

中欧金安量化混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56

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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧金安量化混合型证券投资基金	
基金简称	中欧金安量化混合	
基金主代码	014135	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 20 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	国金证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	358,480,787.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
下属分级基金的交易代码	014135	014136
报告期末下属分级基金的份额总额	311,989,949.57 份	46,490,837.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金将参照以中证 500 指数为主要标准配置基金资产，对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	国金证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	陈俐洁
	联系电话	021-68609600	021-20527198-15217
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	chenlj@gjzq.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95310
传真		021-50190017	028-86690232

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	成都市青羊区东城根上街 95 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	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 13 楼资产托管部
邮政编码	200120	610015
法定代表人	窦玉明	冉云

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
本期已实现收益	22,559,961.37	2,865,727.98
本期利润	49,124,508.73	6,539,470.26
加权平均基金份额 本期利润	0.1235	0.1198
本期加权平均净 值利润率	12.68%	12.61%
本期基金份额净 值增长率	13.46%	13.00%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	12,915,333.44	620,934.74

期末可供分配基金份额利润	0.0414	0.0134
期末基金资产净值	333,050,541.98	48,280,381.64
期末基金份额净值	1.0675	1.0385
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	6.75%	3.85%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧金安量化混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.55%	0.79%	4.05%	0.75%	2.50%	0.04%
过去三个月	7.93%	1.68%	1.08%	1.44%	6.85%	0.24%
过去六个月	13.46%	1.40%	3.90%	1.30%	9.56%	0.10%
过去一年	32.77%	1.61%	19.50%	1.60%	13.27%	0.01%
过去三年	7.75%	1.27%	-6.29%	1.26%	14.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.75%	1.28%	-14.38%	1.31%	21.13%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*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。

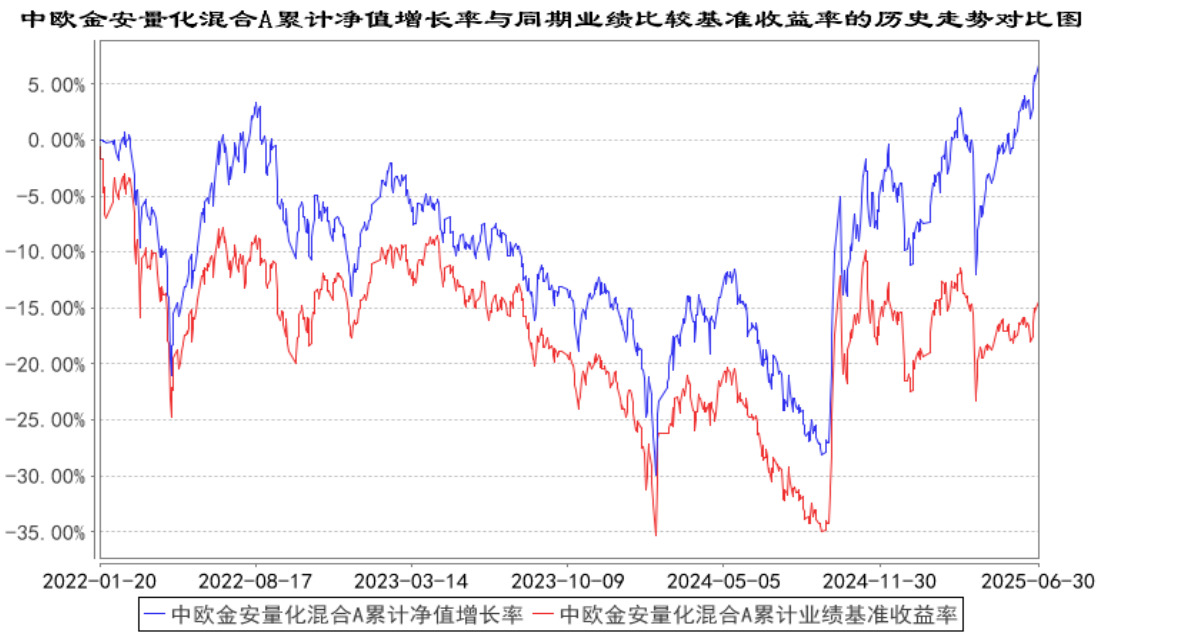
中欧金安量化混合 C

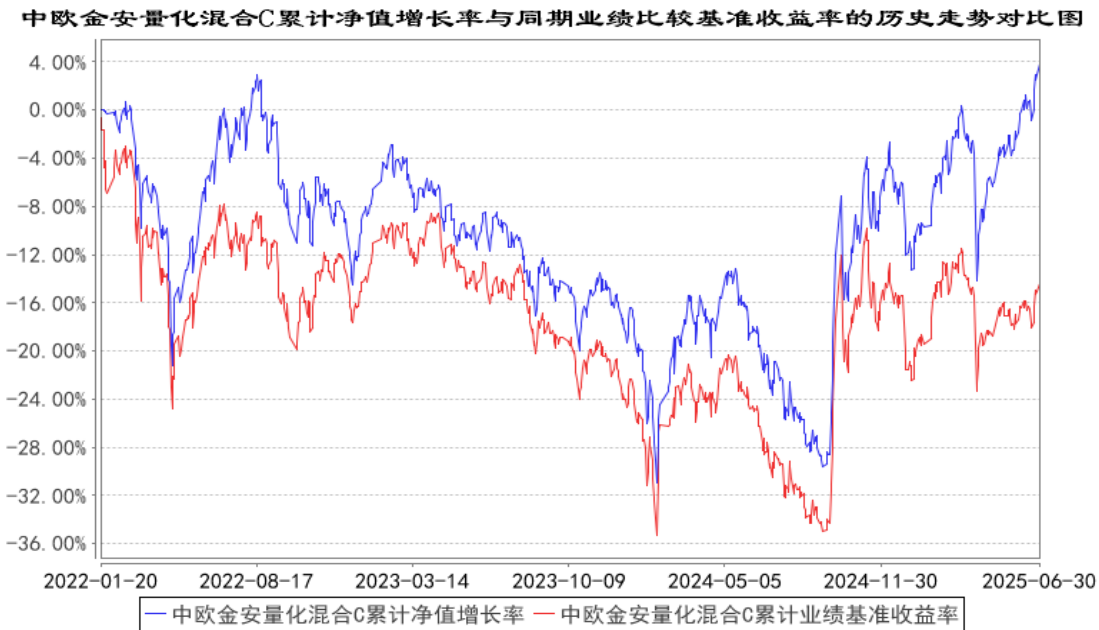
阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①－③	②－④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	6.48%	0.79%	4.05%	0.75%	2.43%	0.04%
过去三个月	7.72%	1.68%	1.08%	1.44%	6.64%	0.24%
过去六个月	13.00%	1.40%	3.90%	1.30%	9.10%	0.10%
过去一年	31.71%	1.61%	19.50%	1.60%	12.21%	0.01%
过去三年	5.20%	1.27%	-6.29%	1.26%	11.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.85%	1.27%	-14.38%	1.31%	18.23%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*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





§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 208 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2024-04-23	—	3 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
宋婷	基金经理	2025-04-02	—	7 年	历任上海千象资产管理有限公司股票研究员、股票投资经理。2023-07-03 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。
曲径	权益投决会委员 /	2022-01-20	—	18 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总

