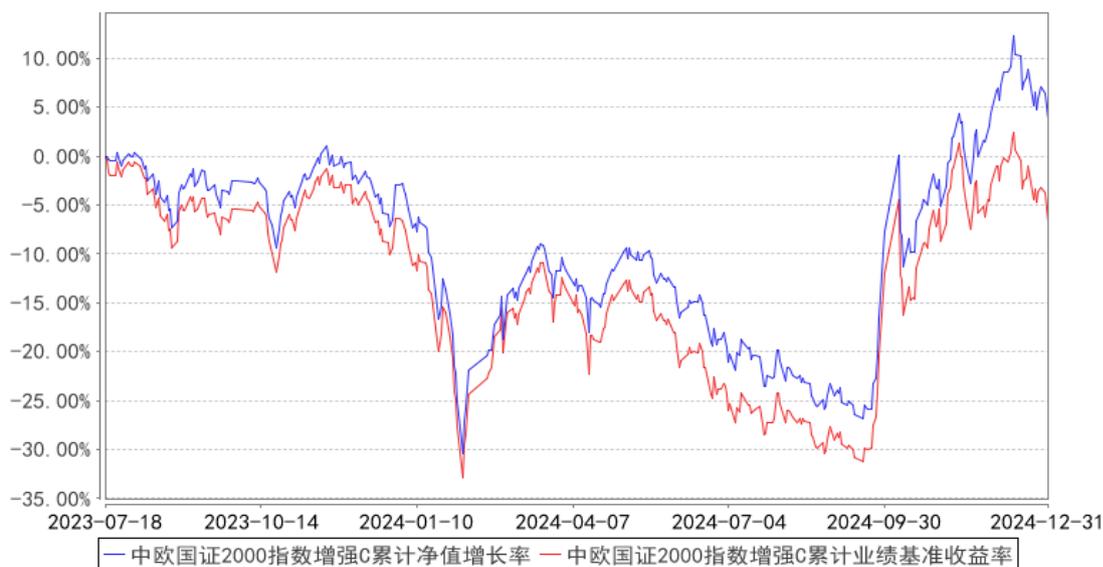
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧国证2000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 2023 年 7 月 18 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经符合基金合同约定。

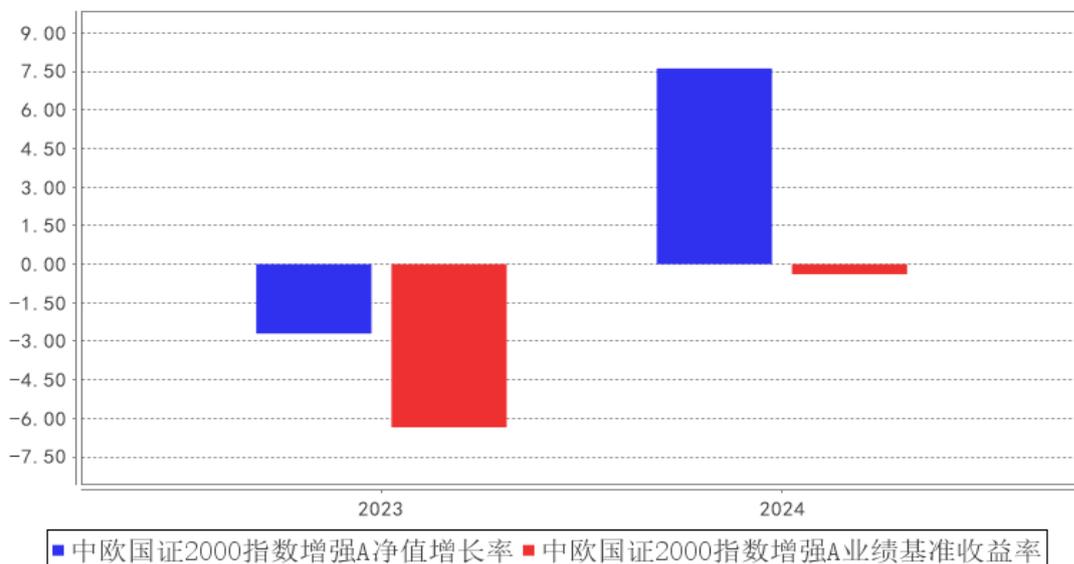
中欧国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 7 月 18 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经符合基金合同约定。

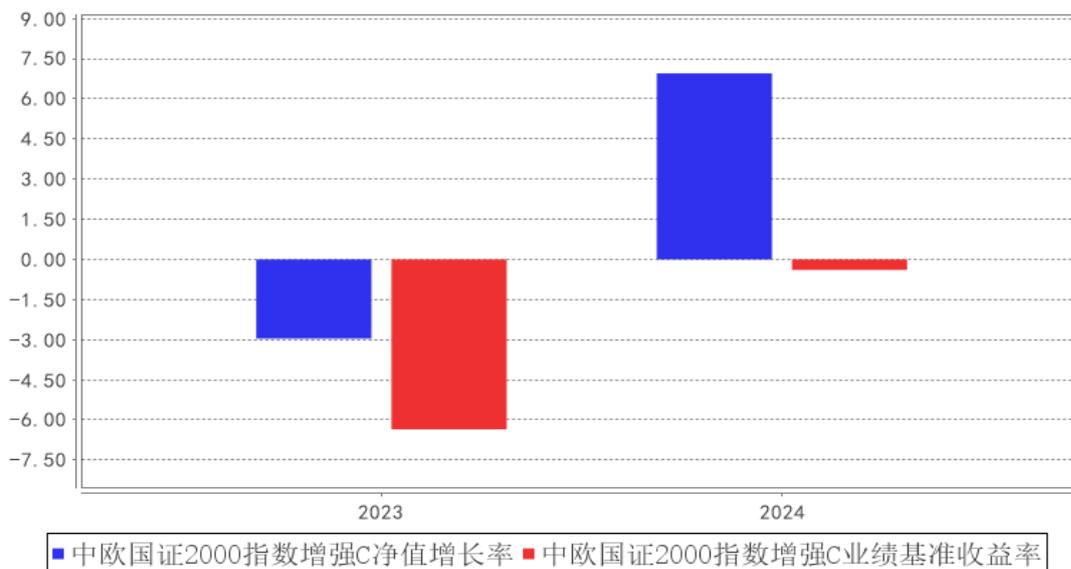
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧国证2000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，2023 年度数据为 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

中欧国证2000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，2023 年度数据为 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中欧国证 2000 指数增强 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024	0.2240	1,798,765.96	66,908.26	1,865,674.22	-
合计	0.2240	1,798,765.96	66,908.26	1,865,674.22	-

中欧国证 2000 指数增强 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024	0.2220	1,586,913.67	37,223.90	1,624,137.57	-
合计	0.2220	1,586,913.67	37,223.90	1,624,137.57	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 194 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	2023-07-18	-	8 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	3 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

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。

-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐

级审核签署备查。

4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

4.3.3 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 31 次，其中 30 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，1 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，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 2024 年，全球政治与经济秩序经历深刻变革，地缘政治冲突频现，贸易保护主义抬头，国际经济环境愈发复杂多变。在此背景下，国内经济形势面临诸多挑战，却也在艰难中维持住了平衡。上半年两会顺利召开，从政府工作报告中可以看到总体政策基调偏积极，化债背景下表观赤字率有所上升，弥补了地方融资的下降。同时，财政政策偏向于鼓励“新质生产力”的发展，而对传统地产行业依然保持定力，政策风格的延续性较强。三季度，中央政策定调转向，促进国内增长预期企稳，九月下旬，三大金融管理部门宣布了一系列经济支持政策，中央政治局会议再次强调努力完成全年经济社会发展目标，并提出要加大财政货币政策逆周期调节力度。在一系列“政策组合拳”的支持下，市场的风险偏好在短期内得到快速修复，这些举措显著提高了市场对中长期增长前景的信心。四季度的政治局会议和中央经济工作会议明确提出实施“更加积极”的财政政策和“适度宽松”的货币政策，并将提振消费列为首要任务，但具体措施有待后续落地。市场交易结构方面，两市成交量明显上升，市场增量资金由 ETF 流入占主导，两融资金余额也快速增长，反映相关投资者情绪较为积极。

风格因子方面，四季度市值和流动性因子负收益明显，显示市场资金对低流动性股票的防御

性配置明显增加，高流动性资产受到资金流出的冲击，同时小盘风格跑赢了大盘风格。市场参与者结构的变化，也给因子有效性产生了影响。10 月策略超额面临了一些回调压力，但在模型学习适应了新的市场特征后，11 月后恢复了正常的表现。本基金是以国证 2000 指数为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。展望后市，我们认为市场当前风险偏好或已企稳，二级市场流动性明显改善，资金面支撑了市场底，指数进一步下行的空间是相对有限的。在较为平稳的市场中，基本面量化模型有望正常发挥价值发现的功能，力争获得合理的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 7.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.39%；基金 C 类份额净值增长率为 6.96%，同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

