

中欧量化驱动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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	58

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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	65
§ 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	中欧量化驱动混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化驱动混合	
基金主代码	001980	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 16 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	379,029,761.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	001980	020875
报告期末下属分级基金的份额总额	349,647,651.23 份	29,382,110.20 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	北京市西城区复兴门内大街 55

	家嘴环路 479 号 8 层	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

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)	
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
本期已实现收益	29,794,582.75	921,033.22
本期利润	30,204,850.10	959,137.25
加权平均基金份额 本期利润	0.0831	0.0552
本期加权平均净 值利润率	6.98%	4.65%
本期基金份额净 值增长率	7.07%	6.51%
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	83,269,120.19	6,641,406.19
期末可供分配基 金份额利润	0.2382	0.2260

期末基金资产净值	432,916,771.42	36,023,516.39
期末基金份额净值	1.2382	1.2260
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	54.25%	22.11%

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

中欧量化驱动混合 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	4.22%	0.67%	3.36%	0.63%	0.86%	0.04%
过去三个月	2.94%	1.33%	2.36%	1.24%	0.58%	0.09%
过去六个月	7.07%	1.22%	4.44%	1.11%	2.63%	0.11%
过去一年	27.14%	1.43%	19.98%	1.34%	7.16%	0.09%
过去三年	-9.23%	1.14%	-6.00%	1.06%	-3.23%	0.08%
自基金合同生效起至今	54.25%	1.24%	57.41%	1.41%	-3.16%	-0.17%

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

中欧量化驱动混合 C

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

过去一个月	4.15%	0.67%	3.36%	0.63%	0.79%	0.04%
过去三个月	2.78%	1.33%	2.36%	1.24%	0.42%	0.09%
过去六个月	6.51%	1.22%	4.44%	1.11%	2.07%	0.11%
过去一年	26.04%	1.43%	19.98%	1.34%	6.06%	0.09%
自基金份额起始 运作日至今	22.11%	1.36%	15.71%	1.27%	6.40%	0.09%

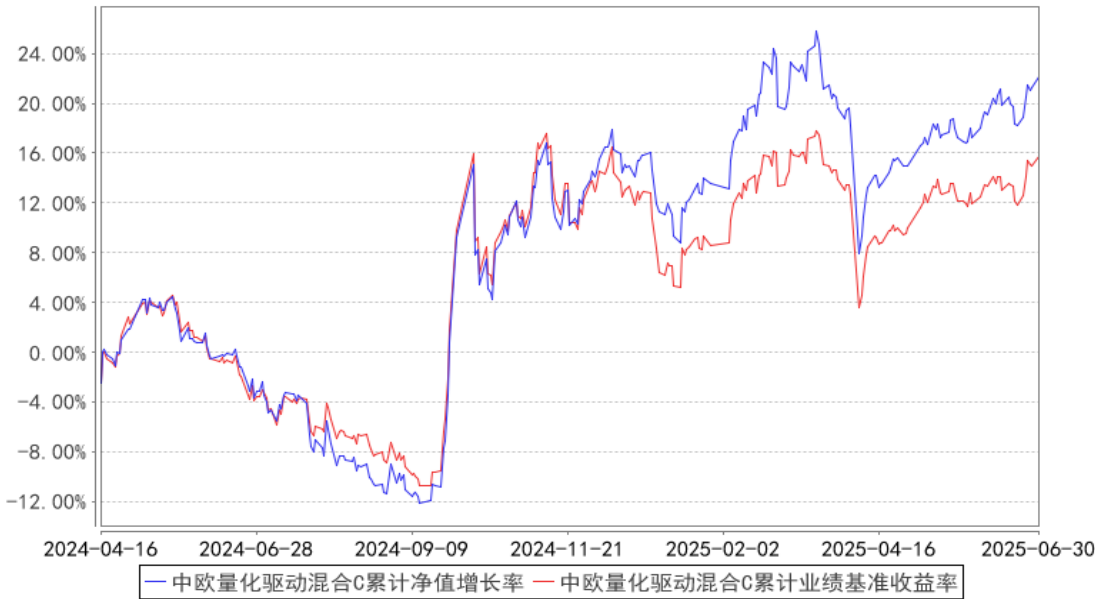
注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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