	权益专户 投决会委 员 / 量化 投资总监 / 基金经 理 / 投资 经理				裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限 公司。
--	---	--	--	--	--------------------------------

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 19 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年二季度 A 股市场整体呈现宽幅震荡走势，结构性机会与宏观扰动交织，上证指数微幅上涨。从月度表现来看，4 月因地缘贸易摩擦风险升级，市场明显承压；5 月政策发力与中美谈判缓和带动上证指数反弹；6 月则在外部扰动与风险缓释中维持震荡偏强格局。4 月关税风险冲击显著，政策维稳市场。4 月 3 日美国加征对等关税幅度超出市场预期，引发全球资本市场剧烈波动，大宗商品、权益市场全线承压，全球避险情绪升温，市场同步回调。在市场大幅下行背景下，4 月 8 日中央汇金发布公告，实施增持 ETF 等多项举措，同时中央及各部委协同发声稳定市场预期，上证指数逐步企稳并反弹。随后，美国宣布暂缓征收对等关税 90 天，市场对中美贸易谈判的预期逐步升温，市场延续了回升态势。

在报告期内，本基金以中证 500 指数的行业配置为锚定，保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中盘平衡风格。基金利用基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成以中证 500 指数的特征为基准的投资组合，以达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对基准指数的超额收益。

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 13.46%，同期业绩比较基准收益率为 3.90%；基金 C 类份额净值增长率为 13.00%，同期业绩比较基准收益率为 3.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

从行业布局看，我们认为三大方向具备潜力：首先是科技成长领域，AI 产业已进入“硬件铺

路、软件变现”的关键阶段，重点关注估值合理的应用层企业，特别是具备垂直行业 know-how 的解决方案提供商。其次，传统周期行业迎来供给侧改革红利，部分化工、建材细分领域经过三年产能出清，行业集中度显著提升，在“整治内卷式竞争”政策指引下，头部优质企业盈利修复弹性可观。最后，消费行业中的“隐形冠军”值得长期布局，那些维持健康资产负债表、持续进行渠道优化的企业，一旦消费景气度回暖，将展现更强的业绩弹性。值得注意的是，这三个方向都符合“高质量增长”的转型主线，在估值洼地和政策催化双重作用下，有望成为引领市场复苏的重要引擎。

基于市场特征演变，本基金将继续强化模型对市场的适配性，力争提升策略在延续波动环境中的超额收益挖掘能力。通过风险把控与模型优化的双向发力，助力量化策略在复杂市场中追求更稳健的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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

报告期内，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守法律法规的规定、基金合同和托管协议（如有）的有关约定，诚信、尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据国家有关法律法规、基金合同的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本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

报告期内，由本基金管理人编制并经托管人复核的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

托管人提示投资者关注：因托管人获取信息有限，请投资者谨慎识别和判断风险，并及时向基金管理人获取本基金实际投资项目状况及风险状况等。

§ 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：中欧金安量化混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	25,517,432.84	33,539,107.49
结算备付金		682,828.71	1,290,653.59
存出保证金		140,817.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	354,950,646.80	450,552,209.90
其中：股票投资		354,950,646.80	442,935,290.04
基金投资		-	-
债券投资		-	7,616,919.86
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		4,021,921.45	1,215,617.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		385,313,647.40	486,597,588.92
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,364,376.61	2,252,366.05
应付管理人报酬		386,651.88	513,123.61
应付托管费		64,441.98	85,520.58
应付销售服务费		30,051.16	37,075.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,535.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	131,666.31	50,566.87
负债合计		3,982,723.78	2,938,653.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	358,480,787.46	515,361,631.96
未分配利润	6.4.7.8	22,850,136.16	-31,702,696.10
净资产合计		381,330,923.62	483,658,935.86
负债和净资产总计		385,313,647.40	486,597,588.92

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 358,480,787.46 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0675 元，基金份额总额 311,989,949.57 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0385 元，基金份额总额 46,490,837.89 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		59,018,477.76	-26,099,771.71
1. 利息收入		38,595.33	93,589.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,595.33	93,589.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		28,585,969.38	-12,402,971.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,512,070.41	-21,216,098.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	23,430.14	-
资产支持证券投 资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	429,120.28	1,223,902.66
股利收益	6.4.7.14	4,621,348.55	7,589,223.87
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	30,238,289.64	-13,853,320.76
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	155,623.41	62,931.12
减：二、营业总支出		3,354,498.77	4,068,581.84
1. 管理人报酬		2,617,293.33	3,174,105.07
2. 托管费		436,215.54	529,017.45
3. 销售服务费		206,033.04	256,975.54
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-

7. 税金及附加		1,550.24	5,002.12
8. 其他费用	6.4.7.18	93,406.62	103,481.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,663,978.99	-30,168,353.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		55,663,978.99	-30,168,353.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		55,663,978.99	-30,168,353.55

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧金安量化混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	515,361,631.96	-	-31,702,696.10	483,658,935.86
二、本期期初净资产	515,361,631.96	-	-31,702,696.10	483,658,935.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 156,880,844.50	-	54,552,832.26	-102,328,012.24
（一）、综合收益总额	-	-	55,663,978.99	55,663,978.99
（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）	- 156,880,844.50	-	-1,111,146.73	-157,991,991.23
其中：1. 基金申购款	59,838,977.79	-	-1,651,077.18	58,187,900.61
2. 基金赎回款	- 216,719,822.29	-	539,930.45	-216,179,891.84
（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	358,480,787.46	-	22,850,136.16	381,330,923.62
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	693,047,918.43	-	- 105,490,263.37	587,557,655.06
二、本期期初净资产	693,047,918.43	-	- 105,490,263.37	587,557,655.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-84,571,621.80	-	-14,993,293.09	-99,564,914.89
（一）、综合收益总额	-	-	-30,168,353.55	-30,168,353.55
（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）	-84,571,621.80	-	15,175,060.46	-69,396,561.34
其中：1. 基金申购款	20,761,057.09	-	-3,572,921.82	17,188,135.27
2. 基金赎回款	- 105,332,678.89	-	18,747,982.28	-86,584,696.61
（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	608,476,296.63	-	- 120,483,556.46	487,992,740.17

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
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

中欧金安量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3328 号文《关于准予中欧金安量化混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,032,691,612.76 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_B11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,032,840,253.50 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 148,640.74 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 893,269,013.78 份，包含认购利息折合 133,841.80 份；C 类基金的基金份额总额为 139,571,239.72 份，包含认购利息折合 14,798.94 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，基金托管人为国金证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧金安量化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、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（不含合约类信用衍生品）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，

金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,819,265.61
等于：本金	1,818,222.71
加：应计利息	1,042.90
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	23,698,167.23
等于：本金	23,697,769.24

加：应计利息	397.99
减：坏账准备	-
合计	25,517,432.84

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		338,794,823.53	-	354,950,646.80	16,155,823.27
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		338,794,823.53	-	354,950,646.80	16,155,823.27

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,120,620.00	-	-	-
其中： 股指期货 投资	1,120,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,120,620.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	1.00	1,173,480.00	52,860.00
合计				52,860.00
减：可抵销期货暂收款				52,860.00
净额				0.00