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 2025 年，我们的观点是看好科技产业突破带动经济周期企稳复苏，股票市场获得良好回报。DeepSeek-R1 的出现显著提振了投资者信心，在经济学可见的路径中，技术对劳动生产率的提升具有显著帮助，也拉动了新的资本开支周期，加速了产业转型的进展。从行业层面来说，我们看好以下三个投资方向：一是科技成长方向，AI 技术突破的影响已开始从训练需求向推理应用领域演进，国内企业有望展开新一轮资本开支周期，从而拉动泛科技行业的实体需求，并催生新的终端消费电子产品。二是先进制造方向，全球制造产业链正在处于一个迁移和重构的趋势中，这拉动了各种设备和材料的投资需求。国内的产业升级也是以高端制造作为抓手，通过进口替代帮助企业降低生产成本。三是内需泛消费行业里，有不少具有长期竞争力和护城河的企业，在本轮周期中保持了合理的杠杆水平、良好的利润率、健康的应收和存货结构。如果经济周期在政策周期的驱动下复苏向上，这样高质量企业或也具有较为稳健的增长机会。我们也会持续跟踪市场风格因子特征，争取控制组合风险因子暴露，力争让量化组合的超额收益更为平稳。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2024 年，监管机构颁布了多部法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公

司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2024 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制定或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2024 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2024 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化洗钱风险和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、风险评估、培训宣传等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门加强自身反洗钱工作履职能力，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，优化了反洗钱系统的各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70028871_B133 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认</p>

	<p>为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	许培菁 张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	8,683,892.22	24,559,398.07
结算备付金		788,530.92	2,698,277.56

存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	137,969,908.75	391,062,657.75
其中：股票投资		137,969,908.75	391,062,657.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		534,328.66	523,112.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,684.58
资产总计		147,976,660.55	418,845,130.74
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		781,442.62	490,042.32
应付管理人报酬		147,339.48	357,547.20
应付托管费		14,733.94	35,754.71
应付销售服务费		41,259.83	95,979.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	57.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	50,000.00	50,000.00
负债合计		1,034,775.87	1,029,381.94
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	143,839,842.48	429,927,709.38
未分配利润	7.4.7.8	3,102,042.20	-12,111,960.58
净资产合计		146,941,884.68	417,815,748.80

负债和净资产总计		147,976,660.55	418,845,130.74
----------	--	----------------	----------------

注：1. 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 143,839,842.48 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0260 元，基金份额总额 73,062,173.99 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0170 元，基金份额总额 70,777,668.49 份。

2. 本基金基金合同于 2023 年 07 月 18 日生效，上年度可比期间自 2023 年 07 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日，下同。

7.2 利润表

会计主体：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,059,385.90	-15,279,891.09
1. 利息收入		89,772.47	176,058.41
其中：存款利息收入	7.4.7.9	82,327.29	112,157.50
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		-	62,191.22
其他利息收入		7,445.18	1,709.69
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,845,658.42	-11,153,142.34
其中：股票投资收益	7.4.7.10	349,081.34	-11,792,006.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	360,857.93	174,373.58
股利收益	7.4.7.14	4,135,719.15	464,490.58
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）	7.4.7.15	1,024,649.81	-4,307,338.87
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.16	99,305.20	4,531.71
减: 二、营业总支出		3,990,467.78	4,250,275.23
1. 管理人报酬		2,756,450.60	2,914,331.29
2. 托管费		275,645.06	291,433.10
3. 销售服务费		768,948.19	930,036.66
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,423.93	674.18
8. 其他费用	7.4.7.18	188,000.00	113,800.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		2,068,918.12	-19,530,166.32
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		2,068,918.12	-19,530,166.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,068,918.12	-19,530,166.32

7.3 净资产变动表

会计主体: 中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	429,927,709.38	-	-12,111,960.58	417,815,748.80
二、本期期初净资产	429,927,709.38	-	-12,111,960.58	417,815,748.80
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-286,087,866.9 0	-	15,214,002.78	-270,873,864.12
(一)、综合收益总额	-	-	2,068,918.12	2,068,918.12
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-286,087,866.9 0	-	16,634,896.45	-269,452,970.45

其中：1. 基金申购款	173,706,130.51	-	-19,190,882.11	154,515,248.40
2. 基金赎回款	-459,793,997.41	-	35,825,778.56	-423,968,218.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-3,489,811.79	-3,489,811.79
四、本期期末净资产	143,839,842.48	-	3,102,042.20	146,941,884.68
项目	上年度可比期间			
	2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	769,717,491.10	-	-	769,717,491.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-339,789,781.72	-	-12,111,960.58	-351,901,742.30
(一)、综合收益总额	-	-	-19,530,166.32	-19,530,166.32
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-339,789,781.72	-	7,418,205.74	-332,371,575.98
其中：1. 基金申购款	35,392,591.70	-	-827,647.85	34,564,943.85
2. 基金赎回款	-375,182,373.42	-	8,245,853.59	-366,936,519.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	429,927,709.38	-	-12,111,960.58	417,815,748.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧国证 2000 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[2023]1139 号文《关于准予中欧国证 2000 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《中欧国证 2000 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 769,410,445.02 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61362990_B18 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 18 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 769,717,491.10 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 307,046.08 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 342,646,381.98 份，包含认购利息折合 159,285.06 份；C 类基金的基金份额总额为 427,071,109.12 份，包含认购利息折合 147,761.02 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。基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧国证 2000 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、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、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）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。

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：国证 2000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生

信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采

用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	261,386.07	355,767.11
等于：本金	261,114.52	355,609.95
加：应计利息	271.55	157.16
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	8,422,506.15	24,203,630.96
等于：本金	8,421,831.56	24,201,432.42
加：应计利息	674.59	2,198.54
减：坏账准备	-	-

合计	8,683,892.22	24,559,398.07
----	--------------	---------------

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	141,252,597.81	-	137,969,908.75	-3,282,689.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	141,252,597.81	-	137,969,908.75	-3,282,689.06
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	395,369,996.62	-	391,062,657.75	-4,307,338.87
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	395,369,996.62	-	391,062,657.75	-4,307,338.87

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	1,684.58
待摊费用	-	-
合计	-	1,684.58

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	50,000.00	50,000.00
合计	50,000.00	50,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	236,928,648.96	236,928,648.96
本期申购	21,604,623.27	21,604,623.27
本期赎回（以“-”号填列）	-185,471,098.24	-185,471,098.24
本期末	73,062,173.99	73,062,173.99

中欧国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	192,999,060.42	192,999,060.42
本期申购	152,101,507.24	152,101,507.24
本期赎回（以“-”号填列）	-274,322,899.17	-274,322,899.17
本期末	70,777,668.49	70,777,668.49

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧国证 2000 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	-4,404,560.18	-1,988,030.67	-6,392,590.85
本期期初	-4,404,560.18	-1,988,030.67	-6,392,590.85
本期利润	1,299,823.77	149,435.77	1,449,259.54
本期基金份额交易产生的变动数	12,988,968.65	-4,283,923.45	8,705,045.20
其中：基金申购款	-2,084,731.09	305,703.23	-1,779,027.86
基金赎回款	15,073,699.74	-4,589,626.68	10,484,073.06
本期已分配利润	-1,865,674.22	-	-1,865,674.22
本期末	8,018,558.02	-6,122,518.35	1,896,039.67

中欧国证 2000 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	-4,096,113.09	-1,623,256.64	-5,719,369.73
本期期初	-4,096,113.09	-1,623,256.64	-5,719,369.73
本期利润	-255,555.46	875,214.04	619,658.58
本期基金份额交易产生的变动数	13,062,980.38	-5,133,129.13	7,929,851.25
其中：基金申购款	-18,169,084.26	757,230.01	-17,411,854.25
基金赎回款	31,232,064.64	-5,890,359.14	25,341,705.50
本期已分配利润	-1,624,137.57	-	-1,624,137.57
本期末	7,087,174.26	-5,881,171.73	1,206,002.53

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,512.94	26,972.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	54,062.30	66,847.79
结算备付金利息收入	17,752.05	18,337.46
其他	-	-
合计	82,327.29	112,157.50

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,175,236,453.66	2,079,159,735.74

减：卖出股票成本总额	2,172,005,259.64	2,086,977,575.57
减：交易费用	2,882,112.68	3,974,166.67
买卖股票差价收入	349,081.34	-11,792,006.50