注：2019 年 4 月 26 日，组合业绩比较基准变更为创业板指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。2022 年 8 月 11 日，业绩比较基准变更为中证全指指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。

中欧量化驱动混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2024 年 4 月 1 日新增 C 类份额，图示日期为 2024 年 4 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		
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。
曲径	权益投决会委员 /	2018-05-16	—	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，我们以偏股混合型基金的量化特征作为抓手，保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中大盘成长风格。基金采用多维数据进行建模，包括基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源等，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器围绕偏股混合型基金指数的风险特征生成投资组合，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 7.07%，同期业绩比较基准收益率为 4.44%；基金 C 类份额净值增长率为 6.51%，同期业绩比较基准收益率为 4.44%。

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。通过风控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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年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、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧量化驱动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	54,386,144.73	46,725,237.24
结算备付金		13,612,944.39	7,364,046.62
存出保证金		1,178,658.79	339,661.23
交易性金融资产	6.4.7.2	404,542,290.78	328,052,694.72
其中：股票投资		404,542,290.78	328,052,694.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		1,480,924.87	-
应收股利		367,254.40	-
应收申购款		518,294.01	32,092.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		476,086,511.97	382,513,732.49
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		4,853,175.23	2,516,001.71
应付赎回款		108,202.09	2,340,560.98
应付管理人报酬		447,794.77	435,237.97
应付托管费		74,632.47	72,539.66
应付销售服务费		18,295.90	9,585.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,726.06	756.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,640,397.64	1,676,286.96
负债合计		7,146,224.16	7,050,969.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	379,029,761.43	324,749,126.16
未分配利润	6.4.7.8	89,910,526.38	50,713,636.95
净资产合计		468,940,287.81	375,462,763.11
负债和净资产总计		476,086,511.97	382,513,732.49

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 379,029,761.43 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.2382 元，基金份额总额 349,647,651.23 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.2260 元，基金份额总额 29,382,110.20 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化驱动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		34,464,138.59	-119,816,361.22
1. 利息收入		176,714.48	336,778.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	133,338.15	336,778.75
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		43,376.33	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,770,936.72	-155,251,215.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	27,278,052.48	-167,674,905.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	452,530.41
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	1,507,713.99	2,579,076.81
股利收益	6.4.7.14	4,985,170.25	9,392,082.55
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	448,371.38	34,444,130.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	68,116.01	653,945.00
减：二、营业总支出		3,300,151.24	8,523,778.24
1. 管理人报酬		2,689,717.27	7,193,892.51
2. 托管费		448,286.23	1,198,981.98
3. 销售服务费		59,978.53	186.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	4,431.88
其中：卖出回购金融资产支出		-	4,431.88
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,441.54	12,392.19
8. 其他费用	6.4.7.18	96,727.67	113,893.59

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,163,987.35	-128,340,139.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,163,987.35	-128,340,139.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,163,987.35	-128,340,139.46

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧量化驱动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	324,749,126.16	-	50,713,636.95	375,462,763.11
二、本期期初净资产	324,749,126.16	-	50,713,636.95	375,462,763.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	54,280,635.27	-	39,196,889.43	93,477,524.70
（一）、综合收益总额	-	-	31,163,987.35	31,163,987.35
（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）	54,280,635.27	-	8,032,902.08	62,313,537.35
其中：1. 基金申购款	156,561,262.74	-	25,580,446.16	182,141,708.90
2. 基金赎回款	- 102,280,627.47	-	-17,547,544.08	-119,828,171.55
（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	379,029,761.43	-	89,910,526.38	468,940,287.81
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	1,833,498,203.78	-	117,258,900.06	1,950,757,103.84
二、本期期初净资产	1,833,498,203.78	-	117,258,900.06	1,950,757,103.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,030,455,587.78	-	-138,203,142.31	-1,168,658,730.09
（一）、综合收益总额	-	-	-128,340,139.46	-128,340,139.46
（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）	-1,030,455,587.78	-	-9,863,002.85	-1,040,318,590.63
其中：1. 基金申购款	55,239,637.87	-	224,569.46	55,464,207.33
2. 基金赎回款	-1,085,695,225.65	-	-10,087,572.31	-1,095,782,797.96
（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	803,042,616.00	-	-20,944,242.25	782,098,373.75