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

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,034.05
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	24,795.19
其他应付	46,329.70
合计	131,666.31

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	458,725,662.99	458,725,662.99
本期申购	45,751,449.64	45,751,449.64
本期赎回（以“-”号填列）	-192,487,163.06	-192,487,163.06
本期末	311,989,949.57	311,989,949.57

中欧金安量化混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,635,968.97	56,635,968.97
本期申购	14,087,528.15	14,087,528.15
本期赎回（以“-”号填列）	-24,232,659.23	-24,232,659.23
本期末	46,490,837.89	46,490,837.89

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧金安量化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,524,545.72	-18,588,341.21	-27,112,886.93
本期期初	-8,524,545.72	-18,588,341.21	-27,112,886.93
本期利润	22,559,961.37	26,564,547.36	49,124,508.73
本期基金份额交易产生的变动数	-1,120,082.21	169,052.82	-951,029.39
其中：基金申购款	276,540.43	-1,072,344.45	-795,804.02
基金赎回款	-1,396,622.64	1,241,397.27	-155,225.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,915,333.44	8,145,258.97	21,060,592.41

中欧金安量化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,338,279.71	-2,251,529.46	-4,589,809.17
本期期初	-2,338,279.71	-2,251,529.46	-4,589,809.17
本期利润	2,865,727.98	3,673,742.28	6,539,470.26
本期基金份额交易产生的变动数	93,486.47	-253,603.81	-160,117.34
其中：基金申购款	-373,278.33	-481,994.83	-855,273.16
基金赎回款	466,764.80	228,391.02	695,155.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	620,934.74	1,168,609.01	1,789,543.75

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,139.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,362.10
结算备付金利息收入	8,093.79
其他	-
合计	38,595.33

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,325,520,502.60
减：卖出股票成本总额	2,299,719,295.82
减：交易费用	2,289,136.37
买卖股票差价收入	23,512,070.41

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	36,580.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-13,150.00
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	23,430.14

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,638,250.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,513,150.00
减：应计利息总额	138,250.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-13,150.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	429,120.28

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,621,348.55
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	4,621,348.55

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	30,185,429.64
股票投资	30,187,529.64
债券投资	-2,100.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	52,860.00
权证投资	-
期货投资	52,860.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	30,238,289.64

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	155,620.81
基金转换费收入	2.60
合计	155,623.41

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
存托服务费	104.06
合计	93,406.62

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，不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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构
自然人股东	基金管理人股东
国金证券股份有限公司（“国金证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
国金证券	503,328.64	0.01	211,363,983.58	3.60

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国金证券	219.33	0.03	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国金证券	402,189.88	12.15	-	-

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）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,617,293.33	3,174,105.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,015,101.99	1,230,009.74
应支付基金管理人的净管理费	1,602,191.34	1,944,095.33

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	436,215.54	529,017.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券	0.00	13,810.51	13,810.51
中欧财富	0.00	2,007.42	2,007.42
合计	0.00	15,817.93	15,817.93
上年度可比期间			

获得销售服务费的各关联方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C	合计
国金证券	0.00	25,225.43	25,225.43
中欧财富	0.00	1,870.67	1,870.67
合计	0.00	27,096.10	27,096.10

注：本基金 A 基金份额不收取销售服务费，本基金 C 基金份额的年销售服务费费率为 0.80%。计算方法如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧金安量化混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	-	-	438,079.85	0.10%

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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国金证券股份有限公司	2,483,905.35	17,239.04	3,218,078.63	19,700.16

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
001335	信 凯 科 技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富 岭 股 份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-

001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025年2月24日	6个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股流通受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股流通受限	27.57	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股流通受限	46.50	42.85	201	9,346.50	8,612.85	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-

603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股流通受限	93.50	90.66	65	6,077.50	5,892.90	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025年3月28日	6个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	6个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	XD 汇通控	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	25.80	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-

688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	XD 胜科纳	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	357	16,875.39	44,325.12	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	25,694	679,857.80	977,656.70	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过精选股票，在控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	25,517,432.84	-	-	-	25,517,432.84
结算备付金	682,828.71	-	-	-	682,828.71
存出保证金	-	-	-	140,817.60	140,817.60
交易性金融资产	-	-	-	354,950,646.80	354,950,646.80
应收申购款	-	-	-	4,021,921.45	4,021,921.45
资产总计	26,200,261.55	-	-	359,113,385.85	385,313,647.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,364,376.61	3,364,376.61
应付管理人报酬	-	-	-	386,651.88	386,651.88
应付托管费	-	-	-	64,441.98	64,441.98
应付销售服务费	-	-	-	30,051.16	30,051.16
应交税费	-	-	-	5,535.84	5,535.84
其他负债	-	-	-	131,666.31	131,666.31
负债总计	-	-	-	3,982,723.78	3,982,723.78
利率敏感度缺口	26,200,261.55	-	-	355,130,662.07	381,330,923.62
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	33,539,107.49	-	-	-	33,539,107.49
结算备付金	1,290,653.59	-	-	-	1,290,653.59
交易性金融资产	7,616,919.86	-	-	442,935,290.04	450,552,209.90
应收申购款	-	-	-	1,215,617.94	1,215,617.94
资产总计	42,446,680.94	-	-	444,150,907.98	486,597,588.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,252,366.05	2,252,366.05
应付管理人报酬	-	-	-	513,123.61	513,123.61
应付托管费	-	-	-	85,520.58	85,520.58
应付销售服务费	-	-	-	37,075.95	37,075.95
其他负债	-	-	-	50,566.87	50,566.87
负债总计	-	-	-	2,938,653.06	2,938,653.06
利率敏感度缺口	42,446,680.94	-	-	441,212,254.92	483,658,935.86

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：1.57%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	354,950,646.80	93.08	442,935,290.04	91.58
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	354,950,646.80	93.08	442,935,290.04	91.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	20,019,215.26	22,985,789.55
	业绩比较基准下降 5%	-20,019,215.26	-22,985,789.55

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	353,539,350.71	441,399,848.50
第二层次	993,042.24	8,521,136.36
第三层次	418,253.85	631,225.04
合计	354,950,646.80	450,552,209.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	354,950,646.80	92.12
	其中：股票	354,950,646.80	92.12
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	26,200,261.55	6.80
8	其他各项资产	4,162,739.05	1.08
9	合计	385,313,647.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	168,756.00	0.04
B	采矿业	9,303,700.25	2.44
C	制造业	219,512,432.90	57.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,465,062.00	2.48
E	建筑业	3,581,432.00	0.94
F	批发和零售业	10,240,462.65	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	9,725,491.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,382,177.00	6.92
J	金融业	35,391,618.20	9.28
K	房地产业	2,319,035.00	0.61
L	租赁和商务服务业	10,650,388.00	2.79
M	科学研究和技术服务业	8,537,724.80	2.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,012,626.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	193,032.00	0.05
Q	卫生和社会工作	245,850.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	4,558,217.00	1.20
S	综合	3,662,642.00	0.96
	合计	354,950,646.80	93.08

