

中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行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	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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60

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.....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金		
基金简称	中欧中证 A500 指数发起		
基金主代码	022432		
基金运作方式	契约型、开放式、发起式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 4 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,793,889,983.99 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
下属分级基金的交易代码	022432	022433	022898
报告期末下属分级基金的份额总额	511,677,644.75 份	1,270,986,566.75 份	11,225,772.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（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。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中欧基金管理有限公司		中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	滕菲菲
	联系电话	021-68609600	4006800000
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700		95558
传真	021-50190017		010-85230024
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层		北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层		北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120		100020
法定代表人	窦玉明		方合英

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)		
	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
本期已实现收益	3,350,188.73	6,583,829.71	83,137.21
本期利润	9,436,387.17	16,280,605.16	339,618.27
加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0118	0.0349
本期加权平	1.67%	1.21%	3.57%

均 净 值 利 润 率			
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	1. 49%	1. 37%	1. 65%
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	1, 556, 433. 46	1, 789, 323. 51	53, 923. 10
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0. 0030	0. 0014	0. 0048
期 末 基 金 资 产 净 值	513, 234, 078. 21	1, 272, 775, 890. 26	11, 279, 695. 59
期 末 基 金 份 额 净 值	1. 0030	1. 0014	1. 0048
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	0. 30%	0. 14%	0. 89%

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

中欧中证 A500 指数发起 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	3. 38%	0. 57%	2. 68%	0. 57%	0. 70%	0. 00%

过去三个月	1.79%	1.14%	0.83%	1.14%	0.96%	0.00%
过去六个月	1.49%	1.05%	0.49%	1.05%	1.00%	0.00%
自基金合同生效起 至今	0.30%	0.96%	0.74%	1.07%	-0.44%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 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。

中欧中证 A500 指数发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.36%	0.57%	2.68%	0.57%	0.68%	0.00%
过去三个月	1.73%	1.14%	0.83%	1.14%	0.90%	0.00%
过去六个月	1.37%	1.05%	0.49%	1.05%	0.88%	0.00%
自基金合同生效起 至今	0.14%	0.96%	0.74%	1.07%	-0.60%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 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。

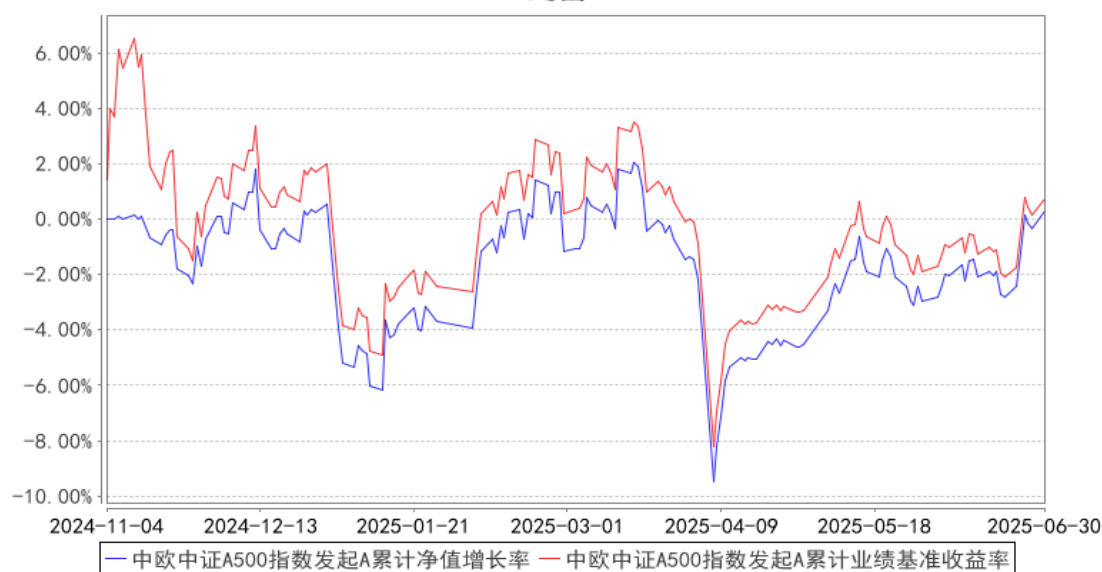
中欧中证 A500 指数发起 Y

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	3.42%	0.57%	2.68%	0.57%	0.74%	0.00%
过去三个月	1.87%	1.14%	0.83%	1.14%	1.04%	0.00%
过去六个月	1.65%	1.05%	0.49%	1.05%	1.16%	0.00%
自基金份额起始运 作日至今	0.89%	1.02%	-0.35%	1.02%	1.24%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 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。

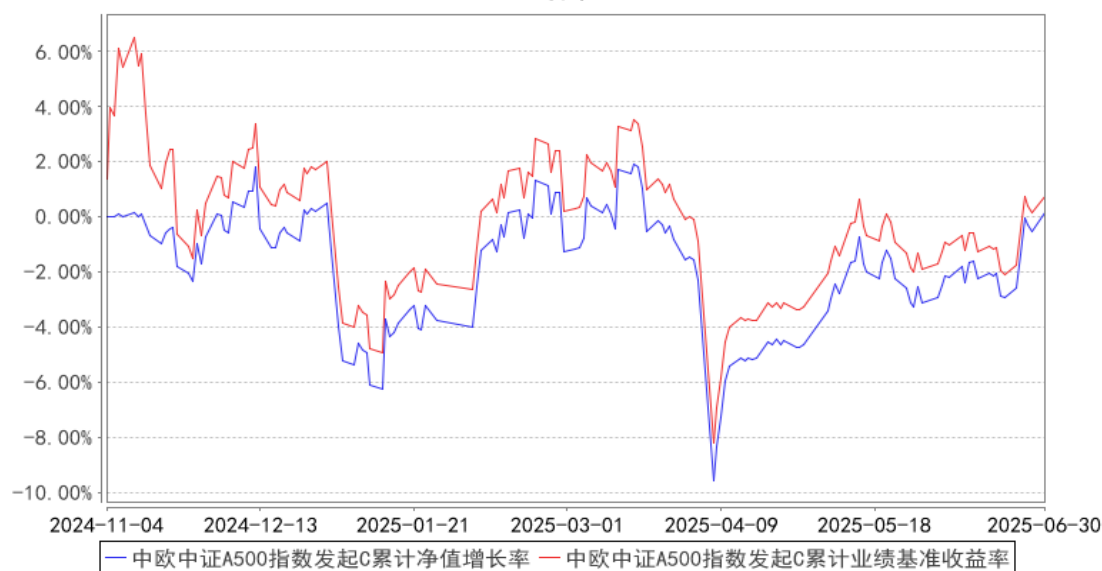
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧中证A500指数发起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



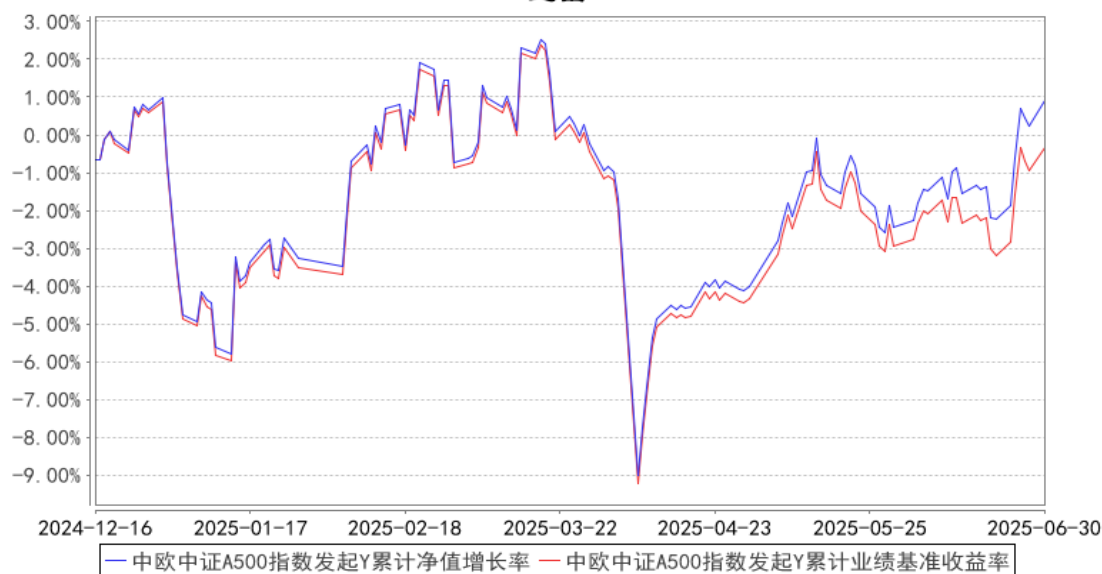
注：本基金基金合同生效日期为 2024 年 11 月 4 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧中证A500指数发起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 2024 年 11 月 4 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，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。