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	360,857.93	174,373.58

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,135,719.15	464,490.58
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,135,719.15	464,490.58

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日(基金合 同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,024,649.81	-4,307,338.87
股票投资	1,024,649.81	-4,307,338.87
债券投资	-	-
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	1,024,649.81	-4,307,338.87

7.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日(基金合 同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	99,268.15	4,461.16
基金转换费收入	37.05	70.55
合计	99,305.20	4,531.71

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日(基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	3,000.00
开户费	-	800.00
合计	188,000.00	113,800.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人、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
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东
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
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司
中欧私募基金管理(上海)有限公司（“中欧私募”）	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2024 年 4 月 9 日起，我司正式受让中欧私募基金管理(上海)有限公司全部股权，新增关联方为中欧私募基金管理(上海)有限公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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 （%）
中信建投	1,948,026,006.33	47.62	2,416,212,907.73	53.01

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年7月18日（基金合同生效日） 至2023年12月31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（%）
中信建投	-	-	161,612,000.00	35.04

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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（%）
中信建投	719,005.15	46.92	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31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（%）
中信建投	1,259,562.99	52.55	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,756,450.60	2,914,331.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,056,509.19	1,131,552.78

应支付基金管理人的净管理费	1,699,941.41	1,782,778.51
---------------	--------------	--------------

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，自动在次月第 2 个工作日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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	275,645.06	291,433.10

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 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，自动在次月第 2 个工作日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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C	合计
国都证券	0.00	327.08	327.08
中欧财富	0.00	479.75	479.75
中信建投	0.00	491,982.77	491,982.77
合计	0.00	492,789.60	492,789.60

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00
中欧财富	0.00	34.35	34.35
中信建投	0.00	630,783.89	630,783.89
合计	0.00	630,818.24	630,818.24

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，自动在次月第 2 个工作日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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

7.4.10.5.2 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

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	4,244,010.09	32,661.57	12,935,848.54	61,879.33

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

中欧国证 2000 指数增强 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 12 月 17 日	-	2024 年 12 月 17 日	0.2240	1,798,765.96	66,908.26	1,865,674.22	-
合计	-	-	-	0.2240	1,798,765.96	66,908.26	1,865,674.22	-
中欧国证 2000 指数增强 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 12 月 17 日	-	2024 年 12 月 17 日	0.2220	1,586,913.67	37,223.90	1,624,137.57	-
合计	-	-	-	0.2220	1,586,913.67	37,223.90	1,624,137.57	-

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	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）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注

	称						股)			
001279	强邦新材	2024年9月27日	6个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股流通受限	21.21	36.49	329	6,978.09	12,005.21	-
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股流通受限	44.50	65.38	166	7,387.00	10,853.08	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股流通受限	27.76	39.79	190	5,274.40	7,560.10	-

301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股流通受限	22.36	44.92	261	5,835.96	11,724.12	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股流通受限	72.99	101.96	102	7,444.98	10,399.92	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	1,339	16,469.70	16,469.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	12.30	149	1,832.70	1,832.70	-
603194	中力股份	2024年12月17日	6个月	新股流通受限	20.32	28.13	142	2,885.44	3,994.46	-
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603395	红四方	2024年11月19日	6个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688605	先锋精科	2024年12月4日	6个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024年9月19日	6个月	新股流通受限	55.18	165.78	157	8,663.26	26,027.46	-

688710	益 诺 思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙 图 光 罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉 普 拉 斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金 天 钛 业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，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 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之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 12 月 31 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	8,683,892.22	-	-	-	8,683,892.22
结算备付金	788,530.92	-	-	-	788,530.92
交易性金融资产	-	-	-	-137,969,908.75	137,969,908.75
应收申购款	-	-	-	534,328.66	534,328.66
资产总计	9,472,423.14	-	-	-138,504,237.41	147,976,660.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	781,442.62	781,442.62
应付管理人报酬	-	-	-	147,339.48	147,339.48
应付托管费	-	-	-	14,733.94	14,733.94
应付销售服务费	-	-	-	41,259.83	41,259.83
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	1,034,775.87	1,034,775.87
利率敏感度缺口	9,472,423.14	-	-	-137,469,461.54	146,941,884.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	24,559,398.07	-	-	-	24,559,398.07
结算备付金	2,698,277.56	-	-	-	2,698,277.56
交易性金融资产	-	-	-	-391,062,657.75	391,062,657.75
应收申购款	-	-	-	523,112.78	523,112.78
其他资产	-	-	-	1,684.58	1,684.58
资产总计	27,257,675.63	-	-	-391,587,455.11	418,845,130.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	490,042.32	490,042.32
应付管理人报酬	-	-	-	357,547.20	357,547.20
应付托管费	-	-	-	35,754.71	35,754.71
应付销售服务费	-	-	-	95,979.80	95,979.80
应交税费	-	-	-	57.91	57.91
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	1,029,381.94	1,029,381.94
利率敏感度缺口	27,257,675.63	-	-	-390,558,073.17	417,815,748.80

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2023 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	137,969,908.75	93.89	391,062,657.75	93.60
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	137,969,908.75	93.89	391,062,657.75	93.60

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	6,898,550.99	19,939,796.89
业绩比较基准下降	-6,898,550.99	-19,939,796.89	

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	137,574,952.58	390,646,434.56
第二层次	18,302.40	-
第三层次	376,653.77	416,223.19
合计	137,969,908.75	391,062,657.75

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	416,223.19	416,223.19

当期购买	0.00	154,934.34	154,934.34
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	416,223.19	416,223.19
当期利得或损失总额	0.00	221,719.43	221,719.43
其中：计入损益的利得或损失	0.00	221,719.43	221,719.43
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	376,653.77	376,653.77
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	221,719.43	221,719.43
项目	上年度可比期间 2023年7月18日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	0.00	0.00
当期购买	0.00	317,287.88	317,287.88
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	0.00	0.00
当期利得或损失总额	0.00	98,935.31	98,935.31
其中：计入损益的利得或损失	0.00	98,935.31	98,935.31
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	416,223.19	416,223.19
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	98,935.31	98,935.31

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	376,653.77	平均价格亚式期权模型	波动率	0.3521-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	416,223.19	平均价格亚式期权模型	波动率	0.3186-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	137,969,908.75	93.24
	其中：股票	137,969,908.75	93.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,472,423.14	6.40

8	其他各项资产	534,328.66	0.36
9	合计	147,976,660.55	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,384,789.00	0.94
B	采矿业	2,681,440.00	1.82
C	制造业	94,146,793.78	64.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,000,158.00	2.72
E	建筑业	1,630,356.00	1.11
F	批发和零售业	4,422,002.00	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,074,398.00	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,187,826.80	8.29
J	金融业	680,824.00	0.46
K	房地产业	1,490,127.00	1.01
L	租赁和商务服务业	1,694,163.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	2,059,296.00	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	2,785,173.00	1.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	584,984.00	0.40
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,690,916.00	1.83
S	综合	39,795.00	0.03
	合计	134,553,041.58	91.57

8.2.2 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	-	-
C	制造业	3,249,293.80	2.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
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	41,793.81	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,148.56	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	114,631.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,416,867.17	2.33

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	002546	新联电子	280,600	1,214,998.00	0.83
2	002578	闽发铝业	338,900	1,013,311.00	0.69
3	300485	赛升药业	135,900	952,659.00	0.65
4	301025	读客文化	93,200	888,196.00	0.60
5	002980	华盛昌	33,500	859,275.00	0.58
6	002479	富春环保	171,100	811,014.00	0.55
7	002724	海洋王	150,500	800,660.00	0.54
8	002666	德联集团	180,000	784,800.00	0.53
9	688663	新风光	36,000	781,560.00	0.53
10	002788	鹭燕医药	94,000	771,740.00	0.53
11	002627	三峡旅游	152,000	763,040.00	0.52
12	603727	博迈科	65,500	751,940.00	0.51
13	002923	润都股份	78,420	748,126.80	0.51
14	603538	美诺华	58,276	740,687.96	0.50