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	王音然	李宝林
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧量化驱动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[2015]2366 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金注册的批复》及[2017]1519 号文《关于准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册的批复》（准予中欧中证银联智策大数据 100 指数型证券投资基金变更注册为中欧量化驱动混合型证券投资基金）核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化驱动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 244,603,768.62 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第 61336106_B08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 244,633,211.97 份基金份额，其中包含认购利息折合 29,443.35 份基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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，经征托管人中国工商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 4 月 1 日起增加本基金 C 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设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。新增 C 类基金份额与 A 类基金份额将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《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、港股通标的股票、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。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：本基金股票投资占基金资产的比例为 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，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不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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	54,386,144.73
等于：本金	54,380,088.58
加：应计利息	6,056.15
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	54,386,144.73

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		393,676,502.31	-	404,542,290.78	10,865,788.47
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		393,676,502.31	-	404,542,290.78	10,865,788.47

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	7,359,390.00	-	-	-

其中： 股指期货 投资	7,359,390.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	7,359,390.00	-	-	-

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	3.00	3,520,440.00	143,250.00
IH2507	IH2507	2.00	1,615,080.00	43,320.00
IM2507	IM2507	2.00	2,515,760.00	105,320.00
合计				291,890.00
减：可抵销期货 暂收款				291,890.00
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	36.10
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,556,058.98
其中：交易所市场	1,556,058.98
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	1,640,397.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化驱动混合 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	309,949,872.18	309,949,872.18
本期申购	115,776,499.95	115,776,499.95
本期赎回（以“-”号填列）	-76,078,720.90	-76,078,720.90
本期末	349,647,651.23	349,647,651.23

中欧量化驱动混合 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	14,799,253.98	14,799,253.98
本期申购	40,784,762.79	40,784,762.79
本期赎回（以“-”号填列）	-26,201,906.57	-26,201,906.57
本期末	29,382,110.20	29,382,110.20

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧量化驱动混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	179,191,821.92	-130,714,933.45	48,476,888.47
本期期初	179,191,821.92	-130,714,933.45	48,476,888.47
本期利润	29,794,582.75	410,267.35	30,204,850.10
本期基金份额交易产生的变动数	22,024,470.04	-17,437,088.42	4,587,381.62
其中：基金申购款	69,263,054.76	-51,550,255.25	17,712,799.51
基金赎回款	-47,238,584.72	34,113,166.83	-13,125,417.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231,010,874.71	-147,741,754.52	83,269,120.19

中欧量化驱动混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,480,616.76	-6,243,868.28	2,236,748.48
本期期初	8,480,616.76	-6,243,868.28	2,236,748.48
本期利润	921,033.22	38,104.03	959,137.25
本期基金份额交易产	9,690,513.45	-6,244,992.99	3,445,520.46

生的变动数			
其中：基金申购款	25,396,074.56	-17,528,427.91	7,867,646.65
基金赎回款	-15,705,561.11	11,283,434.92	-4,422,126.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,092,163.43	-12,450,757.24	6,641,406.19

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	101,825.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,282.52
其他	1,229.73
合计	133,338.15

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	3,532,364,120.93
减：卖出股票成本总额	3,499,229,357.11
减：交易费用	5,856,711.34
买卖股票差价收入	27,278,052.48

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,507,713.99

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	4,985,170.25
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	4,985,170.25

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	156,481.38
股票投资	156,481.38
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	291,890.00
权证投资	-
期货投资	291,890.00
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	448,371.38

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	66,833.95
基金转换费收入	1,282.06
合计	68,116.01

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	—
汇划手续费	714.00
账户维护费	9,000.00
证券组合费	2,570.27
存托服务费	140.84
合计	96,727.67

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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

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（%）
国都证券	128,339,178.13	1.81	902,551,115.60	9.06

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（%）
国都证券	55,942.18	1.79	-	-
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（%）
国都证券	492,700.60	9.10	-	-

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	2,689,717.27	7,193,892.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	589,856.87	1,433,685.86
应支付基金管理人的净管理费	2,099,860.40	5,760,206.65

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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 2 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、公休假等，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	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	448,286.23	1,198,981.98