7.2.2 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

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	300400	劲拓股份	312,500	5,262,500.00	1.38
2	002624	完美世界	336,000	5,097,120.00	1.34
3	000553	安道麦 A	694,600	5,015,012.00	1.32
4	300241	瑞丰光电	839,000	4,782,300.00	1.25
5	000823	超声电子	381,000	4,514,850.00	1.18
6	002701	奥瑞金	756,900	4,503,555.00	1.18
7	600166	福田汽车	1,648,100	4,466,351.00	1.17
8	300363	博腾股份	251,800	4,300,744.00	1.13
9	600499	科达制造	410,200	4,019,960.00	1.05
10	002736	国信证券	346,000	3,985,920.00	1.05
11	600731	湖南海利	542,650	3,955,918.50	1.04
12	688258	卓易信息	81,500	3,947,045.00	1.04

13	300369	绿盟科技	494,500	3,842,265.00	1.01
14	601107	四川成渝	633,900	3,816,078.00	1.00
15	002913	奥士康	126,500	3,720,365.00	0.98
16	000987	越秀资本	534,500	3,666,670.00	0.96
17	600531	豫光金铅	465,900	3,606,066.00	0.95
18	000783	长江证券	497,400	3,446,982.00	0.90
19	002080	中材科技	174,400	3,400,800.00	0.89
20	300232	洲明科技	468,700	3,393,388.00	0.89
21	002303	美盈森	948,300	3,375,948.00	0.89
22	300684	中石科技	139,400	3,328,872.00	0.87
23	300279	和晶科技	469,600	3,254,328.00	0.85
24	300259	新天科技	906,800	3,219,140.00	0.84
25	600704	物产中大	610,800	3,218,916.00	0.84
26	000726	鲁 泰 A	500,800	3,175,072.00	0.83
27	300017	网宿科技	289,000	3,098,080.00	0.81
28	688334	西高院	179,922	3,091,059.96	0.81
29	300018	中元股份	379,200	3,014,640.00	0.79
30	000690	宝新能源	651,700	2,965,235.00	0.78
31	601555	东吴证券	338,300	2,960,125.00	0.78
32	300079	数码视讯	501,500	2,933,775.00	0.77
33	300196	长海股份	233,800	2,852,360.00	0.75
34	600020	中原高速	590,700	2,823,546.00	0.74
35	600998	九州通	547,900	2,816,206.00	0.74
36	000728	国元证券	355,100	2,801,739.00	0.73
37	603766	隆鑫通用	214,800	2,740,848.00	0.72
38	600073	光明肉业	362,000	2,671,560.00	0.70
39	002206	海 利 得	504,700	2,579,017.00	0.68
40	600176	中国巨石	217,900	2,484,060.00	0.65
41	002925	盈趣科技	136,600	2,456,068.00	0.64
42	600382	广东明珠	439,555	2,395,574.75	0.63
43	002739	万达电影	207,000	2,366,010.00	0.62
44	000906	浙商中拓	371,200	2,364,544.00	0.62
45	000975	山金国际	123,800	2,344,772.00	0.61
46	300787	海能实业	168,440	2,332,894.00	0.61
47	300212	易华录	106,700	2,321,792.00	0.61
48	300050	世纪鼎利	400,600	2,295,438.00	0.60
49	601208	东材科技	241,300	2,287,524.00	0.60
50	000988	华工科技	48,600	2,284,686.00	0.60
51	300105	龙源技术	295,100	2,275,221.00	0.60
52	002228	合兴包装	619,900	2,188,247.00	0.57
53	600662	外服控股	418,900	2,140,579.00	0.56
54	600901	江苏金租	344,920	2,090,215.20	0.55
55	002056	横店东磁	143,400	2,029,110.00	0.53

56	600620	天宸股份	347,900	1,899,534.00	0.50
57	601319	中国人保	214,800	1,870,908.00	0.49
58	600578	京能电力	415,000	1,863,350.00	0.49
59	600517	国网英大	353,800	1,804,380.00	0.47
60	300206	理邦仪器	148,300	1,782,566.00	0.47
61	600673	东阳光	151,600	1,763,108.00	0.46
62	600183	生益科技	57,400	1,730,610.00	0.45
63	605077	华康股份	106,400	1,721,552.00	0.45
64	600039	四川路桥	172,100	1,703,790.00	0.45
65	600919	江苏银行	142,000	1,695,480.00	0.44
66	688711	宏微科技	96,038	1,689,308.42	0.44
67	300777	中简科技	46,000	1,667,500.00	0.44
68	600582	天地科技	273,500	1,638,265.00	0.43
69	688222	成都先导	101,400	1,630,512.00	0.43
70	002299	圣农发展	111,000	1,586,190.00	0.42
71	000404	长虹华意	214,100	1,520,110.00	0.40
72	688373	盟科药业	238,521	1,495,526.67	0.39
73	688079	美迪凯	146,383	1,469,685.32	0.39
74	603936	博敏电子	152,300	1,436,189.00	0.38
75	600268	国电南自	183,000	1,431,060.00	0.38
76	601918	新集能源	221,300	1,429,598.00	0.37
77	601717	中创智领	85,800	1,425,996.00	0.37
78	002706	良信股份	159,600	1,422,036.00	0.37
79	002010	传化智联	250,100	1,395,558.00	0.37
80	600782	新钢股份	391,900	1,387,326.00	0.36
81	605305	中际联合	49,600	1,377,888.00	0.36
82	688176	亚虹医药	153,022	1,357,305.14	0.36
83	300168	万达信息	176,800	1,356,056.00	0.36
84	600063	皖维高新	292,100	1,337,818.00	0.35
85	002442	龙星科技	207,400	1,323,212.00	0.35
86	000902	新洋丰	94,000	1,300,020.00	0.34
87	002344	海宁皮城	296,100	1,285,074.00	0.34
88	603098	森特股份	122,400	1,247,256.00	0.33
89	605020	永和股份	53,300	1,228,032.00	0.32
90	300496	中科创达	21,300	1,218,786.00	0.32
91	601665	齐鲁银行	192,600	1,217,232.00	0.32
92	000030	富奥股份	206,542	1,216,532.38	0.32
93	002091	江苏国泰	167,300	1,216,271.00	0.32
94	600873	梅花生物	110,200	1,178,038.00	0.31
95	601456	国联民生	112,500	1,164,375.00	0.31
96	300978	东箭科技	103,900	1,159,524.00	0.30
97	301282	金禄电子	46,000	1,140,340.00	0.30
98	605259	绿田机械	58,100	1,139,341.00	0.30