中欧中证A500指数发起Y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：本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额，图示日期为 2024 年 12 月 16 日至 2025 年 06 月 30 日。

§ 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		
宋巍巍	基金经理	2024-11-04	—	8 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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 年上半年，A 股市场整体震荡上行，中证 A500 指数上半年微幅上涨 0.47%。A 股走出了自 2021 年下半年至 2023 年年底的熊市行情。2025 年上半年虽然经历美国关税摩擦冲击，A 股短暂下跌之后强势反转。展望下半年，随着美联储再次降息临近，国内货币和财政政策发力，供给侧“反内卷”行业政策推进，国内资本市场将先于经济基本面企稳上涨。

一季度，A 股市场整体前低后高。1 月公布的 2024 年国内 GDP 增速达 5.0%，较去年四季度同比增长 5.4%，显著增强了市场对经济韧性的信心。以人工智能为代表的新质生产力领域持续取得突破，1 月 20 日，DeepSeek 发布开源推理模型 DeepSeek-R1，1 月 26 日其应用登顶手机应用商店免费榜单，标志着中国在大模型领域实现重大技术突破。1 月 28 日，人形机器人亮相央视春晚，

科技成果实现“破圈”传播。节后，国产大模型与人形机器人的快速进展引发全球投资者关注，中国科技资产迎来价值重估。国际投行纷纷上调中概股评级，反映出全球资本对中国资产估值及配置的战略重视。

三月上旬，全国两会顺利召开，政府工作报告中提出“大力提振消费、提高投资效益、全方位扩大国内需求”，进一步强化市场对宏观经济稳步复苏的预期。同时，地方层面政策亦积极落地，3月13日，呼和浩特推出生育补贴政策，消费刺激措施逐步覆盖基础民生领域，政策托底效应持续显现。但三月下旬，受美国关税政策不确定性及财报季临近等因素影响，市场再度回调，结构性分化加剧，指数面临一定调整压力。

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。从月度表现看，4月受地缘贸易摩擦风险升级影响，市场明显承压；5月政策发力与中美谈判缓和带动指数反弹；6月则在外部扰动与风险缓释中维持震荡偏强格局。

4月，美国加征对等关税幅度超预期，全球资本市场剧烈波动，A500指数同步回调。中央汇金于4月8日发布公告，通过增持ETF等举措托底市场，中央及各部委协同发声稳定预期，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升温，指数延续回升态势。

5月，内需政策集中发力，中美摩擦缓和。5月7日，三部门发布“一揽子金融政策”，包括全面降准降息、稳股市稳地产等组合拳，显著提振市场信心。5月12日，中美在日内瓦达成重要经贸共识，宣布下调双边关税，驱动主要指数快速上涨。月末，受外部不确定性升温及基本面空窗期影响，市场风险偏好收缩，交投活跃度下降。

6月，月初受中美经贸谈判进展不确定性、中东地缘冲突等影响，市场整体低波动、低成交。下旬，地缘冲突缓解，美联储降息预期升温，投资者风险偏好回升，上证指数突破3400点关口。

在投资策略方面，本基金作为跟踪中证A500的场外指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪业绩比较基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩比较基准相似的投资收益。

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1.49%，同期业绩比较基准收益率为0.49%；基金C类份额净值增长率为1.37%，同期业绩比较基准收益率为0.49%；基金Y类份额净值增长率为1.65%，同期业绩比较基准收益率为0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美元潮汐是资本市场最大的变化。未来美国再次降息将推动美元资本重回国内

资本市场，这部分资金是国内资本市场再上新台阶的重要推动力。今年以来，美联储连续五次议息会议保持基准利率不变，资本市场从预期年内 5 次降息到 2 次降息，从判断 9 月降息，到预计 12 月可能降息。美联储自 2024 年 9 月 18 日之后的再次降息仅是时间问题，窗口期大概率在今年下半年。

回归国内，虽然美国关税将拖累我国整体的出口增速，但在逆周期的经济政策下，消费和基建投资将成为我国“稳增长”的抓手。制造业投资趋稳，房地产投资下降对国内经济拖累边际减弱。今年财政政策靠前发力，上半年全国广义财政支出近 18.8 万亿元，创下历史新高，同比增长约 8.9%，明显高于上半年 5.3% 的经济增速。在一系列稳增长的政策呵护下，全年 GDP 增速将保持 5% 以上。

此外，人民日报 6 月 29 日头版文章《在破除“内卷式”竞争中实现高质量发展》指出，“要深化要素市场化配置改革，主动破除地方保护、市场分割和‘内卷式’竞争”。2025 年 7 月 24 日，国家发展改革委、市场监管总局研究起草了《中华人民共和国价格法修正草案（征求意见稿）》，反内卷政策和价格法的修改将深刻改变未来的国内周期品价格持续下跌、无序竞争的问题，推动国内 PPI 上行。

当前资本市场流动性环境充裕，十年期国债收益率仅 1.7%，在“资产荒”的背景下，权益资产的配置性价比凸显。在美国降息周期持续，国内经济基本面持续复苏，外需利空落地的背景下，国内权益资产和对应宽基指数仍旧具有较大的上行空间。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2025 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中欧基金管理有限公司在中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为中欧基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2025 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

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	24,904,043.19	119,795,269.27
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,781,982,628.78	1,987,063,116.34
其中：股票投资		1,702,222,118.89	1,987,063,116.34
基金投资		-	-
债券投资		79,760,509.89	-
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		1,854,146.92	24,137,865.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,808,740,818.89	2,130,996,250.62
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		10,137,782.19	22,792,603.71
应付管理人报酬		746,241.44	938,465.47
应付托管费		149,248.29	187,693.12
应付销售服务费		265,805.53	328,983.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	152,077.38	10,969.54
负债合计		11,451,154.83	24,258,719.25
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	1,793,889,983.99	2,132,289,949.01
未分配利润	6.4.7.8	3,399,680.07	-25,552,417.64
净资产合计		1,797,289,664.06	2,106,737,531.37
负债和净资产总计		1,808,740,818.89	2,130,996,250.62

注： 1. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,793,889,983.99 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0030 元，基金份额总额 511,677,644.75 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0014 元，基金份额总额 1,270,986,566.75 份；下属 Y 类基金份额净值为人民币 1.0048 元，基金份额总额 11,225,772.49 份。

2. 本基金基金合同于 2024 年 11 月 04 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		33,556,396.84
1. 利息收入		45,068.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	45,068.30
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）		17,421,836.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,981,500.65
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	441,360.99
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	21,961,976.36
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	16,039,454.95
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	50,036.89
减：二、营业总支出		7,499,786.24
1. 管理人报酬		4,769,011.31
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费		953,802.20

3. 销售服务费		1,677,232.83
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		-
8. 其他费用	6.4.7.18	99,739.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,056,610.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,056,610.60
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		26,056,610.60