15	603158	腾龙股份	91,100	736,088.00	0.50
16	601368	绿城水务	152,600	726,376.00	0.49
17	300946	恒而达	25,700	698,012.00	0.48
18	002772	众兴菌业	91,800	676,566.00	0.46
19	000931	中关村	136,900	651,644.00	0.44
20	603387	基蛋生物	77,600	640,200.00	0.44
21	001201	东瑞股份	39,900	631,218.00	0.43
22	000655	金岭矿业	101,800	626,070.00	0.43
23	002783	凯龙股份	76,800	625,920.00	0.43
24	603558	健盛集团	57,900	623,004.00	0.42
25	603065	宿迁联盛	85,500	621,585.00	0.42
26	603987	康德莱	85,700	615,326.00	0.42
27	603966	法兰泰克	79,700	615,284.00	0.42
28	603315	福鞍股份	57,300	614,256.00	0.42
29	002300	太阳电缆	114,600	611,964.00	0.42
30	000607	华媒控股	162,000	601,020.00	0.41
31	605098	行动教育	16,600	584,984.00	0.40
32	300453	三鑫医疗	76,900	573,674.00	0.39
33	000920	沃顿科技	62,300	555,716.00	0.38
34	300940	南极光	41,000	553,500.00	0.38
35	603601	再升科技	163,700	550,032.00	0.37
36	600218	全柴动力	68,000	537,200.00	0.37
37	300636	同和药业	67,100	534,787.00	0.36
38	000707	双环科技	71,900	530,622.00	0.36
39	002454	松芝股份	79,700	530,005.00	0.36
40	688799	华纳药厂	12,600	527,688.00	0.36
41	603266	天龙股份	32,700	526,470.00	0.36
42	603639	海利尔	42,400	525,760.00	0.36
43	301096	百诚医药	13,800	523,572.00	0.36
44	603012	创力集团	98,100	520,911.00	0.35
45	002412	汉森制药	86,500	519,865.00	0.35
46	001378	德冠新材	22,600	517,992.00	0.35
47	002132	恒星科技	188,100	515,394.00	0.35
48	600512	腾达建设	216,900	514,053.00	0.35
49	000407	胜利股份	147,200	503,424.00	0.34
50	003020	立方制药	27,900	503,316.00	0.34
51	002376	新北洋	76,500	498,780.00	0.34
52	603590	康辰药业	21,100	496,272.00	0.34
53	002688	金河生物	110,650	494,605.50	0.34
54	603136	天目湖	43,600	492,680.00	0.34
55	603239	浙江仙通	36,600	492,270.00	0.34
56	600594	益佰制药	136,900	487,364.00	0.33
57	300452	山河药辅	40,200	486,822.00	0.33

58	603208	江山欧派	26,200	482,080.00	0.33
59	002462	嘉事堂	37,300	481,916.00	0.33
60	002090	金智科技	54,000	479,520.00	0.33
61	002940	昂利康	36,100	475,798.00	0.32
62	002522	浙江众成	121,500	475,065.00	0.32
63	300471	厚普股份	49,600	469,216.00	0.32
64	002330	得利斯	106,800	466,716.00	0.32
65	000789	万年青	92,500	463,425.00	0.32
66	300358	楚天科技	67,300	461,678.00	0.31
67	002790	瑞尔特	63,200	461,360.00	0.31
68	600818	中路股份	39,900	461,244.00	0.31
69	603309	维力医疗	38,500	461,230.00	0.31
70	002297	博云新材	66,900	460,272.00	0.31
71	603878	武进不锈	80,300	459,316.00	0.31
72	688399	硕世生物	6,900	453,468.00	0.31
73	000993	闽东电力	54,300	453,405.00	0.31
74	002448	中原内配	72,400	453,224.00	0.31
75	000919	金陵药业	67,600	444,808.00	0.30
76	603689	皖天然气	49,500	444,510.00	0.30
77	002560	通达股份	64,900	442,618.00	0.30
78	600710	苏美达	46,700	434,310.00	0.30
79	603191	望变电气	34,000	428,060.00	0.29
80	603661	恒林股份	13,900	425,896.00	0.29
81	603687	大胜达	58,300	425,007.00	0.29
82	603633	徕木股份	52,000	424,840.00	0.29
83	688510	航亚科技	24,200	421,564.00	0.29
84	600798	宁波海运	137,600	416,928.00	0.28
85	300226	上海钢联	18,200	416,234.00	0.28
86	003028	振邦智能	11,600	415,860.00	0.28
87	002441	众业达	53,100	413,118.00	0.28
88	000926	福星股份	160,700	409,785.00	0.28
89	300627	华测导航	9,800	409,640.00	0.28
90	002969	嘉美包装	131,000	407,410.00	0.28
91	603896	寿仙谷	19,200	407,232.00	0.28
92	000897	津滨发展	171,800	407,166.00	0.28
93	300732	设研院	60,900	406,812.00	0.28
94	603167	渤海轮渡	46,000	406,640.00	0.28
95	603058	永吉股份	45,700	403,074.00	0.27
96	603701	德宏股份	28,500	399,000.00	0.27
97	300575	中旗股份	65,500	397,585.00	0.27
98	600746	江苏索普	56,700	397,467.00	0.27
99	002554	惠博普	158,300	397,333.00	0.27
100	603111	康尼机电	65,800	396,774.00	0.27

101	688519	南亚新材	18,600	395,436.00	0.27
102	688488	艾迪药业	50,100	393,786.00	0.27
103	603165	荣晟环保	32,140	393,393.60	0.27
104	688121	卓然股份	36,500	393,105.00	0.27
105	002023	海特高新	38,700	392,805.00	0.27
106	603970	中农立华	27,600	391,920.00	0.27
107	300241	瑞丰光电	70,600	387,594.00	0.26
108	300402	宝色股份	26,100	384,975.00	0.26
109	300821	东岳硅材	49,400	383,344.00	0.26
110	300158	振东制药	88,200	381,024.00	0.26
111	603881	数据港	16,800	380,520.00	0.26
112	000159	国际实业	62,900	377,400.00	0.26
113	002562	兄弟科技	87,200	370,600.00	0.25
114	301369	联动科技	7,000	366,660.00	0.25
115	600320	振华重工	93,101	364,955.92	0.25
116	002977	火箭科技	13,400	364,614.00	0.25
117	603076	乐惠国际	15,600	359,424.00	0.24
118	002768	国恩股份	15,300	352,971.00	0.24
119	600433	冠豪高新	111,200	352,504.00	0.24
120	002567	唐人神	67,300	343,230.00	0.23
121	301389	隆扬电子	20,500	342,760.00	0.23
122	301339	通行宝	16,800	341,712.00	0.23
123	600662	外服控股	67,000	339,690.00	0.23
124	300768	迪普科技	19,300	337,750.00	0.23
125	603609	禾丰股份	39,100	337,042.00	0.23
126	000404	长虹华意	45,400	335,960.00	0.23
127	600496	精工钢构	111,200	335,824.00	0.23
128	000541	佛山照明	53,700	332,940.00	0.23
129	603258	电魂网络	16,700	332,163.00	0.23
130	600758	辽宁能源	95,200	327,488.00	0.22
131	002609	捷顺科技	39,600	327,096.00	0.22
132	300259	新天科技	92,420	323,470.00	0.22
133	601827	三峰环境	37,500	321,750.00	0.22
134	688176	亚虹医药	47,000	319,130.00	0.22
135	002375	亚厦股份	82,400	318,064.00	0.22
136	300048	合康新能	61,900	311,976.00	0.21
137	688233	神工股份	13,200	309,540.00	0.21
138	600633	浙数文化	29,400	307,524.00	0.21
139	300079	数码视讯	56,700	306,747.00	0.21
140	603328	依顿电子	31,000	305,660.00	0.21
141	688508	芯朋微	7,100	305,087.00	0.21
142	002218	拓日新能	76,800	304,896.00	0.21
143	002100	天康生物	45,500	298,025.00	0.20

144	300770	新媒股份	7,300	294,993.00	0.20
145	300745	欣锐科技	18,500	294,520.00	0.20
146	300439	美康生物	28,100	293,645.00	0.20
147	301120	新特电气	29,300	290,363.00	0.20
148	600850	电科数字	12,000	286,800.00	0.20
149	301180	万祥科技	18,300	283,101.00	0.19
150	600691	阳煤化工	127,400	282,828.00	0.19
151	300545	联得装备	9,000	281,970.00	0.19
152	688088	虹软科技	7,200	277,632.00	0.19
153	688269	凯立新材	11,000	274,780.00	0.19
154	605599	菜百股份	24,000	272,400.00	0.19
155	603132	金徽股份	24,200	271,766.00	0.18
156	002322	理工能科	21,500	270,685.00	0.18
157	300629	新劲刚	12,500	270,000.00	0.18
158	600169	太原重工	108,100	269,169.00	0.18
159	300415	伊之密	13,400	268,804.00	0.18
160	002565	顺灏股份	88,400	268,736.00	0.18
161	600783	鲁信创投	21,200	268,604.00	0.18
162	600531	豫光金铅	41,800	268,356.00	0.18
163	301217	铜冠铜箔	24,200	268,136.00	0.18
164	300620	光库科技	5,500	267,300.00	0.18
165	300434	金石亚药	32,100	264,825.00	0.18
166	300587	天铁股份	60,100	263,839.00	0.18
167	002437	誉衡药业	105,700	263,193.00	0.18
168	001208	华菱线缆	28,800	261,504.00	0.18
169	600961	株冶集团	33,100	260,497.00	0.18
170	002907	华森制药	20,000	260,000.00	0.18
171	300099	尤洛卡	43,300	259,800.00	0.18
172	000672	上峰水泥	33,900	259,335.00	0.18
173	301332	德尔玛	25,800	258,516.00	0.18
174	002263	大东南	103,900	257,672.00	0.18
175	600330	天通股份	36,200	257,020.00	0.17
176	300352	北信源	48,400	255,552.00	0.17
177	300523	辰安科技	12,900	255,291.00	0.17
178	601369	陕鼓动力	29,200	254,040.00	0.17
179	000030	富奥股份	49,300	252,909.00	0.17
180	300393	中来股份	40,400	252,500.00	0.17
181	603888	新华网	11,300	252,442.00	0.17
182	688588	凌志软件	18,126	250,138.80	0.17
183	002967	广电计量	15,200	249,280.00	0.17
184	603496	恒为科技	9,100	247,338.00	0.17
185	300696	爱乐达	15,900	246,927.00	0.17
186	300083	创世纪	37,800	246,078.00	0.17