99	603466	风语筑	112,900	1,139,161.00	0.30
100	300510	金冠股份	244,800	1,121,184.00	0.29
101	000089	深圳机场	161,600	1,115,040.00	0.29
102	688668	鼎通科技	17,820	1,113,037.20	0.29
103	600583	海油工程	201,300	1,099,098.00	0.29
104	600261	阳光照明	332,500	1,090,600.00	0.29
105	000686	东北证券	142,800	1,089,564.00	0.29
106	300662	科锐国际	35,200	1,045,792.00	0.27
107	000776	广发证券	61,600	1,035,496.00	0.27
108	600490	鹏欣资源	231,200	1,014,968.00	0.27
109	300843	胜蓝股份	31,800	1,007,742.00	0.26
110	000100	TCL 科技	229,600	994,168.00	0.26
111	601369	陕鼓动力	113,300	993,641.00	0.26
112	600057	厦门象屿	140,600	988,418.00	0.26
113	600510	黑牡丹	192,600	980,334.00	0.26
114	688313	仕佳光子	25,694	977,656.70	0.26
115	301507	民生健康	67,100	973,621.00	0.26
116	688425	铁建重工	237,568	969,277.44	0.25
117	002434	万里扬	131,700	965,361.00	0.25
118	002939	长城证券	113,700	952,806.00	0.25
119	301080	百普赛斯	13,100	937,043.00	0.25
120	002539	云图控股	99,000	928,620.00	0.24
121	601828	美凯龙	320,700	926,823.00	0.24
122	600956	新天绿能	119,600	923,312.00	0.24
123	600675	中华企业	316,900	912,672.00	0.24
124	300160	秀强股份	161,100	905,382.00	0.24
125	002367	康力电梯	128,000	899,840.00	0.24
126	000563	陕国投 A	251,600	898,212.00	0.24
127	603811	诚意药业	96,400	889,772.00	0.23
128	002483	润邦股份	140,200	876,250.00	0.23
129	600866	星湖科技	126,700	875,497.00	0.23
130	600273	嘉化能源	102,600	867,996.00	0.23
131	002001	新 和 成	40,568	862,881.36	0.23
132	300207	欣旺达	43,000	862,580.00	0.23
133	300081	恒信东方	121,700	861,636.00	0.23
134	002632	道明光学	91,700	852,810.00	0.22
135	002636	金安国纪	88,100	835,188.00	0.22
136	002803	吉宏股份	58,500	834,210.00	0.22
137	600262	北方股份	36,100	823,080.00	0.22
138	603966	法兰泰克	88,000	816,640.00	0.21
139	688526	科前生物	51,047	795,312.26	0.21
140	300088	长信科技	131,800	785,528.00	0.21
141	600267	海正药业	83,600	773,300.00	0.20

142	300737	科顺股份	160,400	773,128.00	0.20
143	600219	南山铝业	201,800	772,894.00	0.20
144	300725	药石科技	19,900	770,130.00	0.20
145	002362	汉王科技	33,900	760,038.00	0.20
146	601061	中信金属	95,900	758,569.00	0.20
147	300825	阿尔特	70,100	757,781.00	0.20
148	601568	北元集团	171,600	712,140.00	0.19
149	002532	天山铝业	84,200	699,702.00	0.18
150	300539	横河精密	51,100	699,559.00	0.18
151	002249	大洋电机	102,200	672,476.00	0.18
152	600640	国脉文化	55,300	670,236.00	0.18
153	300041	回天新材	71,000	668,820.00	0.18
154	600288	大恒科技	61,900	636,332.00	0.17
155	300140	节能环境	102,000	629,340.00	0.17
156	301220	亚香股份	13,900	624,110.00	0.16
157	603969	银龙股份	84,400	618,652.00	0.16
158	601318	XD 中国平	10,900	604,732.00	0.16
159	603500	祥和实业	65,000	595,400.00	0.16
160	600060	海信视像	25,500	587,010.00	0.15
161	000936	华西股份	85,200	586,176.00	0.15
162	000932	华菱钢铁	132,300	582,120.00	0.15
163	600909	XD 华安证	98,300	573,089.00	0.15
164	002661	克明食品	56,500	565,565.00	0.15
165	600067	冠城新材	187,600	559,048.00	0.15
166	601138	工业富联	26,000	555,880.00	0.15
167	688183	生益电子	10,800	552,960.00	0.15
168	301230	泓博医药	16,000	550,720.00	0.14
169	000421	南京公用	82,300	540,711.00	0.14
170	600163	中闽能源	103,000	527,360.00	0.14
171	600169	太原重工	215,700	521,994.00	0.14
172	002454	松芝股份	67,200	518,784.00	0.14
173	600739	辽宁成大	46,200	508,200.00	0.13
174	688722	同益中	23,363	496,931.01	0.13
175	603328	依顿电子	50,600	496,386.00	0.13
176	301526	国际复材	134,100	488,124.00	0.13
177	603083	剑桥科技	10,300	487,190.00	0.13
178	000828	东莞控股	45,000	481,050.00	0.13
179	300257	开山股份	47,600	479,332.00	0.13
180	600237	铜峰电子	66,100	479,225.00	0.13
181	300888	稳健医疗	11,600	476,760.00	0.13
182	688055	龙腾光电	126,186	466,888.20	0.12
183	300219	鸿利智汇	69,000	463,680.00	0.12
184	002384	东山精密	12,200	460,794.00	0.12

185	300850	新强联	12,800	458,496.00	0.12
186	600036	招商银行	9,900	454,905.00	0.12
187	300222	科大智能	44,600	454,474.00	0.12
188	300119	瑞普生物	23,000	446,660.00	0.12
189	688488	艾迪药业	31,600	437,660.00	0.11
190	605118	力鼎光电	17,500	434,525.00	0.11
191	002645	华宏科技	47,400	430,392.00	0.11
192	002127	南极电商	108,200	429,554.00	0.11
193	301367	瑞迈特	5,100	428,910.00	0.11
194	603113	金能科技	61,800	428,274.00	0.11
195	002350	北京科锐	62,400	428,064.00	0.11
196	603095	越剑智能	25,900	425,537.00	0.11
197	601003	柳钢股份	119,800	421,696.00	0.11
198	600880	博瑞传播	78,800	421,580.00	0.11
199	000027	深圳能源	65,400	417,252.00	0.11
200	000050	深天马 A	48,900	416,628.00	0.11
201	301511	德福科技	19,900	411,930.00	0.11
202	601998	中信银行	48,300	410,550.00	0.11
203	002666	德联集团	80,300	408,727.00	0.11
204	603313	梦百合	47,700	405,450.00	0.11
205	002793	罗欣药业	86,400	400,896.00	0.11
206	002683	广东宏大	11,800	400,492.00	0.11
207	300769	德方纳米	12,100	399,542.00	0.10
208	600084	中信尼雅	70,300	390,868.00	0.10
209	301489	思泉新材	6,740	387,482.60	0.10
210	300994	久祺股份	24,400	381,616.00	0.10
211	301028	东亚机械	30,800	378,532.00	0.10
212	688519	南亚新材	8,400	376,320.00	0.10
213	300731	科创新源	12,400	374,108.00	0.10
214	301270	汉仪股份	7,700	366,982.00	0.10
215	603267	鸿远电子	7,300	366,971.00	0.10
216	601288	农业银行	62,400	366,912.00	0.10
217	600160	巨化股份	12,700	364,236.00	0.10
218	600547	山东黄金	11,400	364,002.00	0.10
219	603270	金帝股份	13,700	351,953.00	0.09
220	600961	株冶集团	30,700	343,226.00	0.09
221	603588	高能环境	60,700	342,348.00	0.09
222	000819	岳阳兴长	21,800	341,170.00	0.09
223	603109	神驰机电	12,000	335,280.00	0.09
224	603565	中谷物流	34,700	331,385.00	0.09
225	300435	中泰股份	21,800	330,924.00	0.09
226	600011	华能国际	46,100	329,154.00	0.09
227	600226	亨通股份	117,100	326,709.00	0.09