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

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	2,132,289,949.01	-	-25,552,417.64	2,106,737,531.37
二、本期期初净资产	2,132,289,949.01	-	-25,552,417.64	2,106,737,531.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-338,399,965.02	-	28,952,097.71	-309,447,867.31
（一）、综合收益总额	-	-	26,056,610.60	26,056,610.60
（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）	-338,399,965.02	-	2,895,487.11	-335,504,477.91
其中：1. 基金申购款	677,969,165.10	-	-7,948,056.67	670,021,108.43
2. 基金赎回款	-1,016,369,130.12	-	10,843,543.78	-1,005,525,586.34
（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	1,793,889,983.99	-	3,399,680.07	1,797,289,664.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平
基金管理人负责人

王音然
主管会计工作负责人

李宝林
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金（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[2024]1446 号文《关于准予中欧中证 A500 指数发起式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《中欧中证 A500 指数发起式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发起式基金，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 2,387,904,914.68 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70028871_B20 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 4 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 2,388,326,014.99 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 421,100.31 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 682,964,211.94 份，包含认购利息折合 112,441.47 份；C 类基金的基金份额总额为 1,705,361,803.05 份，包含认购利息折合 308,658.84 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。基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定，为满足投资者的理财需求，经征托管人中信银行股份有限公司同意并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2024 年 12 月 13 日起增加本基金的场外 Y 类基金份额类别并相应修改基金合同、托管协议。本基金在现有份额的基础上增加 Y 类基金份额。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（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）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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。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。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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的有关过去事项、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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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、且经济利益的流入金额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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 A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金 Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；基金份额持有人选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

(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) 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，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。

6.4.4.12 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。

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	10,223.88
等于：本金	10,000.00
加：应计利息	223.88
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	24,893,819.31
等于：本金	24,892,620.04
加：应计利息	1,199.27
减：坏账准备	-
合计	24,904,043.19

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		1,712,097,896.08	-	1,702,222,118.89	-9,875,777.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	79,749,600.00	16,509.89	79,760,509.89	-5,600.00
	合计	79,749,600.00	16,509.89	79,760,509.89	-5,600.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,791,847,496.08	16,509.89	1,781,982,628.78	-9,881,377.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	350.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	350.00
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	47,017.67
预提费用-审计费	45,202.07
应付补差费	0.27
合计	152,077.38

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 A500 指数发起 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	652,100,869.91	652,100,869.91
本期申购	54,328,355.50	54,328,355.50
本期赎回（以“-”号填列）	-194,751,580.66	-194,751,580.66
本期末	511,677,644.75	511,677,644.75

中欧中证 A500 指数发起 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	1,476,541,865.17	1,476,541,865.17
本期申购	614,488,381.87	614,488,381.87
本期赎回（以“-”号填列）	-820,043,680.29	-820,043,680.29

本期末	1,270,986,566.75	1,270,986,566.75
-----	------------------	------------------

中欧中证 A500 指数发起 Y

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	3,647,213.93	3,647,213.93
本期申购	9,152,427.73	9,152,427.73
本期赎回（以“-”号填列）	-1,573,869.17	-1,573,869.17
本期末	11,225,772.49	11,225,772.49

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同于 2024 年 11 月 04 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,388,326,014.99 份基金份额，其中认购资金利息折合 421,100.31 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证 A500 指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,075,276.97	-8,715,700.92	-7,640,423.95
本期期初	1,075,276.97	-8,715,700.92	-7,640,423.95
本期利润	3,350,188.73	6,086,198.44	9,436,387.17
本期基金份额交易产生的变动数	-332,608.84	93,079.08	-239,529.76
其中：基金申购款	114,644.35	-1,475,209.22	-1,360,564.87
基金赎回款	-447,253.19	1,568,288.30	1,121,035.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,092,856.86	-2,536,423.40	1,556,433.46

中欧中证 A500 指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,859,202.85	-19,729,363.50	-17,870,160.65
本期期初	1,859,202.85	-19,729,363.50	-17,870,160.65
本期利润	6,583,829.71	9,696,775.45	16,280,605.16
本期基金份额交易产生的变动数	-321,053.96	3,699,932.96	3,378,879.00
其中：基金申购款	836,140.47	-7,158,912.15	-6,322,771.68
基金赎回款	-1,157,194.43	10,858,845.11	9,701,650.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,121,978.60	-6,332,655.09	1,789,323.51

中欧中证 A500 指数发起 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,923.08	-48,756.12	-41,833.04
本期期初	6,923.08	-48,756.12	-41,833.04
本期利润	83,137.21	256,481.06	339,618.27

本期基金份额交易产生的变动数	19,161.28	-263,023.41	-243,862.13
其中：基金申购款	24,409.65	-289,129.77	-264,720.12
基金赎回款	-5,248.37	26,106.36	20,857.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,221.57	-55,298.47	53,923.10

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	478.91
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	44,589.39
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	45,068.30

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	627,598,070.22
减：卖出股票成本总额	632,026,436.22
减：交易费用	553,134.65
买卖股票差价收入	-4,981,500.65

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	264,838.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	176,522.33
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	441,360.99

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	80,241,201.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,659,287.67
减：应计利息总额	405,041.10
减：交易费用	350.00
买卖债券差价收入	176,522.33

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

无。

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	21,961,976.36
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	21,961,976.36

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	16,039,454.95
股票投资	16,045,054.95
债券投资	-5,600.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动	—

产生的预估增值税	
合计	16,039,454.95

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	49,527.53
基金转换费收入	509.36
合计	50,036.89

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	34,232.53
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	6,000.00
合计	99,739.90

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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

无。

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

无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	4,769,011.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,189,779.73
应支付基金管理人的净管理费	2,579,231.58

注：1、本基金 A 类基金份额的年管理费率为 0.5%，本基金 C 类基金份额的年管理费率为 0.5%，本基金 Y 类基金份额的年管理费率为 0.25%。三类基金份额的管理费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额年管理费率}\div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金管理费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	953,802.20

注：本基金 A 类基金份额的年托管费率为 0.1%，本基金 C 类基金份额的年托管费率为 0.1%，本基金 Y 类基金份额的年托管费率为 0.05%。三类基金份额的托管费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额年托管费率}\div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金托管费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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			
	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y	合计
国都证券	-	8.99	-	8.99
中欧财富	-	1,412.64	-	1,412.64
中欧基金	-	145,312.34	-	145,312.34
中信银行	-	1,388,794.11	-	1,388,794.11
合计	-	1,535,528.08	-	1,535,528.08

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.25%，本基金 Y 类基金份额不收取销售服务费。计算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

中欧中证 A500 指数发起 A

份额单位：份

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 11 月 4 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.95%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

3、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 C 类基金份额、Y 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

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。

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	
	期末余额	当期利息收入

中信银行股份有限公司	10,223.88	478.91
------------	-----------	--------

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，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	-
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	C 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	C 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	-
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	-
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	724	33,666.00	31,023.40	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
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	166	15,521.00	15,049.56	-
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	-
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	-
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	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及

时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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	24,904,043.19	-	-	-	24,904,043.19
交易性金融资产	79,760,509.89	-	-	-1,702,222,118.89	1,781,982,628.78
应收申购款	-	-	-	1,854,146.92	1,854,146.92
资产总计	104,664,553.08	-	-	-1,704,076,265.81	1,808,740,818.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,137,782.19	10,137,782.19
应付管理人报酬	-	-	-	746,241.44	746,241.44
应付托管费	-	-	-	149,248.29	149,248.29
应付销售服务费	-	-	-	265,805.53	265,805.53
其他负债	-	-	-	152,077.38	152,077.38
负债总计	-	-	-	11,451,154.83	11,451,154.83
利率敏感度缺口	104,664,553.08	-	-	-1,692,625,110.98	1,797,289,664.06
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	119,795,269.27	-	-	-	119,795,269.27
交易性金融资产	-	-	-	-1,987,063,116.34	1,987,063,116.34
应收申购款	-	-	-	24,137,865.01	24,137,865.01
资产总计	119,795,269.27	-	-	-2,011,200,981.35	2,130,996,250.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,792,603.71	22,792,603.71
应付管理人报酬	-	-	-	938,465.47	938,465.47
应付托管费	-	-	-	187,693.12	187,693.12
应付销售服务费	-	-	-	328,983.75	328,983.75
应交税费	-	-	-	3.66	3.66
其他负债	-	-	-	10,969.54	10,969.54
负债总计	-	-	-	24,258,719.25	24,258,719.25
利率敏感度缺口	119,795,269.27	-	-	-1,986,942,262.10	2,106,737,531.37