187	301311	昆船智能	13,600	246,024.00	0.17
188	300881	盛德鑫泰	8,000	245,920.00	0.17
189	300360	炬华科技	14,600	244,842.00	0.17
190	600305	恒顺醋业	30,600	244,188.00	0.17
191	002104	恒宝股份	36,100	244,036.00	0.17
192	002226	江南化工	44,900	243,358.00	0.17
193	600162	香江控股	125,800	241,536.00	0.16
194	300035	中科电气	16,100	240,695.00	0.16
195	300702	天宇股份	14,400	239,904.00	0.16
196	300455	航天智装	18,500	239,760.00	0.16
197	000523	红棉股份	78,400	239,120.00	0.16
198	601900	南方传媒	15,800	238,738.00	0.16
199	002987	京北方	16,600	236,218.00	0.16
200	300951	博硕科技	7,900	235,973.00	0.16
201	600419	天润乳业	25,200	234,612.00	0.16
202	300266	兴源环境	81,800	233,130.00	0.16
203	300752	隆利科技	13,700	232,900.00	0.16
204	001338	永顺泰	21,400	232,832.00	0.16
205	300674	宇信科技	11,900	232,288.00	0.16
206	000551	创元科技	19,300	230,828.00	0.16
207	688007	光峰科技	15,600	230,724.00	0.16
208	600869	远东股份	48,200	228,950.00	0.16
209	300303	聚飞光电	33,500	228,470.00	0.16
210	000755	山西高速	45,000	227,700.00	0.15
211	002088	鲁阳节能	17,800	227,662.00	0.15
212	300194	福安药业	51,000	227,460.00	0.15
213	300181	佐力药业	14,800	227,328.00	0.15
214	688128	中国电研	10,800	226,908.00	0.15
215	688202	美迪西	7,500	226,275.00	0.15
216	002284	亚太股份	29,200	226,008.00	0.15
217	601801	皖新传媒	30,500	223,870.00	0.15
218	300659	中孚信息	13,800	223,422.00	0.15
219	002946	新乳业	15,300	222,003.00	0.15
220	002063	远光软件	38,400	221,184.00	0.15
221	300145	中金环境	59,400	220,374.00	0.15
222	002534	西子洁能	19,800	219,978.00	0.15
223	300053	航宇微	16,800	219,912.00	0.15
224	002491	通鼎互联	42,700	219,478.00	0.15
225	300758	七彩化学	18,300	219,234.00	0.15
226	603256	宏和科技	26,100	217,935.00	0.15
227	600420	国药现代	18,200	217,308.00	0.15
228	603699	纽威股份	9,800	217,266.00	0.15
229	300447	全信股份	15,300	216,801.00	0.15

230	002782	可立克	17,100	216,315.00	0.15
231	301260	格力博	16,300	215,975.00	0.15
232	300188	国投智能	15,600	215,124.00	0.15
233	300797	钢研纳克	18,200	214,942.00	0.15
234	603612	索通发展	15,900	214,809.00	0.15
235	301327	华宝新能	2,800	214,788.00	0.15
236	603169	兰石重装	39,300	214,185.00	0.15
237	603738	泰晶科技	14,200	212,716.00	0.14
238	688023	安恒信息	5,200	212,160.00	0.14
239	002544	普天科技	9,900	212,157.00	0.14
240	301377	鼎泰高科	10,000	211,500.00	0.14
241	300203	聚光科技	13,800	210,174.00	0.14
242	002577	雷柏科技	11,000	208,230.00	0.14
243	300369	绿盟科技	28,800	207,072.00	0.14
244	600351	亚宝药业	34,000	207,060.00	0.14
245	600488	津药药业	48,800	206,912.00	0.14
246	002204	大连重工	41,500	206,670.00	0.14
247	603098	森特股份	21,400	205,440.00	0.14
248	600551	时代出版	23,500	202,335.00	0.14
248	603515	欧普照明	12,300	202,335.00	0.14
249	002011	盾安环境	18,700	202,147.00	0.14
250	300236	上海新阳	5,400	201,798.00	0.14
251	300319	麦捷科技	16,100	200,928.00	0.14
252	002043	兔宝宝	16,900	200,772.00	0.14
253	300685	艾德生物	8,800	200,640.00	0.14
254	300772	运达股份	15,100	199,924.00	0.14
255	300976	达瑞电子	2,900	198,650.00	0.14
256	301039	中集车辆	21,900	198,195.00	0.13
257	300895	铜牛信息	5,600	197,736.00	0.13
258	688083	中望软件	2,300	196,811.00	0.13
259	300578	会畅通讯	10,200	196,350.00	0.13
260	603075	热威股份	10,500	195,615.00	0.13
261	300193	佳士科技	22,000	195,580.00	0.13
262	002913	奥士康	8,000	192,880.00	0.13
263	603171	税友股份	6,300	192,150.00	0.13
264	000680	山推股份	19,800	192,060.00	0.13
265	002970	锐明技术	4,000	190,520.00	0.13
266	603162	海通发展	20,700	190,440.00	0.13
267	603989	艾华集团	12,600	190,008.00	0.13
268	002912	中新赛克	7,400	189,366.00	0.13
269	002206	海利得	43,900	188,331.00	0.13
270	002440	闰土股份	27,900	187,209.00	0.13
271	300994	久祺股份	16,500	186,120.00	0.13

272	688680	海优新材	5,500	185,790.00	0.13
273	600073	光明肉业	26,600	184,604.00	0.13
274	002174	游族网络	19,700	184,195.00	0.13
275	605007	五洲特纸	14,400	184,176.00	0.13
276	605577	龙版传媒	12,600	183,078.00	0.12
277	002242	九阳股份	17,600	182,336.00	0.12
278	300291	百纳千成	36,200	182,086.00	0.12
279	600874	创业环保	30,500	182,085.00	0.12
280	688209	英集芯	10,300	182,001.00	0.12
281	688371	菲沃泰	11,700	181,584.00	0.12
282	002017	东信和平	17,500	181,475.00	0.12
283	300996	普联软件	10,000	181,200.00	0.12
283	603355	莱克电气	8,000	181,200.00	0.12
284	002361	神剑股份	33,100	180,395.00	0.12
285	688579	山大地纬	19,500	179,205.00	0.12
286	600229	城市传媒	25,600	178,432.00	0.12
287	300123	亚光科技	30,700	178,060.00	0.12
288	603118	共进股份	20,000	178,000.00	0.12
289	603093	南华期货	14,800	176,120.00	0.12
290	605305	中际联合	6,200	175,646.00	0.12
291	603113	金能科技	31,000	174,530.00	0.12
292	000517	荣安地产	77,600	173,048.00	0.12
293	002004	华邦健康	38,200	172,664.00	0.12
294	600033	福建高速	44,500	172,660.00	0.12
295	000019	深粮控股	26,200	172,134.00	0.12
296	002852	道道全	20,800	171,808.00	0.12
297	688048	长光华芯	4,400	171,556.00	0.12
298	002801	微光股份	7,000	171,220.00	0.12
299	300304	云意电气	21,400	171,200.00	0.12
300	300366	创意信息	18,400	171,120.00	0.12
301	000758	中色股份	34,600	170,924.00	0.12
302	600017	日照港	53,400	170,880.00	0.12
303	600724	宁波富达	26,900	170,815.00	0.12
304	600268	国电南自	25,400	170,688.00	0.12
305	002250	联化科技	30,900	170,259.00	0.12
306	300909	汇创达	7,100	169,335.00	0.12
307	301262	海看股份	6,800	169,116.00	0.12
308	300065	海兰信	20,600	168,920.00	0.11
309	688206	概伦电子	8,900	168,299.00	0.11
310	300737	科顺股份	33,000	167,310.00	0.11
311	688392	骄成超声	4,100	167,280.00	0.11
312	605183	确成股份	9,900	166,815.00	0.11
313	600468	百利电气	35,200	165,440.00	0.11