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，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 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，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		
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	合计
中欧基金	0.00	25,111.54	25,111.54
合计	0.00	25,111.54	25,111.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C	合计
中欧基金	0.00	186.09	186.09
合计	0.00	186.09	186.09

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 0.60%。

计算方法如下：

$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径一次性划付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧量化驱动混合 C

份额单位：份

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 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
报告期初持有的 基金份额	149,402.39	0.00
报告期间申购/买 入总份额	0.00	149,402.39
报告期间因拆分 变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回 /卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的 基金份额	149,402.39	149,402.39

报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	0.51%	100.00%
---------------------------------	-------	---------

- 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 A 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

中欧量化驱动混合 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	167,160.29	0.05%	167,568.77	0.05%

- 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
中国工商银行股份有限公司	54,386,144.73	101,825.90	114,021,863.21	196,679.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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	-
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	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	-
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	2025 年 3 月	6 个月	新股流通	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-

	科技	月 4 日		受限						
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	27.49	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
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	2025 年 4	6 个月	新股流通	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

	股份	月 2 日		受限						
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	213	9,904.50	9,127.05	-
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	-
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	77	7,199.50	6,980.82	-
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	2025 年 6	6 个月	新股流通	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	科技	月 5 日		受限						
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	384	18,151.68	47,677.44	-

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	停牌	停牌	期末	复	复牌	数量	期末	期末	备注
------	---	----	----	----	---	----	----	----	----	----

码	票名称	日期	原因	估值单价	牌日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	9,800	348,873.44	372,890.00	-

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。本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。 本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心,督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略,并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作,负责监察公司的风险管理措施的执行,对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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	54,386,144.73	-	-	-	54,386,144.73
结算备付金	13,612,944.39	-	-	-	13,612,944.39
存出保证金	260,505.19	-	-	918,153.60	1,178,658.79
交易性金融资产	-	-	-	404,542,290.78	404,542,290.78
应收股利	-	-	-	367,254.40	367,254.40
应收申购款	-	-	-	518,294.01	518,294.01
应收清算款	-	-	-	1,480,924.87	1,480,924.87
资产总计	68,259,594.31	-	-	407,826,917.66	476,086,511.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	108,202.09	108,202.09
应付管理人报酬	-	-	-	447,794.77	447,794.77
应付托管费	-	-	-	74,632.47	74,632.47

应付清算款	-	-	-	4,853,175.23	4,853,175.23
应付销售服务费	-	-	-	18,295.90	18,295.90
应交税费	-	-	-	3,726.06	3,726.06
其他负债	-	-	-	1,640,397.64	1,640,397.64
负债总计	-	-	-	7,146,224.16	7,146,224.16
利率敏感度缺口	68,259,594.31	-	-	-400,680,693.50	468,940,287.81
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	46,725,237.24	-	-	-	46,725,237.24
结算备付金	7,364,046.62	-	-	-	7,364,046.62
存出保证金	339,661.23	-	-	-	339,661.23
交易性金融资产	-	-	-	-328,052,694.72	328,052,694.72
应收申购款	-	-	-	32,092.68	32,092.68
资产总计	54,428,945.09	-	-	-328,084,787.40	382,513,732.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,340,560.98	2,340,560.98
应付管理人报酬	-	-	-	435,237.97	435,237.97
应付托管费	-	-	-	72,539.66	72,539.66
应付清算款	-	-	-	2,516,001.71	2,516,001.71
应付销售服务费	-	-	-	9,585.50	9,585.50
应交税费	-	-	-	756.60	756.60
其他负债	-	-	-	1,676,286.96	1,676,286.96
负债总计	-	-	-	7,050,969.38	7,050,969.38
利率敏感度缺口	54,428,945.09	-	-	-321,033,818.02	375,462,763.11

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：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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	73,331,612.16	-	73,331,612.16
应收股利	-	367,254.40	-	367,254.40
资产合计	-	73,698,866.56	-	73,698,866.56
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	73,698,866.56	-	73,698,866.56
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72
资产合计	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	67,645,284.72	-	67,645,284.72

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬	-3,684,943.33	-3,382,264.24

	值 5%		
	港币相对人民币升		
	值 5%	3,684,943.33	3,382,264.24

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	404,542,290.78	86.27	328,052,694.72	87.37
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	404,542,290.78	86.27	328,052,694.72	87.37