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 4.44%（2024 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（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	1,702,222,118.89	94.71	1,987,063,116.34	94.32
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	1,702,222,118.89	94.71	1,987,063,116.34	94.32

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%	89,677,353.26	—
	业绩比较基准下降5%	-89,677,353.26	—

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	1,701,902,488.91	1,984,064,650.34

第二层次	79,775,895.43	2,998,466.00
第三层次	304,244.44	—
合计	1,781,982,628.78	1,987,063,116.34

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	1,702,222,118.89	94.11
	其中：股票	1,702,222,118.89	94.11
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	79,760,509.89	4.41
	其中：债券	79,760,509.89	4.41
	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	24,904,043.19	1.38
8	其他各项资产	1,854,146.92	0.10
9	合计	1,808,740,818.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,246,962.00	0.51
B	采矿业	85,898,183.00	4.78
C	制造业	988,765,518.48	55.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,427,066.00	2.92
E	建筑业	32,350,249.00	1.80
F	批发和零售业	12,055,760.00	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	59,405,383.00	3.31
H	住宿和餐饮业	1,460,400.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	113,385,938.99	6.31
J	金融业	273,411,065.00	15.21
K	房地产业	17,824,375.00	0.99
L	租赁和商务服务业	18,932,339.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	18,920,118.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	3,742,666.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,120,878.00	0.06
Q	卫生和社会工作	6,487,616.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	5,367,438.00	0.30
S	综合	—	—
	合计	1,700,801,955.47	94.63

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,401,092.92	0.08
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	2,244.00	0.00
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	-	-
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	16,826.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,420,163.42	0.08

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	46,500	65,542,680.00	3.65
2	300750	宁德时代	195,700	49,359,454.00	2.75
3	601318	XD 中国平	797,400	44,239,752.00	2.46
4	600036	招商银行	917,100	42,140,745.00	2.34
5	601166	兴业银行	1,231,400	28,740,876.00	1.60
6	600900	长江电力	906,400	27,318,896.00	1.52
7	000333	美的集团	364,500	26,316,900.00	1.46
8	601899	紫金矿业	1,220,000	23,790,000.00	1.32
9	002594	比亚迪	67,100	22,271,161.00	1.24
10	300059	东方财富	936,700	21,665,871.00	1.21
11	600030	中信证券	723,100	19,972,022.00	1.11
12	601398	工商银行	2,596,200	19,705,158.00	1.10
13	600276	恒瑞医药	330,900	17,173,710.00	0.96
14	000858	五 粮 液	143,800	17,097,820.00	0.95
15	000651	格力电器	332,000	14,913,440.00	0.83
16	601328	交通银行	1,805,400	14,443,200.00	0.80
17	601288	农业银行	2,366,600	13,915,608.00	0.77

18	600887	伊利股份	468,800	13,070,144.00	0.73
19	002475	立讯精密	375,900	13,039,971.00	0.73
20	688981	中芯国际	147,340	12,990,967.80	0.72
21	600919	江苏银行	1,087,300	12,982,362.00	0.72
22	603259	药明康德	185,200	12,880,660.00	0.72
23	601816	京沪高铁	2,173,800	12,499,350.00	0.70
24	600000	浦发银行	869,900	12,074,212.00	0.67
25	000725	京东方 A	2,722,400	10,862,376.00	0.60
26	002371	北方华创	23,700	10,480,377.00	0.58
27	300760	迈瑞医疗	44,900	10,091,275.00	0.56
28	601088	中国神华	244,500	9,912,030.00	0.55
29	688041	海光信息	68,887	9,733,044.23	0.54
30	300308	中际旭创	65,900	9,612,174.00	0.53
31	601601	中国太保	253,600	9,512,536.00	0.53
32	688256	寒武纪	15,560	9,359,340.00	0.52
33	300502	新易盛	73,500	9,335,970.00	0.52
34	300124	汇川技术	139,700	9,020,429.00	0.50
35	601728	中国电信	1,150,500	8,916,375.00	0.50
36	601668	中国建筑	1,531,000	8,833,870.00	0.49
37	002352	顺丰控股	178,600	8,708,536.00	0.48
38	000001	平安银行	718,400	8,671,088.00	0.48
39	002714	牧原股份	202,200	8,494,422.00	0.47
40	002230	科大讯飞	171,200	8,197,056.00	0.46
41	601127	赛力斯	60,600	8,139,792.00	0.45
42	603501	豪威集团	63,100	8,054,715.00	0.45
43	600031	三一重工	439,900	7,896,205.00	0.44
44	000063	中兴通讯	238,800	7,758,612.00	0.43
45	603019	中科曙光	108,400	7,631,360.00	0.42
46	002415	海康威视	273,700	7,589,701.00	0.42
47	600309	万华化学	139,500	7,569,270.00	0.42
48	600941	中国移动	66,800	7,518,340.00	0.42
49	300274	阳光电源	107,600	7,292,052.00	0.41
50	601857	中国石油	840,500	7,186,275.00	0.40
51	601919	中远海控	467,100	7,025,184.00	0.39
52	688008	澜起科技	84,913	6,962,866.00	0.39
53	600690	海尔智家	278,100	6,891,318.00	0.38
54	600660	福耀玻璃	118,600	6,761,386.00	0.38
55	601012	隆基绿能	449,700	6,754,494.00	0.38
56	600406	国电南瑞	297,400	6,664,734.00	0.37
57	601766	中国中车	900,700	6,340,928.00	0.35
58	603986	XD 兆易创	49,200	6,225,276.00	0.35
59	600050	中国联通	1,157,600	6,181,584.00	0.34
60	000568	泸州老窖	54,500	6,180,300.00	0.34

61	000338	潍柴动力	401,400	6,173,532.00	0.34
62	600028	中国石化	1,080,100	6,091,764.00	0.34
63	000100	TCL 科技	1,393,000	6,031,690.00	0.34
64	300476	胜宏科技	44,700	6,006,786.00	0.33
65	688012	中微公司	32,587	5,940,610.10	0.33
66	601006	大秦铁路	896,800	5,918,880.00	0.33
67	601985	中国核电	609,300	5,678,676.00	0.32
68	601225	陕西煤业	287,000	5,521,880.00	0.31
69	600104	上汽集团	343,200	5,508,360.00	0.31
70	002027	分众传媒	747,900	5,459,670.00	0.30
71	601988	中国银行	971,300	5,458,706.00	0.30
72	600150	中国船舶	165,600	5,388,624.00	0.30
73	600418	江淮汽车	129,400	5,187,646.00	0.29
74	601628	中国人寿	123,500	5,086,965.00	0.28
75	605499	东鹏饮料	15,400	4,836,370.00	0.27
76	688111	金山办公	17,246	4,829,742.30	0.27
77	603288	海天味业	123,700	4,813,167.00	0.27
78	600760	中航沈飞	81,600	4,783,392.00	0.27
79	000425	徐工机械	609,000	4,731,930.00	0.26
80	000625	长安汽车	368,300	4,699,508.00	0.26
81	000792	盐湖股份	274,200	4,683,336.00	0.26
82	688271	联影医疗	36,621	4,677,966.54	0.26
83	600111	北方稀土	187,600	4,671,240.00	0.26
84	600938	中国海油	177,200	4,626,692.00	0.26
85	600905	三峡能源	1,058,400	4,508,784.00	0.25
86	601658	邮储银行	816,600	4,466,802.00	0.25
87	002625	光启技术	111,600	4,461,768.00	0.25
88	600089	特变电工	373,900	4,460,627.00	0.25
89	600436	片仔癀	22,300	4,460,223.00	0.25
90	601888	中国中免	72,500	4,420,325.00	0.25
91	603993	洛阳钼业	520,900	4,385,978.00	0.24
92	002050	三花智控	166,000	4,379,080.00	0.24
93	300033	同花顺	15,900	4,340,859.00	0.24
94	300015	爱尔眼科	345,900	4,316,832.00	0.24
95	600048	保利发展	532,900	4,316,490.00	0.24
96	600019	宝钢股份	650,300	4,285,477.00	0.24
97	600547	山东黄金	133,900	4,275,427.00	0.24
98	601390	中国中铁	760,200	4,264,722.00	0.24
99	002463	沪电股份	99,800	4,249,484.00	0.24
100	002241	歌尔股份	181,100	4,223,252.00	0.23
101	600415	小商品城	203,500	4,208,380.00	0.23
102	300014	亿纬锂能	90,900	4,164,129.00	0.23
103	601600	中国铝业	588,200	4,140,928.00	0.23