228	300048	合康新能	55,200	324,024.00	0.08
229	601601	中国太保	8,600	322,586.00	0.08
230	603788	宁波高发	20,000	317,400.00	0.08
231	600098	广州发展	50,400	315,000.00	0.08
232	603659	璞泰来	16,700	313,626.00	0.08
233	603499	翔港科技	18,880	311,331.20	0.08
234	600728	佳都科技	57,000	310,650.00	0.08
235	301120	新特电气	30,100	308,224.00	0.08
236	002755	奥赛康	19,200	306,816.00	0.08
237	688009	中国通号	59,220	304,390.80	0.08
238	002142	宁波银行	10,400	284,544.00	0.07
239	603520	司太立	28,900	283,220.00	0.07
240	688602	康鹏科技	33,400	279,892.00	0.07
241	601899	紫金矿业	14,300	278,850.00	0.07
242	002375	亚厦股份	70,700	272,195.00	0.07
243	300755	华致酒行	13,900	268,270.00	0.07
244	600685	中船防务	9,800	266,462.00	0.07
245	600926	杭州银行	15,800	265,756.00	0.07
246	300347	泰格医药	4,900	261,268.00	0.07
247	300197	节能铁汉	125,000	261,250.00	0.07
248	603379	三美股份	5,400	259,848.00	0.07
249	300499	高澜股份	14,400	256,320.00	0.07
250	603689	皖天然气	30,400	255,968.00	0.07
251	300648	星云股份	7,400	255,744.00	0.07
252	600428	中远海特	40,900	255,625.00	0.07
253	603380	易德龙	9,600	255,360.00	0.07
254	300244	迪安诊断	16,500	245,850.00	0.06
255	002328	新朋股份	42,100	245,022.00	0.06
256	601211	国泰海通	12,700	243,332.00	0.06
257	002637	赞宇科技	24,200	241,516.00	0.06
258	300980	祥源新材	10,300	241,226.00	0.06
259	600335	国机汽车	37,100	239,295.00	0.06
260	600710	苏美达	24,800	238,328.00	0.06
261	002603	以岭药业	16,800	236,880.00	0.06
262	301183	东田微	4,500	230,535.00	0.06
263	603063	禾望电气	6,700	226,862.00	0.06
264	603408	建霖家居	20,600	225,982.00	0.06
265	000831	中国稀土	6,200	223,944.00	0.06
266	002155	湖南黄金	12,530	223,660.50	0.06
267	603665	康隆达	9,000	223,020.00	0.06
268	000935	四川双马	12,200	222,284.00	0.06
269	300871	回盛生物	10,600	221,540.00	0.06
270	300138	晨光生物	18,200	220,584.00	0.06

271	600035	楚天高速	51,600	218,784.00	0.06
272	600475	华光环能	20,900	217,778.00	0.06
273	002500	山西证券	37,100	216,664.00	0.06
274	301128	强瑞技术	4,260	216,493.20	0.06
275	601002	晋亿实业	43,700	215,441.00	0.06
276	002452	长高电新	30,900	214,755.00	0.06
277	002626	金达威	10,400	212,784.00	0.06
278	600315	上海家化	10,000	210,700.00	0.06
279	300306	远方信息	16,100	208,012.00	0.05
280	688322	奥比中光	3,500	206,535.00	0.05
281	301029	怡合达	9,000	205,740.00	0.05
282	603386	骏亚科技	16,100	203,665.00	0.05
283	002019	亿帆医药	15,600	202,644.00	0.05
284	605080	浙江自然	7,200	200,160.00	0.05
285	688257	新锐股份	13,620	199,533.00	0.05
286	603103	横店影视	12,100	194,205.00	0.05
287	002659	凯文教育	38,300	193,032.00	0.05
288	600875	东方电气	11,500	192,510.00	0.05
289	603486	科沃斯	3,300	192,159.00	0.05
290	601958	金钼股份	17,500	191,450.00	0.05
291	300187	永清环保	37,500	191,250.00	0.05
292	601609	金田股份	26,500	185,765.00	0.05
293	002107	沃华医药	32,400	185,328.00	0.05
294	601083	锦江航运	16,600	184,426.00	0.05
295	300553	集智股份	4,440	183,949.20	0.05
296	603699	纽威股份	5,900	183,903.00	0.05
297	603225	新凤鸣	17,000	181,050.00	0.05
298	002293	罗莱生活	20,700	180,918.00	0.05
299	301365	矩阵股份	10,450	179,113.00	0.05
300	002585	双星新材	32,800	179,088.00	0.05
301	000338	潍柴动力	11,600	178,408.00	0.05
302	603527	众源新材	16,100	175,007.00	0.05
303	600819	耀皮玻璃	29,600	172,272.00	0.05
304	600674	川投能源	10,700	171,628.00	0.05
305	600012	皖通高速	10,100	171,498.00	0.04
306	600429	三元股份	37,900	170,929.00	0.04
307	605088	冠盛股份	4,500	170,640.00	0.04
308	000708	中信特钢	14,500	170,520.00	0.04
309	600757	长江传媒	18,300	169,824.00	0.04
310	603477	巨星农牧	8,200	168,756.00	0.04
311	688177	百奥泰	6,700	167,902.00	0.04
312	002938	鹏鼎控股	5,200	166,556.00	0.04
313	603228	景旺电子	3,900	163,176.00	0.04

314	300395	菲利华	3,100	158,410.00	0.04
315	605196	华通线缆	8,900	156,729.00	0.04
316	601801	皖新传媒	22,900	156,407.00	0.04
317	002638	勤上股份	59,300	155,959.00	0.04
318	002414	高德红外	15,200	155,800.00	0.04
319	300573	兴齐眼药	3,000	155,370.00	0.04
320	600933	爱柯迪	9,500	152,095.00	0.04
321	000729	燕京啤酒	11,700	151,281.00	0.04
322	601989	中国重工	32,300	149,872.00	0.04
323	002153	石基信息	16,900	146,354.00	0.04
324	301286	侨源股份	5,800	144,942.00	0.04
325	001914	招商积余	11,700	144,729.00	0.04
326	300247	融捷健康	37,100	144,690.00	0.04
327	688048	长光华芯	2,500	144,350.00	0.04
328	300416	苏试试验	9,900	141,867.00	0.04
329	600299	安迪苏	14,700	141,855.00	0.04
330	600988	赤峰黄金	5,700	141,816.00	0.04
331	300479	神思电子	6,300	139,041.00	0.04
332	601229	上海银行	13,100	138,991.00	0.04
333	600337	美克家居	62,500	138,125.00	0.04
334	300286	安科瑞	6,100	137,677.00	0.04
335	600867	通化东宝	16,500	135,300.00	0.04
336	601066	中信建投	5,600	134,680.00	0.04
337	600771	广誉远	6,500	131,040.00	0.03
338	605589	圣泉集团	4,600	127,650.00	0.03
339	603612	索通发展	6,900	126,822.00	0.03
340	688195	腾景科技	2,736	123,120.00	0.03
341	300984	金沃股份	2,140	122,515.00	0.03
342	600681	百川能源	34,900	122,499.00	0.03
343	603085	天成自控	10,600	122,006.00	0.03
344	002284	亚太股份	11,000	121,550.00	0.03
345	002373	千方科技	13,000	120,900.00	0.03
346	002487	大金重工	3,600	118,440.00	0.03
347	300733	西菱动力	6,600	117,018.00	0.03
348	601886	江河集团	19,000	116,850.00	0.03
349	000959	首钢股份	34,300	116,620.00	0.03
350	601168	西部矿业	7,000	116,410.00	0.03
351	000928	中钢国际	18,400	115,552.00	0.03
352	300620	光库科技	2,400	113,064.00	0.03
353	688070	纵横股份	2,300	111,090.00	0.03
354	601688	华泰证券	6,200	110,422.00	0.03
355	300611	美力科技	4,500	104,805.00	0.03
356	688062	迈威生物	3,700	104,636.00	0.03