314	605365	立达信	10,500	164,850.00	0.11
315	300036	超图软件	9,700	164,706.00	0.11
316	002421	达实智能	48,000	164,640.00	0.11
317	600572	康恩贝	35,300	164,498.00	0.11
318	600058	五矿发展	23,000	163,760.00	0.11
319	600158	中体产业	19,800	163,746.00	0.11
320	601968	宝钢包装	33,000	163,350.00	0.11
321	600269	赣粤高速	29,100	163,251.00	0.11
322	301216	万凯新材	16,000	163,200.00	0.11
323	688550	瑞联新材	5,200	162,708.00	0.11
324	688315	诺禾致源	13,000	162,500.00	0.11
325	300985	致远新能	8,800	162,008.00	0.11
326	688699	明微电子	4,500	161,730.00	0.11
327	603067	振华股份	12,800	161,664.00	0.11
328	000791	甘肃能源	26,600	160,398.00	0.11
329	603105	芯能科技	17,700	159,477.00	0.11
330	300160	秀强股份	29,100	158,304.00	0.11
331	002777	久远银海	9,100	156,702.00	0.11
332	605507	国邦医药	7,500	156,225.00	0.11
333	300513	恒实科技	17,100	156,123.00	0.11
334	301559	中集环科	10,100	155,035.00	0.11
335	002845	同兴达	10,200	154,632.00	0.11
336	002655	共达电声	12,100	154,033.00	0.10
337	603936	博敏电子	18,200	153,244.00	0.10
338	300463	迈克生物	11,600	153,120.00	0.10
339	688313	仕佳光子	9,300	152,427.00	0.10
340	601089	福元医药	9,500	152,000.00	0.10
341	601200	上海环境	18,600	151,962.00	0.10
342	301439	泓淋电力	11,000	151,250.00	0.10
343	300673	佩蒂股份	8,500	150,705.00	0.10
344	000049	德赛电池	6,400	150,464.00	0.10
345	603693	江苏新能	15,200	149,720.00	0.10
346	002212	天融信	23,000	148,350.00	0.10
347	002445	中南文化	60,500	148,225.00	0.10
348	301511	德福科技	11,800	148,208.00	0.10
349	002606	大连电瓷	16,000	147,520.00	0.10
350	601811	新华文轩	9,300	147,405.00	0.10
351	603995	甬金股份	8,000	146,320.00	0.10
352	688112	鼎阳科技	5,200	145,756.00	0.10
353	688158	优刻得	10,400	145,392.00	0.10
354	301099	雅创电子	3,500	145,075.00	0.10
355	603386	骏亚科技	13,000	144,560.00	0.10
356	603313	梦百合	21,400	144,450.00	0.10

357	300091	金通灵	70,400	144,320.00	0.10
358	301046	能辉科技	7,100	142,426.00	0.10
359	000524	岭南控股	14,700	142,296.00	0.10
360	300320	海达股份	14,800	142,080.00	0.10
361	603636	南威软件	13,500	141,750.00	0.10
362	301370	国科恒泰	13,100	141,480.00	0.10
363	688553	汇宇制药	9,300	141,360.00	0.10
364	002401	中远海科	8,900	141,332.00	0.10
365	002093	国脉科技	18,100	141,180.00	0.10
366	300978	东箭科技	12,900	140,481.00	0.10
367	301500	飞南资源	7,800	140,400.00	0.10
367	600728	佳都科技	30,000	140,400.00	0.10
368	600757	长江传媒	14,600	139,722.00	0.10
369	300232	洲明科技	20,300	139,461.00	0.09
370	605286	同力日升	4,600	138,736.00	0.09
371	600459	贵研铂业	10,100	138,673.00	0.09
372	002590	万安科技	11,300	138,086.00	0.09
373	002201	正威新材	26,500	137,535.00	0.09
374	601311	骆驼股份	16,500	136,785.00	0.09
375	002438	江苏神通	11,200	136,640.00	0.09
376	002961	瑞达期货	9,500	136,515.00	0.09
377	300451	创业慧康	30,300	135,744.00	0.09
378	688661	和林微纳	4,100	135,341.00	0.09
379	603890	春秋电子	11,500	135,125.00	0.09
380	600526	菲达环保	29,900	134,251.00	0.09
381	601279	英利汽车	34,900	133,667.00	0.09
382	603916	苏博特	17,900	133,534.00	0.09
383	600248	陕建股份	29,800	133,504.00	0.09
384	688025	杰普特	2,800	133,000.00	0.09
385	601886	江河集团	24,500	132,300.00	0.09
386	603408	建霖家居	10,500	131,565.00	0.09
387	688507	索辰科技	2,400	131,280.00	0.09
388	688018	乐鑫科技	600	130,800.00	0.09
389	300507	苏奥传感	19,500	130,650.00	0.09
390	301149	隆华新材	13,100	129,559.00	0.09
391	600300	维维股份	40,000	128,800.00	0.09
392	002957	科瑞技术	8,100	127,089.00	0.09
393	603969	银龙股份	18,800	127,088.00	0.09
394	000652	泰达股份	30,400	125,856.00	0.09
395	603566	普莱柯	9,800	125,048.00	0.09
396	600138	中青旅	12,300	124,722.00	0.08
397	301172	君逸数码	4,600	123,464.00	0.08
398	002615	哈尔斯	15,500	123,225.00	0.08

399	002443	金洲管道	20,700	121,716.00	0.08
400	600523	贵航股份	10,200	121,584.00	0.08
401	603209	兴通股份	7,600	121,448.00	0.08
402	600251	冠农股份	16,500	120,285.00	0.08
403	688027	国盾量子	400	119,344.00	0.08
404	002160	常铝股份	32,000	119,040.00	0.08
405	601616	广电电气	26,900	118,091.00	0.08
406	300404	博济医药	13,500	117,855.00	0.08
407	002106	莱宝高科	10,800	117,828.00	0.08
408	300857	协创数据	1,100	117,579.00	0.08
409	605222	起帆电缆	7,600	117,040.00	0.08
410	002851	麦格米特	1,900	116,774.00	0.08
411	000862	银星能源	23,500	116,090.00	0.08
412	300460	惠伦晶体	9,500	115,330.00	0.08
413	600475	华光环能	12,700	114,427.00	0.08
414	600103	青山纸业	44,500	113,920.00	0.08
415	301051	信濠光电	4,200	113,652.00	0.08
416	300265	通光线缆	13,800	113,436.00	0.08
417	002483	润邦股份	21,500	112,015.00	0.08
418	300560	中富通	7,200	111,456.00	0.08
419	600477	杭萧钢构	43,200	111,024.00	0.08
420	002960	青鸟消防	9,500	110,865.00	0.08
421	600063	皖维高新	27,700	110,800.00	0.08
422	300095	华伍股份	16,200	109,998.00	0.07
423	000718	苏宁环球	46,600	109,976.00	0.07
424	002130	沃尔核材	4,300	108,575.00	0.07
425	300648	星云股份	4,700	108,100.00	0.07
426	002081	金螳螂	30,100	107,457.00	0.07
427	688201	信安世纪	12,100	106,843.00	0.07
428	002810	山东赫达	8,200	105,370.00	0.07
429	002026	山东威达	10,700	105,288.00	0.07
430	300423	昇辉科技	15,000	103,800.00	0.07
431	002583	海能达	7,200	102,312.00	0.07
432	002345	潮宏基	17,600	102,256.00	0.07
433	300679	电连技术	1,700	101,490.00	0.07
434	002556	辉隆股份	17,900	99,703.00	0.07
435	600367	红星发展	8,500	98,090.00	0.07
436	002758	浙农股份	11,200	98,000.00	0.07
437	002367	康力电梯	14,200	97,554.00	0.07
438	300228	富瑞特装	13,800	97,290.00	0.07
439	300365	恒华科技	15,600	95,784.00	0.07
440	600363	联创光电	2,000	95,760.00	0.07
441	000968	蓝焰控股	14,300	95,095.00	0.06