104	601989	中国重工	848,900	3,938,896.00	0.22
105	000977	浪潮信息	76,300	3,882,144.00	0.22
106	600585	海螺水泥	178,000	3,821,660.00	0.21
107	002384	东山精密	101,100	3,818,547.00	0.21
108	600893	航发动力	98,900	3,811,606.00	0.21
109	002179	中航光电	94,100	3,797,876.00	0.21
110	600570	恒生电子	112,200	3,763,188.00	0.21
111	603799	华友钴业	101,000	3,739,020.00	0.21
112	000538	云南白药	66,200	3,693,298.00	0.21
113	000938	紫光股份	149,000	3,574,510.00	0.20
114	600584	长电科技	106,100	3,574,509.00	0.20
115	000988	华工科技	74,400	3,497,544.00	0.19
116	601727	上海电气	470,800	3,479,212.00	0.19
117	002028	思源电气	46,100	3,361,151.00	0.19
118	600438	通威股份	199,600	3,343,300.00	0.19
119	300408	三环集团	99,900	3,336,660.00	0.19
120	002049	紫光国微	50,200	3,306,172.00	0.18
121	300433	蓝思科技	147,700	3,293,710.00	0.18
122	000002	万 科 A	504,800	3,240,816.00	0.18
123	600795	国电电力	663,400	3,210,856.00	0.18
124	600489	XD 中金黄	215,900	3,158,617.00	0.18
125	601669	中国电建	636,700	3,100,729.00	0.17
126	600988	赤峰黄金	123,300	3,067,704.00	0.17
127	601689	拓普集团	64,300	3,038,175.00	0.17
128	600010	包钢股份	1,686,100	3,018,119.00	0.17
129	300339	润和软件	59,000	2,998,970.00	0.17
130	002422	科伦药业	83,400	2,995,728.00	0.17
131	002456	欧菲光	247,800	2,936,430.00	0.16
132	600009	上海机场	92,000	2,922,840.00	0.16
133	600160	巨化股份	100,400	2,879,472.00	0.16
134	601100	恒立液压	39,700	2,858,400.00	0.16
135	002460	赣锋锂业	84,000	2,836,680.00	0.16
136	000768	中航西飞	103,600	2,832,424.00	0.16
137	300394	天孚通信	34,700	2,770,448.00	0.15
138	601186	中国铁建	341,500	2,735,415.00	0.15
139	002252	上海莱士	396,200	2,721,894.00	0.15
140	600183	生益科技	90,200	2,719,530.00	0.15
141	688036	传音控股	34,019	2,711,314.30	0.15
142	600839	四川长虹	274,800	2,671,056.00	0.15
143	601360	三六零	260,700	2,659,140.00	0.15
144	000157	中联重科	367,200	2,654,856.00	0.15
145	600989	宝丰能源	163,900	2,645,346.00	0.15
146	600886	国投电力	178,100	2,625,194.00	0.15

147	000963	华东医药	64,800	2,615,328.00	0.15
148	002074	国轩高科	80,000	2,596,800.00	0.14
149	600115	中国东航	636,900	2,566,707.00	0.14
150	601058	赛轮轮胎	194,400	2,550,528.00	0.14
151	300442	润泽科技	51,200	2,535,936.00	0.14
152	000408	藏格矿业	58,400	2,491,928.00	0.14
153	000807	云铝股份	154,800	2,473,704.00	0.14
154	600066	宇通客车	99,100	2,463,626.00	0.14
155	002517	恺英网络	127,000	2,452,370.00	0.14
156	002466	天齐锂业	76,400	2,447,856.00	0.14
157	002340	格林美	381,100	2,419,985.00	0.13
158	002001	新 和 成	113,500	2,414,145.00	0.13
159	688169	石头科技	15,396	2,410,243.80	0.13
160	600426	XD 华鲁恒	110,400	2,392,368.00	0.13
161	000661	长春高新	24,100	2,390,238.00	0.13
162	002195	岩山科技	423,200	2,382,616.00	0.13
163	600029	南方航空	402,500	2,374,750.00	0.13
164	002558	巨人网络	100,800	2,373,840.00	0.13
165	600196	复星医药	94,200	2,363,478.00	0.13
166	001979	招商蛇口	269,200	2,360,884.00	0.13
167	002236	大华股份	147,700	2,345,476.00	0.13
168	300661	圣邦股份	32,200	2,343,194.00	0.13
169	000975	山金国际	123,500	2,339,090.00	0.13
170	601800	中国交建	262,900	2,337,181.00	0.13
171	600011	华能国际	326,200	2,329,068.00	0.13
172	600674	川投能源	145,100	2,327,404.00	0.13
173	301236	软通动力	42,500	2,322,200.00	0.13
174	002156	通富微电	90,400	2,316,048.00	0.13
175	688126	沪硅产业	122,388	2,291,103.36	0.13
176	600487	亨通光电	147,000	2,249,100.00	0.13
177	600346	恒力石化	156,200	2,227,412.00	0.12
178	300207	欣旺达	110,300	2,212,618.00	0.12
179	601111	中国国航	278,300	2,195,787.00	0.12
180	300251	光线传媒	108,300	2,195,241.00	0.12
181	300418	昆仑万维	65,200	2,192,676.00	0.12
182	688608	恒玄科技	6,275	2,183,574.50	0.12
183	600745	闻泰科技	64,900	2,176,097.00	0.12
184	002648	卫星化学	125,200	2,169,716.00	0.12
185	600372	中航机载	179,700	2,167,182.00	0.12
186	688213	XD 思特威	21,039	2,150,606.58	0.12
187	600460	XD 士兰微	86,500	2,146,930.00	0.12
188	601868	中国能建	958,500	2,137,455.00	0.12
189	002916	深南电路	19,700	2,123,857.00	0.12