357	688499	利元亨	2,500	104,025.00	0.03
358	603309	维力医疗	7,900	100,488.00	0.03
359	600621	华鑫股份	6,500	99,515.00	0.03
360	688158	优刻得	4,300	97,266.00	0.03
361	000657	中钨高新	8,200	97,252.00	0.03
362	688202	美迪西	2,700	97,011.00	0.03
363	600469	风神股份	17,000	96,050.00	0.03
364	600817	宇通重工	8,100	95,904.00	0.03
365	600548	深高速	9,100	95,277.00	0.02
366	688133	泰坦科技	4,032	92,816.64	0.02
367	003000	劲仔食品	6,900	91,287.00	0.02
368	688636	智明达	2,651	89,577.29	0.02
369	002516	旷达科技	17,200	88,580.00	0.02
370	601117	中国化学	11,500	88,205.00	0.02
371	600419	天润乳业	8,900	87,932.00	0.02
372	300624	万兴科技	1,400	86,870.00	0.02
373	300238	冠昊生物	5,300	86,019.00	0.02
374	600968	海油发展	20,900	85,272.00	0.02
375	000733	振华科技	1,700	85,085.00	0.02
376	300231	银信科技	6,900	84,939.00	0.02
377	002039	黔源电力	5,300	84,164.00	0.02
378	000001	平安银行	6,900	83,283.00	0.02
379	605580	恒盛能源	6,100	82,899.00	0.02
380	688371	菲沃泰	4,928	81,607.68	0.02
381	300011	鼎汉技术	10,900	81,423.00	0.02
382	002649	博彦科技	5,600	81,368.00	0.02
383	000598	兴蓉环境	11,100	80,031.00	0.02
384	601901	方正证券	10,000	79,100.00	0.02
385	300768	迪普科技	4,600	78,890.00	0.02
386	688472	阿特斯	8,402	76,878.30	0.02
387	000425	徐工机械	9,700	75,369.00	0.02
388	688512	慧智微	6,900	75,279.00	0.02
389	688049	炬芯科技	1,232	74,536.00	0.02
390	002959	小熊电器	1,600	74,304.00	0.02
391	600064	南京高科	9,500	73,245.00	0.02
392	600338	西藏珠峰	6,600	73,194.00	0.02
393	600773	西藏城投	7,100	71,426.00	0.02
394	600496	精工钢构	22,200	71,040.00	0.02
395	300418	昆仑万维	2,100	70,623.00	0.02
396	600488	津药药业	16,200	67,554.00	0.02
397	300570	太辰光	700	67,466.00	0.02
398	000967	盈峰环境	9,600	66,720.00	0.02
399	300445	康斯特	3,800	64,790.00	0.02

400	300014	亿纬锂能	1,400	64,134.00	0.02
401	600352	浙江龙盛	6,100	61,976.00	0.02
402	000725	京东方 A	15,300	61,047.00	0.02
403	600350	山东高速	5,700	60,762.00	0.02
404	600928	西安银行	15,500	60,760.00	0.02
405	301200	大族数控	1,400	59,458.00	0.02
406	000672	上峰水泥	7,260	57,354.00	0.02
407	000166	申万宏源	11,400	57,228.00	0.02
408	605050	福然德	4,100	56,375.00	0.01
409	600391	航发科技	1,900	55,480.00	0.01
410	300291	百纳千成	9,600	54,816.00	0.01
411	002815	崇达技术	4,800	54,384.00	0.01
412	600246	万通发展	8,900	54,379.00	0.01
413	688197	首药控股	1,500	54,300.00	0.01
414	601225	陕西煤业	2,800	53,872.00	0.01
415	601628	中国人寿	1,300	53,547.00	0.01
416	002020	京新药业	4,100	53,505.00	0.01
417	603456	九洲药业	3,500	53,235.00	0.01
418	688787	海天瑞声	500	53,090.00	0.01
419	001389	广合科技	900	52,893.00	0.01
420	601328	交通银行	6,600	52,800.00	0.01
421	000913	钱江摩托	3,500	52,500.00	0.01
422	000061	农产品	8,200	52,398.00	0.01
423	000531	穗恒运 A	8,300	51,045.00	0.01
424	300317	珈伟新能	12,300	50,922.00	0.01
425	688496	清越科技	5,472	50,889.60	0.01
426	300655	晶瑞电材	5,000	50,050.00	0.01
427	002545	东方铁塔	5,500	48,895.00	0.01
428	603529	爱玛科技	1,400	48,160.00	0.01
429	301510	固高科技	1,600	48,080.00	0.01
430	601577	长沙银行	4,800	47,712.00	0.01
431	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
432	688429	时创能源	3,198	46,498.92	0.01
433	301339	通行宝	2,600	44,538.00	0.01
434	688775	影石创新	357	44,325.12	0.01
435	300702	天宇股份	1,900	44,194.00	0.01
436	600637	东方明珠	5,900	44,073.00	0.01
437	688221	前沿生物	4,300	43,172.00	0.01
438	000042	中洲控股	6,000	42,660.00	0.01
439	600348	华阳股份	6,200	41,292.00	0.01
440	600143	金发科技	4,000	41,240.00	0.01
441	601096	宏盛华源	9,800	40,572.00	0.01
442	300476	胜宏科技	300	40,314.00	0.01