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%	24,951,510.21	19,506,790.97
	业绩比较基准下降	-24,951,510.21	-19,506,790.97

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	403,728,588.78	327,397,058.38
第二层次	388,275.54	27,736.50
第三层次	425,426.46	627,899.84
合计	404,542,290.78	328,052,694.72

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	404,542,290.78	84.97
	其中：股票	404,542,290.78	84.97
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	67,999,089.12	14.28
8	其他各项资产	3,545,132.07	0.74
9	合计	476,086,511.97	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 73,331,612.16 元，占基金资产净值比例 15.64%。

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	1,035,199.00	0.22
B	采矿业	13,894,343.20	2.96
C	制造业	210,628,236.74	44.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,253,628.80	1.33
E	建筑业	6,876,312.00	1.47

F	批发和零售业	9,686,392.70	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	7,397,989.58	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,598,955.00	4.61
J	金融业	36,746,572.00	7.84
K	房地产业	2,998,881.00	0.64
L	租赁和商务服务业	4,362,753.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	1,700,575.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	1,578,207.40	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	504,810.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,947,823.00	1.27
S	综合	-	-
	合计	331,210,678.62	70.63

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	2,768,725.80	0.59
消费者非必需品	17,150,657.91	3.66
消费者常用品	2,258,280.02	0.48
能源	4,350,311.57	0.93
金融	10,153,063.09	2.17
医疗保健	6,569,341.26	1.40
工业	3,225,216.96	0.69
信息技术	6,275,821.03	1.34
电信服务	17,889,723.15	3.81
公用事业	1,085,968.30	0.23
地产业	1,604,503.07	0.34
合计	73,331,612.16	15.64

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	39,000	17,889,723.15	3.81
2	03690	美团-W	68,540	7,831,883.14	1.67
3	00388	香港交易所	13,200	5,041,405.51	1.08
4	600919	江苏银行	388,700	4,641,078.00	0.99
5	00981	中芯国际	100,000	4,076,416.50	0.87
6	300017	网宿科技	360,300	3,862,416.00	0.82

7	002414	高德红外	374,100	3,834,525.00	0.82
8	600166	福田汽车	1,410,300	3,821,913.00	0.82
9	300684	中石科技	158,500	3,784,980.00	0.81
10	300777	中简科技	104,200	3,777,250.00	0.81
11	301510	固高科技	124,700	3,747,235.00	0.80
12	002056	横店东磁	264,000	3,735,600.00	0.80
13	600998	九州通	724,300	3,722,902.00	0.79
14	002249	大洋电机	564,600	3,715,068.00	0.79
15	301507	民生健康	253,600	3,679,736.00	0.78
16	300014	亿纬锂能	79,500	3,641,895.00	0.78
17	688582	芯动联科	54,100	3,635,520.00	0.78
18	601138	工业富联	168,300	3,598,254.00	0.77
19	002913	奥士康	122,300	3,596,843.00	0.77
20	002624	完美世界	234,200	3,552,814.00	0.76
21	002706	良信股份	396,300	3,531,033.00	0.75
22	600499	科达制造	360,000	3,528,000.00	0.75
23	002701	奥瑞金	588,700	3,502,765.00	0.75
24	06181	老铺黄金	3,800	3,493,133.28	0.74
25	000975	山金国际	180,400	3,416,776.00	0.73
26	002080	中材科技	171,900	3,352,050.00	0.71
27	601208	东材科技	342,900	3,250,692.00	0.69
28	000988	华工科技	69,100	3,248,391.00	0.69
29	300850	新强联	88,300	3,162,906.00	0.67
30	600873	梅花生物	292,200	3,123,618.00	0.67
31	601319	中国人保	355,100	3,092,921.00	0.66
32	002487	大金重工	93,100	3,062,990.00	0.65
33	605305	中际联合	109,300	3,036,354.00	0.65
34	300079	数码视讯	518,500	3,033,225.00	0.65
35	000001	平安银行	250,100	3,018,707.00	0.64
36	601456	国联民生	194,400	2,012,040.00	0.43
36	01456	国联民生	255,500	1,006,573.93	0.21
37	600039	四川路桥	303,700	3,006,630.00	0.64
38	600490	鹏欣资源	659,100	2,893,449.00	0.62
39	000902	新洋丰	208,400	2,882,172.00	0.61
40	601989	中国重工	612,300	2,841,072.00	0.61
41	600933	爱柯迪	176,800	2,830,568.00	0.60
42	688629	华丰科技	49,140	2,810,808.00	0.60
43	300232	洲明科技	383,500	2,776,540.00	0.59
44	601229	上海银行	256,300	2,719,343.00	0.58
45	01530	三生制药	122,000	2,631,249.34	0.56
46	300959	线上线下	57,800	2,628,166.00	0.56
47	600866	星湖科技	379,800	2,624,418.00	0.56
48	688668	鼎通科技	41,500	2,592,090.00	0.55