190	003816	中国广核	583,000	2,122,120.00	0.12
191	000066	中国长城	143,100	2,117,880.00	0.12
192	688777	中控技术	46,805	2,102,012.55	0.12
193	002920	德赛西威	20,500	2,093,665.00	0.12
194	600096	云天化	95,000	2,087,150.00	0.12
195	688120	DR 华海清	12,343	2,082,264.10	0.12
196	601117	中国化学	270,800	2,077,036.00	0.12
197	600741	华域汽车	117,300	2,070,345.00	0.12
198	601319	中国人保	237,100	2,065,141.00	0.11
199	002273	水晶光电	103,300	2,062,901.00	0.11
200	002465	海格通信	147,600	2,057,544.00	0.11
201	601168	西部矿业	123,100	2,047,153.00	0.11
202	600879	航天电子	195,300	2,044,791.00	0.11
203	600588	用友网络	152,900	2,044,273.00	0.11
204	600256	广汇能源	338,800	2,039,576.00	0.11
205	300347	泰格医药	38,100	2,031,492.00	0.11
206	601021	春秋航空	36,400	2,025,660.00	0.11
207	600176	中国巨石	177,600	2,024,640.00	0.11
208	002601	龙佰集团	124,600	2,019,766.00	0.11
209	300450	先导智能	80,900	2,010,365.00	0.11
210	000831	中国稀土	55,500	2,004,660.00	0.11
211	688235	百济神州	8,570	2,002,294.80	0.11
212	000786	北新建材	75,200	1,991,296.00	0.11
213	601633	长城汽车	92,700	1,991,196.00	0.11
214	300782	卓胜微	27,800	1,984,086.00	0.11
215	600219	南山铝业	517,500	1,982,025.00	0.11
216	002555	三七互娱	114,600	1,981,434.00	0.11
217	600352	浙江龙盛	193,600	1,966,976.00	0.11
218	002294	信立泰	41,500	1,964,195.00	0.11
219	300896	爱美客	11,200	1,957,872.00	0.11
220	000933	神火股份	117,100	1,948,544.00	0.11
221	600885	宏发股份	87,100	1,943,201.00	0.11
222	300017	网宿科技	181,100	1,941,392.00	0.11
223	600482	中国动力	83,700	1,930,959.00	0.11
224	002185	华天科技	190,300	1,922,030.00	0.11
225	688617	惠泰医疗	6,460	1,918,620.00	0.11
226	302132	中航成飞	21,800	1,917,092.00	0.11
227	600039	四川路桥	193,300	1,913,670.00	0.11
228	000630	铜陵有色	572,000	1,910,480.00	0.11
229	688002	睿创微纳	27,234	1,898,754.48	0.11
230	002493	荣盛石化	225,900	1,870,452.00	0.10
231	688396	华润微	39,541	1,864,753.56	0.10
232	002129	TCL 中环	240,300	1,845,504.00	0.10

233	600085	XD 同仁堂	51,100	1,842,666.00	0.10
234	001965	招商公路	151,900	1,822,800.00	0.10
235	688506	百利天恒	6,148	1,820,545.76	0.10
236	601877	正泰电器	80,300	1,820,401.00	0.10
237	600362	江西铜业	76,700	1,797,081.00	0.10
238	300866	安克创新	15,800	1,794,880.00	0.10
239	002709	天赐材料	99,000	1,793,880.00	0.10
240	688099	晶晨股份	25,118	1,783,629.18	0.10
241	002130	沃尔核材	74,700	1,779,354.00	0.10
242	002281	光迅科技	35,800	1,765,656.00	0.10
243	300454	深信服	18,700	1,761,166.00	0.10
244	002131	利欧股份	503,100	1,760,850.00	0.10
245	002085	万丰奥威	110,800	1,760,612.00	0.10
246	002595	豪迈科技	29,700	1,758,834.00	0.10
247	000423	东阿阿胶	33,600	1,757,280.00	0.10
248	300122	智飞生物	89,000	1,743,510.00	0.10
249	688122	西部超导	33,574	1,741,819.12	0.10
250	002532	天山铝业	209,100	1,737,621.00	0.10
251	300058	蓝色光标	264,800	1,737,088.00	0.10
252	300002	神州泰岳	146,400	1,727,520.00	0.10
253	603392	万泰生物	28,300	1,726,300.00	0.10
254	002738	中矿资源	53,600	1,723,776.00	0.10
255	300223	北京君正	24,900	1,723,080.00	0.10
256	603129	春风动力	7,900	1,710,350.00	0.10
257	002138	顺络电子	60,400	1,698,448.00	0.09
258	600161	天坛生物	88,400	1,696,396.00	0.09
259	002180	纳思达	73,800	1,692,972.00	0.09
260	002472	双环传动	50,400	1,687,896.00	0.09
261	300474	景嘉微	23,100	1,686,300.00	0.09
262	002436	兴森科技	126,400	1,673,536.00	0.09
263	002078	太阳纸业	124,100	1,670,386.00	0.09
264	603596	伯特利	31,600	1,665,004.00	0.09
265	300832	新产业	29,200	1,656,224.00	0.09
266	002410	广联达	123,300	1,653,453.00	0.09
267	002938	鹏鼎控股	51,600	1,652,748.00	0.09
268	600233	圆通速递	128,000	1,649,920.00	0.09
269	002128	电投能源	82,700	1,635,806.00	0.09
270	000301	东方盛虹	195,300	1,626,849.00	0.09
271	600862	中航高科	62,200	1,622,176.00	0.09
272	300759	康龙化成	65,900	1,617,186.00	0.09
273	300346	南大光电	51,100	1,616,804.00	0.09
274	600143	金发科技	156,200	1,610,422.00	0.09
275	300136	信维通信	71,800	1,608,320.00	0.09

276	300054	鼎龙股份	56,000	1,606,080.00	0.09
277	300024	机器人	93,400	1,604,612.00	0.09
278	600188	兖矿能源	131,800	1,604,006.00	0.09
279	000034	神州数码	42,500	1,599,700.00	0.09
280	688047	龙芯中科	11,982	1,598,278.98	0.09
281	002065	东华软件	166,400	1,597,440.00	0.09
282	688072	拓荆科技	10,389	1,596,893.19	0.09
283	002353	杰瑞股份	45,600	1,596,000.00	0.09
284	002223	鱼跃医疗	44,800	1,594,880.00	0.09
285	601618	中国中冶	530,000	1,579,400.00	0.09
286	002202	金风科技	154,000	1,578,500.00	0.09
287	603606	东方电缆	30,500	1,577,155.00	0.09
288	300395	菲利华	30,800	1,573,880.00	0.09
289	688578	艾力斯	16,862	1,568,840.48	0.09
290	300496	中科创达	27,200	1,556,384.00	0.09
291	688223	晶科能源	299,544	1,554,633.36	0.09
292	601615	明阳智能	134,100	1,540,809.00	0.09
293	300383	光环新网	107,700	1,540,110.00	0.09
294	000999	华润三九	49,200	1,538,976.00	0.09
295	002624	完美世界	100,700	1,527,619.00	0.08
296	600845	宝信软件	64,500	1,523,490.00	0.08
297	002008	大族激光	62,400	1,520,688.00	0.08
298	002271	东方雨虹	141,100	1,514,003.00	0.08
299	600515	海南机场	426,300	1,509,102.00	0.08
300	002405	四维图新	176,000	1,503,040.00	0.08
301	601872	招商轮船	240,100	1,503,026.00	0.08
302	603659	璞泰来	79,600	1,494,888.00	0.08
303	600549	厦门钨业	71,300	1,491,596.00	0.08
304	002459	晶澳科技	148,700	1,484,026.00	0.08
305	688266	泽璟制药	13,799	1,483,530.49	0.08
306	600895	张江高科	57,400	1,475,180.00	0.08
307	300459	汤姆猫	262,800	1,471,680.00	0.08
308	300604	长川科技	32,700	1,468,557.00	0.08
309	603087	甘李药业	26,800	1,468,104.00	0.08
310	000426	兴业银锡	92,700	1,464,660.00	0.08
311	300012	华测检测	124,900	1,460,081.00	0.08
312	002155	湖南黄金	81,300	1,451,205.00	0.08
313	603605	珀莱雅	17,500	1,448,825.00	0.08
314	000733	振华科技	28,900	1,446,445.00	0.08
315	300627	华测导航	41,000	1,435,000.00	0.08
316	688599	天合光能	97,519	1,416,951.07	0.08
317	605117	德业股份	26,900	1,416,554.00	0.08
318	605589	圣泉集团	50,300	1,395,825.00	0.08