443	002318	久立特材	1,700	39,763.00	0.01
444	600716	凤凰股份	10,700	39,590.00	0.01
445	600184	光电股份	2,200	38,632.00	0.01
446	002463	沪电股份	900	38,322.00	0.01
447	600188	兖矿能源	3,100	37,727.00	0.01
448	603885	吉祥航空	2,800	37,716.00	0.01
449	002060	广东建工	10,800	37,584.00	0.01
450	300019	硅宝科技	1,900	37,506.00	0.01
451	603230	内蒙新华	2,900	37,439.00	0.01
452	300879	大叶股份	900	35,352.00	0.01
453	600298	安琪酵母	1,000	35,170.00	0.01
454	600004	白云机场	3,800	34,580.00	0.01
455	300111	向日葵	10,400	34,112.00	0.01
456	002405	四维图新	3,900	33,306.00	0.01
457	002445	中南文化	12,600	32,130.00	0.01
458	688552	航天南湖	800	31,928.00	0.01
459	002267	陕天然气	4,200	31,794.00	0.01
460	002478	常宝股份	6,000	31,500.00	0.01
461	600030	XD 中信证	1,100	30,382.00	0.01
462	600027	华电国际	5,500	30,085.00	0.01
463	600233	圆通速递	2,300	29,647.00	0.01
464	688141	杰华特	900	29,322.00	0.01
465	688629	华丰科技	500	28,600.00	0.01
466	688716	中研股份	800	28,480.00	0.01
467	002258	利尔化学	2,500	27,600.00	0.01
468	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
469	000688	国城矿业	2,000	26,620.00	0.01
470	603697	有友食品	2,000	26,380.00	0.01
471	600983	惠而浦	2,500	25,950.00	0.01
472	603889	新澳股份	4,300	24,940.00	0.01
473	300752	隆利科技	1,100	24,728.00	0.01
474	300249	依米康	1,800	24,552.00	0.01
475	002324	普利特	2,300	24,449.00	0.01
476	000551	创元科技	1,800	23,130.00	0.01
477	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
478	300781	因赛集团	400	21,648.00	0.01
479	603197	保隆科技	500	19,535.00	0.01
480	300133	华策影视	2,500	18,775.00	0.00
481	301277	新天地	1,289	18,522.93	0.00
482	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
483	300772	运达股份	1,400	18,032.00	0.00
484	688112	鼎阳科技	480	17,745.60	0.00
485	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00

486	600305	恒顺醋业	2,200	17,006.00	0.00
487	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
488	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
489	688280	精进电动	2,166	15,746.82	0.00
490	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
491	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
492	688302	海创药业	300	14,040.00	0.00
493	000750	国海证券	3,400	14,008.00	0.00
494	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.00
495	600115	中国东航	3,400	13,702.00	0.00
496	600380	健康元	1,200	13,236.00	0.00
497	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
498	301550	斯菱股份	145	12,947.05	0.00
499	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
500	000791	甘肃能源	1,900	12,122.00	0.00
501	601579	会稽山	600	11,946.00	0.00
502	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
503	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.00
504	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
505	688117	圣诺生物	340	11,441.00	0.00
506	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
507	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
508	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
509	300905	宝丽迪	300	9,585.00	0.00
510	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
511	603049	中策橡胶	201	8,612.85	0.00
512	002399	海普瑞	700	8,337.00	0.00
513	688182	灿勤科技	300	8,268.00	0.00
514	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
515	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
516	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
517	601311	骆驼股份	800	7,224.00	0.00
518	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
519	001359	平安电工	184	6,417.92	0.00
520	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
521	600061	国投资本	800	6,016.00	0.00
522	603202	天有为	65	5,892.90	0.00
523	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
524	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
525	301373	凌玮科技	176	5,151.52	0.00
526	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
527	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
528	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00

529	600025	华能水电	400	3,820.00	0.00
530	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
531	603409	XD 汇通控	100	3,332.00	0.00
532	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
533	603737	三棵树	80	2,948.00	0.00
534	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
535	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
536	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
537	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
538	600694	大商股份	73	1,354.15	0.00
539	301376	致欧科技	26	474.50	0.00
540	000039	中集集团	18	141.48	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	002624	完美世界	12,604,798.00	2.61
2	002335	科华数据	10,241,848.00	2.12
3	300369	绿盟科技	9,279,536.00	1.92
4	000893	亚钾国际	8,690,065.00	1.80
5	000830	鲁西化工	8,528,227.00	1.76
6	002080	中材科技	8,247,913.00	1.71
7	002299	圣农发展	8,116,725.00	1.68
8	000938	紫光股份	8,112,625.00	1.68
9	000792	盐湖股份	7,490,805.00	1.55
10	002170	芭田股份	7,420,418.00	1.53
11	300638	广和通	7,263,673.00	1.50
12	603225	新凤鸣	7,099,547.00	1.47
13	002851	麦格米特	6,971,919.00	1.44
14	300752	隆利科技	6,889,447.00	1.42
15	600673	东阳光	6,617,118.00	1.37
16	600428	中远海特	6,546,158.00	1.35
17	000553	安道麦 A	6,480,886.00	1.34
18	600499	科达制造	6,368,529.00	1.32
19	300400	劲拓股份	6,368,103.00	1.32
20	600060	海信视像	6,243,685.40	1.29

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002335	科华数据	12,237,960.00	2.53
2	000893	亚钾国际	10,860,303.00	2.25
3	002624	完美世界	10,494,228.00	2.17
4	002851	麦格米特	8,611,480.00	1.78
5	000938	紫光股份	8,397,365.00	1.74
6	000830	鲁西化工	8,167,233.00	1.69
7	300203	聚光科技	7,834,876.00	1.62
8	300638	广和通	7,816,149.46	1.62
9	002170	芭田股份	7,649,273.00	1.58
10	000792	盐湖股份	7,531,731.00	1.56
11	300752	隆利科技	7,005,600.00	1.45
12	002299	圣农发展	6,885,158.00	1.42
13	603225	新凤鸣	6,846,181.00	1.42
14	600428	中远海特	6,581,948.00	1.36
15	300251	光线传媒	6,521,139.00	1.35
16	300624	万兴科技	6,184,735.10	1.28
17	002080	中材科技	6,155,875.00	1.27
18	688289	圣湘生物	5,947,881.81	1.23
19	000600	建投能源	5,908,216.00	1.22
20	600060	海信视像	5,901,401.95	1.22

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,181,547,122.94
卖出股票收入（成交）总额	2,325,520,502.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	140,817.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,021,921.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,162,739.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧金安量化混合 A	3,157	98,824.82	4,434,248.62	1.42%	307,555,700.95	98.58%
中欧金安量化混合 C	492	94,493.57	1,026,272.58	2.21%	45,464,565.31	97.79%
合计	3,649	98,240.83	5,460,521.20	1.52%	353,020,266.26	98.48%

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	中欧金安量化混合 A	10.00	0.00%
	中欧金安量化混合 C	0.00	0.00%
	合计	10.00	0.00%

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	中欧金安量化混合 A	0
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧金安量化混合 A	0
	中欧金安量化混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧金安量化混合 A	中欧金安量化混合 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 20 日) 基金份额总额	893,269,013.78	139,571,239.72
本报告期期初基金份额总额	458,725,662.99	56,635,968.97
本报告期基金总申购份额	45,751,449.64	14,087,528.15
减：本报告期基金总赎回份额	192,487,163.06	24,232,659.23
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	311,989,949.57	46,490,837.89

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未因托管业务受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
中国中金财富证券	3	4,504,783,569.26	99.99	837,691.92	99.97	-
国金证券	3	503,328.64	0.01	219.33	0.03	-

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。

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	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 (%)		(%)		的比例 (%)
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18
2	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧金安量化混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
7	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
8	中欧金安量化混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2025-04-03
9	中欧金安量化混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2025-04-03
10	中欧金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-04-03
11	中欧金安量化混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基	中国证监会指定媒介	2025-04-22

	金 2025 年第一季度报告的提示性公告		
13	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-03
14	中欧基金安量化混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-06-03
15	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日