49	603296	华勤技术	32,000	2,581,760.00	0.55
50	603766	隆鑫通用	198,000	2,526,480.00	0.54
51	601003	柳钢股份	715,400	2,518,208.00	0.54
52	601998	中信银行	181,000	1,538,500.00	0.33
52	00998	中信银行	141,000	961,815.43	0.21
53	601665	齐鲁银行	392,300	2,479,336.00	0.53
54	000553	安道麦 A	342,100	2,469,962.00	0.53
55	600188	兖矿能源	110,040	1,339,186.80	0.29
55	01171	兖矿能源	156,000	1,111,083.40	0.24
56	601088	中国神华	33,500	1,358,090.00	0.29
56	01088	中国神华	38,000	1,055,217.35	0.23
57	000425	徐工机械	304,400	2,365,188.00	0.50
58	600315	上海家化	110,700	2,332,449.00	0.50
59	601107	四川成渝	378,029	2,275,734.58	0.49
60	002736	国信证券	188,600	2,172,672.00	0.46
61	301260	格力博	109,300	2,155,396.00	0.46
62	688475	萤石网络	66,600	2,099,232.00	0.45
63	300496	中科创达	34,600	1,979,812.00	0.42
64	000783	长江证券	280,400	1,943,172.00	0.41
65	601328	交通银行	234,800	1,878,400.00	0.40
66	03998	波司登	428,000	1,811,059.74	0.39
67	688141	杰华特	54,700	1,782,126.00	0.38
68	688258	卓易信息	35,200	1,704,736.00	0.36
69	601919	中远海控	104,400	1,570,176.00	0.33
70	601225	陕西煤业	81,500	1,568,060.00	0.33
71	000100	TCL 科技	353,100	1,528,923.00	0.33
72	000987	越秀资本	221,100	1,516,746.00	0.32
73	300363	博腾股份	88,300	1,508,164.00	0.32
74	603379	三美股份	30,500	1,467,660.00	0.31
75	300843	胜蓝股份	45,700	1,448,233.00	0.31
76	601168	西部矿业	86,480	1,438,162.40	0.31
77	603167	渤海轮渡	124,100	1,414,740.00	0.30
78	600282	南钢股份	326,200	1,370,040.00	0.29
79	000983	山西焦煤	212,000	1,356,800.00	0.29
80	601019	山东出版	142,900	1,353,263.00	0.29
81	600461	洪城环境	139,700	1,346,708.00	0.29
82	000937	冀中能源	234,100	1,346,075.00	0.29
83	600153	建发股份	129,700	1,344,989.00	0.29
84	601928	凤凰传媒	120,300	1,343,751.00	0.29
85	600757	长江传媒	144,700	1,342,816.00	0.29
86	000157	中联重科	185,400	1,340,442.00	0.29
87	300770	新媒股份	33,500	1,339,665.00	0.29
88	600064	南京高科	173,000	1,333,830.00	0.28