319	300253	卫宁健康	131,400	1,392,840.00	0.08
320	300699	光威复材	43,700	1,383,979.00	0.08
321	601216	君正集团	250,400	1,382,208.00	0.08
322	600332	白云山	52,400	1,381,264.00	0.08
323	600392	盛和资源	104,400	1,374,948.00	0.08
324	000617	中油资本	187,400	1,368,020.00	0.08
325	300037	新宙邦	38,800	1,365,760.00	0.08
326	002444	巨星科技	53,500	1,364,785.00	0.08
327	688180	君实生物	40,044	1,360,695.12	0.08
328	000519	中兵红箭	62,000	1,357,180.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	306,000	1,346,400.00	0.07
330	600153	建发股份	129,800	1,346,026.00	0.07
331	300003	乐普医疗	97,000	1,336,660.00	0.07
332	000878	云南铜业	104,500	1,329,240.00	0.07
333	300001	特锐德	55,400	1,327,938.00	0.07
334	601233	桐昆股份	125,100	1,326,060.00	0.07
335	601799	星宇股份	10,600	1,325,000.00	0.07
336	300316	晶盛机电	48,800	1,324,920.00	0.07
337	002389	航天彩虹	51,700	1,323,520.00	0.07
338	300073	当升科技	30,100	1,320,487.00	0.07
339	002821	凯莱英	14,900	1,314,925.00	0.07
340	300628	亿联网络	37,800	1,313,928.00	0.07
341	600803	新奥股份	69,300	1,309,770.00	0.07
342	300142	沃森生物	118,600	1,304,600.00	0.07
343	002414	高德红外	127,000	1,301,750.00	0.07
344	603979	金诚信	28,000	1,300,320.00	0.07
345	600699	均胜电子	73,400	1,280,096.00	0.07
346	002007	华兰生物	81,500	1,277,105.00	0.07
347	002812	恩捷股份	43,600	1,277,044.00	0.07
348	300568	星源材质	100,600	1,275,608.00	0.07
349	600118	中国卫星	44,100	1,259,937.00	0.07
350	600177	雅戈尔	172,400	1,258,520.00	0.07
351	600521	华海药业	67,000	1,248,210.00	0.07
352	603260	合盛硅业	26,300	1,246,620.00	0.07
353	002152	广电运通	91,800	1,233,792.00	0.07
354	600398	海澜之家	176,900	1,231,224.00	0.07
355	601238	广汽集团	164,200	1,229,858.00	0.07
356	600704	物产中大	231,700	1,221,059.00	0.07
357	300315	掌趣科技	200,600	1,217,642.00	0.07
358	000623	吉林敖东	71,600	1,213,620.00	0.07
359	600497	驰宏锌锗	229,100	1,211,939.00	0.07
360	000738	航发控制	58,400	1,211,800.00	0.07
361	300413	芒果超媒	55,500	1,211,010.00	0.07

362	600316	洪都航空	32,000	1,206,400.00	0.07
363	002044	美年健康	233,600	1,200,704.00	0.07
364	600765	中航重机	70,700	1,193,416.00	0.07
365	002318	久立特材	50,900	1,190,551.00	0.07
366	000009	中国宝安	133,800	1,188,144.00	0.07
367	600018	上港集团	208,000	1,187,680.00	0.07
368	600141	兴发集团	57,600	1,182,528.00	0.07
369	601567	三星医疗	52,600	1,179,292.00	0.07
370	600038	中直股份	30,200	1,172,062.00	0.07
371	300919	中伟股份	35,100	1,154,088.00	0.06
372	000400	许继电气	52,900	1,151,633.00	0.06
373	002409	雅克科技	21,000	1,148,490.00	0.06
374	601677	明泰铝业	92,400	1,147,608.00	0.06
375	600637	东方明珠	150,900	1,127,223.00	0.06
376	300757	罗博特科	7,500	1,124,775.00	0.06
377	688188	柏楚电子	8,543	1,124,771.38	0.06
378	000960	锡业股份	73,400	1,123,020.00	0.06
379	002607	中公教育	366,300	1,120,878.00	0.06
380	601607	上海医药	62,600	1,119,288.00	0.06
381	300724	捷佳伟创	20,600	1,118,580.00	0.06
382	603939	益丰药房	45,500	1,113,385.00	0.06
383	300088	长信科技	185,600	1,106,176.00	0.06
384	600498	烽火通信	52,400	1,101,972.00	0.06
385	002245	蔚蓝锂芯	85,500	1,096,965.00	0.06
386	300558	贝达药业	18,900	1,095,255.00	0.06
387	300182	捷成股份	198,600	1,094,286.00	0.06
388	002407	多氟多	89,400	1,089,786.00	0.06
389	600529	山东药玻	49,200	1,089,288.00	0.06
390	600563	法拉电子	9,900	1,079,991.00	0.06
391	002739	万达电影	94,200	1,076,706.00	0.06
392	000039	中集集团	136,500	1,072,890.00	0.06
393	600026	中远海能	103,800	1,072,254.00	0.06
394	002841	视源股份	30,900	1,069,140.00	0.06
395	600486	扬农化工	18,200	1,055,600.00	0.06
396	601018	宁波港	288,100	1,054,446.00	0.06
397	300068	南都电源	66,100	1,052,312.00	0.06
398	301358	湖南裕能	33,700	1,051,103.00	0.06
399	002025	航天电器	20,300	1,043,623.00	0.06
400	000887	中鼎股份	59,100	1,039,569.00	0.06
401	300285	国瓷材料	59,600	1,034,060.00	0.06
402	688303	大全能源	48,087	1,025,214.84	0.06
403	300763	锦浪科技	17,800	1,021,542.00	0.06
404	600820	隧道股份	164,400	1,002,840.00	0.06

405	300144	宋城演艺	117,100	1,001,205.00	0.06
406	603806	福斯特	77,200	1,000,512.00	0.06
407	600008	首创环保	329,900	996,298.00	0.06
408	603486	科沃斯	17,100	995,733.00	0.06
409	688009	中国通号	192,809	991,038.26	0.06
410	300296	利亚德	160,900	981,490.00	0.05
411	002497	雅化集团	85,800	978,120.00	0.05
412	603568	伟明环保	51,200	976,896.00	0.05
413	002064	华峰化学	147,700	976,297.00	0.05
414	002312	川发龙蟒	84,600	971,208.00	0.05
415	600763	通策医疗	23,500	970,080.00	0.05
416	600998	九州通	187,600	964,264.00	0.05
417	600516	方大炭素	207,500	962,800.00	0.05
418	600166	福田汽车	355,000	962,050.00	0.05
419	600170	上海建工	399,600	955,044.00	0.05
420	603816	顾家家居	37,000	944,240.00	0.05
421	605358	立昂微	40,100	934,330.00	0.05
422	600208	衢州发展	315,600	934,176.00	0.05
423	600312	平高电气	60,700	934,173.00	0.05
424	601179	中国西电	152,000	933,280.00	0.05
425	300676	华大基因	18,700	930,699.00	0.05
426	000683	博源化工	193,100	924,949.00	0.05
427	002176	江特电机	126,800	920,568.00	0.05
428	601155	新城控股	66,400	908,352.00	0.05
429	002244	滨江集团	92,700	903,825.00	0.05
430	601000	唐山港	222,600	903,756.00	0.05
431	002432	九安医疗	24,700	899,821.00	0.05
432	603613	国联股份	37,900	897,851.00	0.05
433	000629	钒钛股份	349,100	893,696.00	0.05
434	000830	鲁西化工	86,300	888,890.00	0.05
435	000818	航锦科技	39,300	884,250.00	0.05
436	000708	中信特钢	75,000	882,000.00	0.05
437	600323	瀚蓝环境	36,200	881,470.00	0.05
438	603885	吉祥航空	65,400	880,938.00	0.05
439	300567	精测电子	14,500	878,845.00	0.05
440	002603	以岭药业	61,900	872,790.00	0.05
441	600535	天士力	55,400	867,010.00	0.05
442	002439	启明星辰	53,800	860,262.00	0.05
443	600499	科达制造	85,900	841,820.00	0.05
444	601880	辽港股份	560,800	841,200.00	0.05
445	300390	天华新能	43,700	833,359.00	0.05
446	688005	容百科技	37,317	832,915.44	0.05
447	603000	人民网	40,800	824,568.00	0.05