442	688208	道通科技	2,400	93,984.00	0.06
443	002573	清新环境	23,600	93,928.00	0.06
444	002847	盐津铺子	1,500	93,900.00	0.06
445	600649	城投控股	20,800	92,560.00	0.06
446	301322	绿通科技	4,200	92,316.00	0.06
447	603187	海容冷链	8,100	90,639.00	0.06
448	301026	浩通科技	3,300	90,420.00	0.06
449	300381	溢多利	12,700	89,154.00	0.06
450	002265	建设工业	3,800	88,426.00	0.06
451	601199	江南水务	15,900	87,927.00	0.06
452	300827	上能电气	2,000	87,800.00	0.06
453	688408	中信博	1,200	86,400.00	0.06
454	600602	云赛智联	5,400	85,428.00	0.06
455	603920	世运电路	2,900	85,260.00	0.06
456	688798	艾为电子	1,200	83,784.00	0.06
457	688322	奥比中光	1,800	83,700.00	0.06
458	603618	杭电股份	15,400	83,622.00	0.06
459	002233	塔牌集团	10,800	82,836.00	0.06
460	002641	公元股份	18,600	81,840.00	0.06
461	300229	拓尔思	3,900	81,666.00	0.06
462	600742	一汽富维	9,200	81,420.00	0.06
463	688498	源杰科技	600	80,520.00	0.05
464	600425	青松建化	20,200	79,184.00	0.05
465	605186	健麾信息	3,900	78,429.00	0.05
466	605333	沪光股份	2,400	78,312.00	0.05
467	002416	爱施德	4,800	78,096.00	0.05
468	601008	连云港	20,300	77,749.00	0.05
469	688300	联瑞新材	1,200	77,280.00	0.05
470	002061	浙江交科	18,900	77,112.00	0.05
471	600601	方正科技	17,500	76,825.00	0.05
472	002698	博实股份	4,500	76,500.00	0.05
473	300811	铂科新材	1,400	75,474.00	0.05
474	300913	兆龙互连	1,300	74,763.00	0.05
475	688343	云天励飞	1,500	74,400.00	0.05
476	002996	顺博合金	11,200	74,368.00	0.05
477	600012	皖通高速	4,200	74,130.00	0.05
478	300492	华图山鼎	1,000	72,800.00	0.05
479	002270	华明装备	4,300	72,627.00	0.05
480	002668	TCL 智家	5,500	72,160.00	0.05
481	300616	尚品宅配	5,700	69,825.00	0.05
482	002911	佛燃能源	5,500	69,520.00	0.05
483	603283	赛腾股份	1,000	69,160.00	0.05
484	688327	云从科技	5,700	68,970.00	0.05

485	600446	金证股份	4,000	68,960.00	0.05
486	603039	泛微网络	1,400	68,600.00	0.05
487	301078	孩子王	6,000	68,280.00	0.05
488	300196	长海股份	6,200	67,518.00	0.05
489	000829	天音控股	5,100	67,218.00	0.05
490	300820	英杰电气	1,200	66,300.00	0.05
491	600206	有研新材	4,200	65,814.00	0.04
492	300315	掌趣科技	11,800	64,900.00	0.04
493	300638	广和通	3,200	64,480.00	0.04
494	300613	富瀚微	1,100	64,350.00	0.04
495	601595	上海电影	2,600	64,220.00	0.04
496	688362	甬矽电子	1,900	63,992.00	0.04
497	688133	泰坦科技	3,500	63,840.00	0.04
498	301050	雷电微力	1,200	61,896.00	0.04
499	300910	瑞丰新材	1,300	61,867.00	0.04
500	600452	涪陵电力	5,800	61,422.00	0.04
501	600750	江中药业	2,700	61,290.00	0.04
502	688432	有研硅	5,400	61,020.00	0.04
503	688029	南微医学	900	60,831.00	0.04
504	300168	万达信息	7,600	60,344.00	0.04
505	300548	博创科技	1,300	60,333.00	0.04
506	600285	羚锐制药	2,700	59,832.00	0.04
507	603033	三维股份	4,700	59,643.00	0.04
508	603997	继峰股份	5,200	59,540.00	0.04
509	600776	东方通信	5,300	59,307.00	0.04
510	603530	神马电力	2,400	59,304.00	0.04
511	300113	顺网科技	3,500	58,835.00	0.04
512	002083	孚日股份	11,900	58,191.00	0.04
513	300738	奥飞数据	4,000	58,000.00	0.04
514	301200	大族数控	1,600	57,888.00	0.04
515	603337	杰克股份	1,900	57,874.00	0.04
516	601126	四方股份	3,400	57,664.00	0.04
517	300525	博思软件	3,700	57,646.00	0.04
518	000810	创维数字	3,600	57,312.00	0.04
519	300260	新莱应材	2,100	56,889.00	0.04
520	001287	中电港	2,800	56,868.00	0.04
521	000681	视觉中国	2,700	56,214.00	0.04
522	600094	大名城	15,400	56,056.00	0.04
523	002139	拓邦股份	4,100	55,801.00	0.04
524	688336	三生国健	2,600	55,692.00	0.04
525	301487	盟固利	2,600	55,302.00	0.04
526	601678	滨化股份	14,700	55,272.00	0.04
527	688185	康希诺	900	54,945.00	0.04

528	688001	华兴源创	2,000	54,200.00	0.04
529	000682	东方电子	5,000	53,550.00	0.04
530	000795	英洛华	5,500	53,515.00	0.04
531	002338	奥普光电	1,400	52,808.00	0.04
532	601882	海天精工	2,400	52,632.00	0.04
533	600548	深高速	3,900	52,572.00	0.04
534	600186	莲花控股	9,200	52,440.00	0.04
535	603103	横店影视	3,600	51,804.00	0.04
536	001236	弘业期货	5,300	51,092.00	0.03
537	300130	新国都	2,300	49,818.00	0.03
538	300660	江苏雷利	1,300	49,686.00	0.03
539	600577	精达股份	6,800	49,572.00	0.03
540	002979	雷赛智能	1,600	49,264.00	0.03
541	600771	广誉远	2,600	49,036.00	0.03
542	000567	海德股份	7,100	48,493.00	0.03
543	603220	中贝通信	2,100	48,237.00	0.03
544	603766	隆鑫通用	5,300	48,230.00	0.03
545	300580	贝斯特	2,100	48,195.00	0.03
546	688351	微电生理	2,500	47,600.00	0.03
547	688700	东威科技	1,600	47,136.00	0.03
548	605198	安德利	1,700	46,869.00	0.03
549	002891	中宠股份	1,300	46,410.00	0.03
550	300456	赛微电子	2,700	46,386.00	0.03
551	688190	云路股份	500	46,000.00	0.03
552	300655	晶瑞电材	4,900	45,864.00	0.03
553	301381	赛维时代	2,000	45,520.00	0.03
554	300705	九典制药	2,500	44,875.00	0.03
555	002335	科华数据	1,500	43,380.00	0.03
556	002707	众信旅游	5,800	42,862.00	0.03
557	600308	华泰股份	11,700	42,588.00	0.03
558	300855	图南股份	1,900	41,648.00	0.03
559	300327	中颖电子	1,700	41,599.00	0.03
560	688123	聚辰股份	700	40,964.00	0.03
561	600301	华锡有色	2,400	40,824.00	0.03
562	605179	一鸣食品	2,000	40,000.00	0.03
563	000833	粤桂股份	3,500	39,795.00	0.03
564	600993	马应龙	1,500	39,165.00	0.03
565	688596	正帆科技	1,100	39,105.00	0.03
566	300222	科大智能	3,900	38,883.00	0.03
567	688639	华恒生物	1,200	38,652.00	0.03
568	603533	掌阅科技	1,900	38,589.00	0.03
569	002467	二六三	6,900	38,088.00	0.03
570	300075	数字政通	2,200	38,060.00	0.03