89	600664	哈药股份	361,100	1,328,848.00	0.28
90	000932	华菱钢铁	302,000	1,328,800.00	0.28
91	601211	国泰海通	69,000	1,322,040.00	0.28
92	601169	北京银行	193,400	1,320,922.00	0.28
93	600729	重庆百货	44,200	1,318,486.00	0.28
94	000429	粤高速 A	98,600	1,314,338.00	0.28
95	601009	南京银行	113,100	1,314,222.00	0.28
96	601838	成都银行	65,300	1,312,530.00	0.28
97	601166	兴业银行	55,900	1,304,706.00	0.28
98	600755	厦门国贸	215,400	1,303,170.00	0.28
99	600502	XD 安徽建	275,900	1,296,730.00	0.28
100	601098	XD 中南传	98,600	1,293,632.00	0.28
101	605118	力鼎光电	50,600	1,256,398.00	0.27
102	301367	瑞迈特	14,600	1,227,860.00	0.26
103	300207	欣旺达	60,400	1,211,624.00	0.26
104	09992	泡泡玛特	4,800	1,167,004.18	0.25
105	600875	东方电气	68,400	1,145,016.00	0.24
106	02268	药明合联	30,000	1,138,113.60	0.24
107	02367	巨子生物	21,600	1,136,581.52	0.24
108	01882	海天国际	61,000	1,134,830.58	0.24
109	01952	云顶新耀	20,000	1,134,465.80	0.24
110	02145	上美股份	15,000	1,121,698.50	0.24
111	02469	粉笔	501,500	1,120,490.17	0.24
112	06869	长飞光纤光缆	57,500	1,116,910.76	0.24
113	01898	中煤能源	133,000	1,101,307.30	0.23
114	01816	中广核电力	446,000	1,085,968.30	0.23
115	00883	中国海洋石油	67,000	1,082,703.52	0.23
116	01810	小米集团-W	19,800	1,082,493.77	0.23
117	01801	信达生物	15,000	1,072,453.20	0.23
118	00564	郑煤机	78,800	1,067,864.27	0.23
119	01258	中国有色矿业	160,000	1,063,698.48	0.23
120	300990	同飞股份	21,300	1,062,870.00	0.23
121	600531	豫光金铅	136,400	1,055,736.00	0.23
122	02328	中国财险	76,000	1,053,484.64	0.22
123	02601	中国太保	42,800	1,047,994.70	0.22
124	06963	阳光保险	351,500	1,041,788.88	0.22
125	601061	中信金属	131,300	1,038,583.00	0.22
126	09699	顺丰同城	59,200	1,022,522.11	0.22
127	01787	山东黄金	41,000	1,018,876.14	0.22
128	601857	中国石油	117,400	1,003,770.00	0.21
129	01773	天立国际控股	235,000	972,959.46	0.21
130	002284	亚太股份	87,900	971,295.00	0.21
131	002434	万里扬	132,200	969,026.00	0.21

132	00817	中国金茂	870,000	944,141.84	0.20
133	601901	方正证券	114,700	907,277.00	0.19
134	002939	长城证券	107,900	904,202.00	0.19
135	603102	百合股份	21,000	884,730.00	0.19
136	002993	奥海科技	20,700	858,429.00	0.18
137	300767	震安科技	61,700	803,951.00	0.17
138	600861	北京人力	41,000	791,300.00	0.17
139	600728	佳都科技	141,300	770,085.00	0.16
140	600338	西藏珠峰	68,200	756,338.00	0.16
141	002362	汉王科技	33,100	742,102.00	0.16
142	002223	鱼跃医疗	19,400	690,640.00	0.15
143	01772	赣锋锂业	33,000	686,151.18	0.15
144	600109	国金证券	77,700	681,429.00	0.15
145	000729	燕京啤酒	52,200	674,946.00	0.14
146	02602	万物云	34,400	660,361.23	0.14
147	603328	依顿电子	66,000	647,460.00	0.14
148	600663	陆家嘴	71,300	631,718.00	0.13
149	002798	帝欧家居	94,800	628,524.00	0.13
150	688008	澜起科技	7,500	615,000.00	0.13
151	06160	百济神州	4,400	593,059.32	0.13
152	688578	艾力斯	6,300	586,152.00	0.12
153	300768	迪普科技	33,800	579,670.00	0.12
154	000715	中兴商业	100,390	575,234.70	0.12
155	301227	森鹰窗业	23,900	573,600.00	0.12
156	000823	超声电子	48,300	572,355.00	0.12
157	603818	曲美家居	110,700	568,998.00	0.12
158	002084	海鸥住工	159,100	564,805.00	0.12
159	603163	圣晖集成	19,800	564,498.00	0.12
160	605189	富春染织	45,110	560,266.20	0.12
161	002209	达意隆	44,500	558,475.00	0.12
162	600887	伊利股份	19,900	554,812.00	0.12
163	002940	昂利康	14,900	552,939.00	0.12
164	603982	泉峰汽车	49,900	552,892.00	0.12
165	603909	建发合诚	56,700	552,258.00	0.12
166	603269	海鸥股份	59,160	551,371.20	0.12
167	300509	新美星	64,400	551,264.00	0.12
168	300707	威唐工业	39,900	551,019.00	0.12
169	603617	君禾股份	76,700	549,939.00	0.12
170	300745	欣锐科技	28,700	547,883.00	0.12
171	300557	理工光科	20,280	547,560.00	0.12
172	002623	亚玛顿	33,900	547,485.00	0.12
173	603321	梅轮电梯	70,000	546,000.00	0.12
174	603051	鹿山新材	19,100	543,968.00	0.12