448	002145	中核钛白	197,700	820,455.00	0.05
449	600511	国药股份	28,100	819,396.00	0.05
450	600655	豫园股份	146,700	814,185.00	0.05
451	000563	陕国投 A	227,400	811,818.00	0.05
452	600859	王府井	58,400	811,176.00	0.05
453	600325	华发股份	165,900	807,933.00	0.04
454	603077	和邦生物	460,600	806,050.00	0.04
455	000547	航天发展	95,600	803,040.00	0.04
456	600004	白云机场	88,100	801,710.00	0.04
457	600131	国网信通	45,000	796,500.00	0.04
458	603899	晨光股份	27,400	794,326.00	0.04
459	601966	玲珑轮胎	54,000	792,180.00	0.04
460	300529	健帆生物	35,900	774,363.00	0.04
461	603833	欧派家居	13,700	773,365.00	0.04
462	002756	永兴材料	24,300	771,525.00	0.04
463	600754	锦江酒店	34,100	765,204.00	0.04
464	300601	康泰生物	49,600	753,424.00	0.04
465	000998	隆平高科	76,400	752,540.00	0.04
466	601866	中远海发	295,700	730,379.00	0.04
467	600667	太极实业	110,500	727,090.00	0.04
468	300070	碧水源	160,600	722,700.00	0.04
469	002544	普天科技	30,700	719,915.00	0.04
470	002120	韵达股份	107,400	719,580.00	0.04
471	300438	鹏辉能源	26,000	717,860.00	0.04
472	300751	迈为股份	10,300	716,468.00	0.04
473	600867	通化东宝	86,600	710,120.00	0.04
474	600258	首旅酒店	49,200	695,196.00	0.04
475	000032	深桑达 A	33,900	685,797.00	0.04
476	002508	老板电器	35,500	674,855.00	0.04
477	300457	赢合科技	29,200	671,600.00	0.04
478	000069	华侨城 A	296,900	668,025.00	0.04
479	300573	兴齐眼药	12,700	657,733.00	0.04
480	002831	裕同科技	28,000	655,760.00	0.04
481	000967	盈峰环境	93,800	651,910.00	0.04
482	002292	奥飞娱乐	66,700	648,324.00	0.04
483	300118	东方日升	67,200	643,776.00	0.04
484	600129	太极集团	28,800	613,728.00	0.03
485	002572	索菲亚	42,900	601,029.00	0.03
486	601636	旗滨集团	119,600	599,196.00	0.03
487	002266	浙富控股	194,400	598,752.00	0.03
488	603650	彤程新材	17,900	575,485.00	0.03
489	688063	派能科技	12,650	570,262.00	0.03
490	000035	中国天楹	131,200	562,848.00	0.03

491	600864	哈投股份	94,000	561,180.00	0.03
492	300769	德方纳米	16,800	554,736.00	0.03
493	688390	固德威	12,724	552,857.80	0.03
494	600315	上海家化	25,200	530,964.00	0.03
495	002091	江苏国泰	71,700	521,259.00	0.03
496	002372	伟星新材	47,900	496,244.00	0.03
497	001914	招商积余	31,600	390,892.00	0.02
498	600007	中国国贸	15,000	308,700.00	0.02
499	600335	XD 国机汽	43,900	283,155.00	0.02
500	301381	赛维时代	8,700	173,565.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688775	影石创新	5,725	938,946.56	0.05
2	301678	新恒汇	3,817	220,366.28	0.01
3	603400	华之杰	569	31,875.73	0.00
4	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
5	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
6	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
7	001388	C 信通电子	937	15,385.54	0.00
8	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
9	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
10	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.00
11	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
12	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
13	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
14	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
15	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
16	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
17	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
18	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
19	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
20	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
21	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
22	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
23	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
24	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
25	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
26	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
27	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	600519	贵州茅台	13,766,482.00	0.65
2	300750	宁德时代	10,642,189.00	0.51
3	601318	XD 中国平	8,069,842.00	0.38
4	600036	招商银行	7,434,812.00	0.35
5	601166	兴业银行	7,285,183.00	0.35
6	000333	美的集团	5,999,856.00	0.28
7	600900	长江电力	4,165,917.00	0.20
8	002594	比亚迪	4,149,120.00	0.20
9	000858	五 粮 液	3,520,237.00	0.17
10	300059	东方财富	3,319,417.00	0.16
11	601899	紫金矿业	3,300,779.00	0.16
12	601398	工商银行	3,235,750.00	0.15
13	600276	恒瑞医药	3,143,233.60	0.15
14	600030	中信证券	3,006,413.00	0.14
15	688981	中芯国际	2,517,998.34	0.12
16	300308	中际旭创	2,499,707.00	0.12
17	000651	格力电器	2,493,015.00	0.12
18	002230	科大讯飞	2,485,696.00	0.12
19	002475	立讯精密	2,449,002.00	0.12
20	688608	恒玄科技	2,400,770.48	0.11

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

7.4.2 累计卖出金额超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	600519	贵州茅台	26,541,277.00	1.26
2	300750	宁德时代	20,097,297.00	0.95
3	601318	XD 中国平	15,976,127.00	0.76
4	600036	招商银行	14,764,002.00	0.70
5	000333	美的集团	10,551,294.00	0.50
6	600900	长江电力	9,025,347.00	0.43
7	002594	比亚迪	8,491,047.00	0.40
8	601166	兴业银行	7,909,150.00	0.38
9	300059	东方财富	7,328,423.88	0.35
10	601899	紫金矿业	7,117,233.00	0.34
11	000858	五 粮 液	6,934,651.00	0.33
12	600030	中信证券	6,733,619.99	0.32
13	601398	工商银行	6,661,638.00	0.32
14	600276	恒瑞医药	6,195,441.00	0.29

15	601988	中国银行	6,051,980.00	0.29
16	688981	中芯国际	5,207,273.99	0.25
17	002475	立讯精密	5,166,579.00	0.25
18	000651	格力电器	5,141,108.00	0.24
19	300124	汇川技术	4,991,675.00	0.24
20	600887	伊利股份	4,910,894.00	0.23

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	331,140,383.82
卖出股票收入（成交）总额	627,598,070.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	79,760,509.89	4.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,760,509.89	4.44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	259938	25 贴现国债 38	800,000	79,760,509.89	4.44

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

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。

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

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，适度参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,854,146.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,854,146.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股流通受限
2	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股流通受限
3	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	新股流通受限
4	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	新股流通受限
5	603400	华之杰	2,497.17	0.00	新股流通受限

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
中欧中证 A500 指数发起 A	6,448	79,354.47	11,069,291.81	2.16%	500,608,352.94	97.84%
中欧中证 A500 指数发起 C	16,639	76,385.99	211,890,815.19	16.67%	1,059,095,751.56	83.33%
中欧中证 A500 指数发起 Y	1,450	7,741.91	0.00	0.00%	11,225,772.49	100.00%
合计	24,537	73,109.59	222,960,107.00	12.43%	1,570,929,876.99	87.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管	中欧中证 A500 指数发起 A	973,122.18	0.19%

理人所有从业人员持有本基金	中欧中证 A500 指数发起 C	0.00	0.00%
	中欧中证 A500 指数发起 Y	46,608.88	0.42%
	合计	1,019,731.06	0.06%

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	中欧中证 A500 指数发起 A	0
	中欧中证 A500 指数发起 C	0
	中欧中证 A500 指数发起 Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 A500 指数发起 A	0
	中欧中证 A500 指数发起 C	0
	中欧中证 A500 指数发起 Y	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.56%	10,000,000.00	0.56%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.56%	10,000,000.00	0.56%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 4 日）基金	682,964,211.94	1,705,361,803.05	-

份额总额			
本报告期期初 基金份额总额	652,100,869.91	1,476,541,865.17	3,647,213.93
本报告期基金 总申购份额	54,328,355.50	614,488,381.87	9,152,427.73
减：本报告期 基金总赎回份 额	194,751,580.66	820,043,680.29	1,573,869.17
本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	511,677,644.75	1,270,986,566.75	11,225,772.49

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	3	957,046,616.02	100.00	177,935.21	100.00	本报告期新增3个

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 (%)
方正证券	—	—	—	—	—	—

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
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“欧菲光”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-04-08
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
5	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
6	中欧中证 A500 指数发起式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
7	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
8	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“海光信息”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-06
9	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
10	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金更新招募说明书（2025 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2025-06-24

§ 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