571	301061	匠心家居	600	37,080.00	0.03
572	603277	银都股份	1,600	37,072.00	0.03
573	002378	章源钨业	5,500	35,585.00	0.02
574	300671	富满微	1,000	35,540.00	0.02
575	601038	一拖股份	2,400	35,472.00	0.02
576	603100	川仪股份	1,600	34,480.00	0.02
577	300224	正海磁材	2,800	34,468.00	0.02
578	002215	诺普信	3,000	33,690.00	0.02
579	688326	经纬恒润	400	33,640.00	0.02
580	000848	承德露露	3,700	33,189.00	0.02
581	002840	华统股份	2,600	32,786.00	0.02
582	000969	安泰科技	2,900	32,335.00	0.02
583	600055	万东医疗	2,100	31,710.00	0.02
584	600422	昆药集团	2,000	31,700.00	0.02
585	002324	普利特	3,300	31,449.00	0.02
586	688439	振华风光	600	30,774.00	0.02
587	300856	科思股份	1,200	30,744.00	0.02
588	300723	一品红	1,800	30,708.00	0.02
589	603477	巨星农牧	1,700	30,175.00	0.02
590	002832	比音勒芬	1,400	29,974.00	0.02
591	002881	美格智能	1,000	29,960.00	0.02
592	300893	松原股份	1,000	29,180.00	0.02
593	002458	益生股份	3,000	28,830.00	0.02
594	300170	汉得信息	2,300	28,520.00	0.02
595	688138	清溢光电	1,200	27,480.00	0.02
596	003039	顺控发展	2,100	27,468.00	0.02
597	000061	农产品	3,900	27,339.00	0.02
598	601949	中国出版	3,800	27,284.00	0.02
599	301219	腾远钴业	600	27,126.00	0.02
600	301018	申菱环境	700	26,978.00	0.02
601	002675	东诚药业	2,200	26,884.00	0.02
602	300846	首都在线	1,900	26,429.00	0.02
603	603421	鼎信通讯	3,700	26,381.00	0.02
604	002245	蔚蓝锂芯	2,400	25,656.00	0.02
605	002275	桂林三金	1,700	25,653.00	0.02
606	603279	景津装备	1,400	25,032.00	0.02
607	300590	移为通信	1,600	24,736.00	0.02
608	300527	中船应急	3,000	24,210.00	0.02
609	600903	XD 贵州燃	3,100	24,180.00	0.02
610	002158	汉钟精机	1,300	24,076.00	0.02
611	002550	千红制药	3,800	23,560.00	0.02
612	600645	中源协和	1,200	23,160.00	0.02
613	600163	中闽能源	3,800	23,142.00	0.02

614	002626	金达威	1,500	22,650.00	0.02
615	300708	聚灿光电	1,800	22,482.00	0.02
616	000555	神州信息	2,000	22,400.00	0.02
617	688106	金宏气体	1,300	22,113.00	0.02
618	688586	江航装备	2,300	22,011.00	0.01
619	301215	中汽股份	3,600	21,420.00	0.01
620	002149	西部材料	1,200	21,240.00	0.01
621	003040	楚天龙	1,600	20,912.00	0.01
622	002020	京新药业	1,600	20,480.00	0.01
623	300814	中富电路	600	19,452.00	0.01
624	603197	保隆科技	500	18,875.00	0.01
625	300470	中密控股	500	18,850.00	0.01
626	603055	台华新材	1,700	18,836.00	0.01
627	603698	航天工程	1,200	18,672.00	0.01
628	000048	京基智农	1,000	18,000.00	0.01
629	300398	飞凯材料	1,100	17,336.00	0.01
630	301376	致欧科技	900	17,208.00	0.01
631	000409	云鼎科技	1,900	16,929.00	0.01
632	300183	东软载波	800	15,480.00	0.01
633	002238	天威视讯	1,900	15,257.00	0.01
634	300790	宇瞳光学	700	13,363.00	0.01
635	000420	吉林化纤	3,400	12,274.00	0.01
636	603281	江瀚新材	500	12,200.00	0.01
637	300031	宝通科技	500	9,160.00	0.01
638	301367	怡和嘉业	140	8,820.00	0.01

8.3.2 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	688768	容知日新	8,400	305,256.00	0.21
2	601566	九牧王	33,700	283,417.00	0.19
3	603938	三孚股份	24,300	262,683.00	0.18
4	603811	诚意药业	33,300	257,076.00	0.17
5	600261	阳光照明	74,800	244,596.00	0.17
6	002224	三力士	56,500	244,080.00	0.17
7	601002	晋亿实业	55,800	242,730.00	0.17
8	002805	丰元股份	20,100	239,190.00	0.16
9	300986	志特新材	19,700	239,158.00	0.16
10	688357	建龙微纳	5,500	120,615.00	0.08
11	600610	中毅达	28,200	119,286.00	0.08
12	600731	湖南海利	20,800	118,560.00	0.08
13	002476	宝莫股份	27,800	117,316.00	0.08
14	002549	凯美特气	18,700	114,631.00	0.08
15	603051	鹿山新材	4,700	113,317.00	0.08

16	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.04
17	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.03
18	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.02
19	688615	合合信息	157	26,027.46	0.02
20	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.02
21	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
22	603072	天和磁材	1,488	18,302.40	0.01
23	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
24	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
25	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
26	301606	绿联科技	329	12,005.21	0.01
27	301622	英思特	261	11,724.12	0.01
28	688710	益诺思	332	11,148.56	0.01
29	301608	博实结	166	10,853.08	0.01
30	301631	壹连科技	102	10,399.92	0.01
31	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.01
32	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
33	301552	科力装备	143	8,132.41	0.01
34	301617	博苑股份	190	7,560.10	0.01
35	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.01
36	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.01
37	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
38	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
39	603194	中力股份	142	3,994.46	0.00
40	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600757	长江传媒	10,428,600.00	2.50
2	002955	鸿合科技	9,485,999.00	2.27
3	002859	洁美科技	8,419,117.00	2.02
4	688083	中望软件	6,920,421.12	1.66
5	300783	三只松鼠	6,734,021.40	1.61
6	688668	鼎通科技	6,600,119.52	1.58
7	600577	精达股份	6,166,355.00	1.48
8	688018	乐鑫科技	5,905,296.87	1.41
9	688166	博瑞医药	5,889,879.97	1.41
10	300494	盛天网络	5,840,321.80	1.40
11	600866	星湖科技	5,766,409.00	1.38
12	688103	国力股份	5,386,763.22	1.29
13	688127	蓝特光学	5,355,322.76	1.28

14	601811	新华文轩	5,337,055.00	1.28
15	300926	博俊科技	5,292,962.20	1.27
16	603516	淳中科技	5,166,768.00	1.24
17	603283	赛腾股份	4,844,064.00	1.16
18	002322	理工能科	4,781,430.00	1.14
19	002130	沃尔核材	4,690,663.00	1.12
20	300280	紫天科技	4,622,456.00	1.11

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。

8.4.2 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	600757	长江传媒	12,231,864.34	2.93
2	300783	三只松鼠	10,292,673.57	2.46
3	002955	鸿合科技	9,132,859.00	2.19
4	002859	洁美科技	8,429,968.00	2.02
5	688668	鼎通科技	8,344,781.30	2.00
6	688083	中望软件	7,408,270.16	1.77
7	600866	星湖科技	7,280,930.00	1.74
8	300494	盛天网络	7,083,604.24	1.70
9	001309	德明利	7,053,423.00	1.69
10	002851	麦格米特	6,695,115.00	1.60
11	601595	上海电影	6,693,392.00	1.60
12	300280	紫天科技	6,684,832.00	1.60
13	688018	乐鑫科技	6,609,215.54	1.58
14	300364	中文在线	6,429,907.00	1.54
15	603859	能科科技	6,402,229.99	1.53
16	688127	蓝特光学	6,372,347.70	1.53
17	688166	博瑞医药	6,307,567.44	1.51
18	600577	精达股份	6,144,336.00	1.47
19	300181	佐力药业	6,100,700.24	1.46
20	603516	淳中科技	5,952,925.00	1.42

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。

8.4.3 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	1,917,887,860.83
卖出股票收入（成交）总额	2,175,236,453.66

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，深圳市华盛昌科技实业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。广东德联集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省统计局的处罚。

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	534,328.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,328.66

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
中欧国证 2000 指数增强 A	1,874	38,987.29	10,769,098.02	14.74%	62,293,075.97	85.26%
中欧国证 2000 指数增强 C	1,890	37,448.50	1,100,319.50	1.55%	69,677,348.99	98.45%
合计	3,764	38,214.62	11,869,417.52	8.25%	131,970,424.96	91.75%

9.2 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	中欧国证 2000 指数增强 A	0.00	0.00%
	中欧国证 2000 指数增强 C	4,888.64	0.01%
	合计	4,888.64	0.00%

9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	中欧国证 2000 指数增强 A	0
	中欧国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧国证 2000 指数增强 A	0
	中欧国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 7 月 18 日) 基金份额总额	342,646,381.98	427,071,109.12
本报告期期初基金份额总额	236,928,648.96	192,999,060.42
本报告期基金总申购份额	21,604,623.27	152,101,507.24
减：本报告期基金总赎回份额	185,471,098.24	274,322,899.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	73,062,173.99	70,777,668.49

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 50,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东北证券	3	2,142,555,047.06	52.38	813,432.53	53.08	-
中信建投	3	1,948,026,00	47.62	719,005.15	46.92	-

		6.33			
--	--	------	--	--	--

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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

11.8 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2023年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15

8	中欧国证 2000 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	2024-06-25
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
10	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
11	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
13	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
14	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
15	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2024-12-11
16	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2024-12-14
17	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2024-12-18

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日