175	002682	龙洲股份	113,400	543,186.00	0.12
176	600969	郴电国际	76,000	542,640.00	0.12
177	002787	华源控股	66,400	542,488.00	0.12
178	002394	联发股份	65,900	542,357.00	0.12
179	002551	尚荣医疗	143,600	539,936.00	0.12
180	603208	江山欧派	34,400	539,392.00	0.12
181	002893	京能热力	50,400	538,776.00	0.11
182	301088	戎美股份	39,000	536,250.00	0.11
183	600128	苏豪弘业	49,000	535,080.00	0.11
184	002370	亚太药业	140,800	535,040.00	0.11
185	603238	诺邦股份	30,500	534,970.00	0.11
186	603221	爱丽家居	48,800	534,848.00	0.11
187	603378	亚士创能	88,200	534,492.00	0.11
188	002799	环球印务	61,800	532,716.00	0.11
189	301222	浙江恒威	18,300	532,713.00	0.11
190	300514	友讯达	37,800	532,224.00	0.11
191	300906	日月明	19,300	530,750.00	0.11
192	603808	歌力思	63,900	530,370.00	0.11
193	300196	长海股份	43,400	529,480.00	0.11
194	603176	汇通集团	110,300	529,440.00	0.11
195	301276	嘉曼服饰	29,080	528,965.20	0.11
196	603192	汇得科技	25,300	528,770.00	0.11
197	688419	耐科装备	14,180	528,630.40	0.11
198	002811	郑中设计	49,900	526,944.00	0.11
199	000757	浩物股份	116,300	526,839.00	0.11
200	301291	明阳电气	12,800	526,720.00	0.11
201	603829	洛凯股份	30,700	525,584.00	0.11
202	003023	彩虹集团	25,900	525,252.00	0.11
203	688485	九州一轨	48,200	524,898.00	0.11
204	600791	京能置业	110,900	524,557.00	0.11
205	301020	密封科技	24,000	523,920.00	0.11
206	002234	民和股份	64,200	523,230.00	0.11
207	603518	锦泓集团	52,900	522,652.00	0.11
208	688045	必易微	15,100	519,440.00	0.11
209	603681	永冠新材	34,600	517,962.00	0.11
210	001210	金房能源	37,680	515,839.20	0.11
211	001266	宏英智能	19,500	515,775.00	0.11
212	688338	赛科希德	20,420	514,175.60	0.11
213	688420	美腾科技	21,560	513,990.40	0.11
214	600249	两面针	88,900	513,842.00	0.11
215	301106	骏成科技	17,200	512,560.00	0.11
216	002674	兴业科技	51,100	510,489.00	0.11
217	000419	通程控股	89,600	509,824.00	0.11

218	688657	浩辰软件	12,000	509,640.00	0.11
219	301360	荣旗科技	10,600	509,436.00	0.11
220	002968	新大正	49,300	508,776.00	0.11
221	300883	龙利得	81,700	508,174.00	0.11
222	300703	创源股份	24,000	507,840.00	0.11
223	603180	金牌家居	26,000	506,220.00	0.11
224	300616	尚品宅配	38,400	505,728.00	0.11
225	600661	昂立教育	47,400	504,810.00	0.11
226	603201	常润股份	27,300	503,685.00	0.11
227	002671	龙泉股份	109,400	503,240.00	0.11
228	688597	煜邦电力	64,148	502,278.84	0.11
229	002687	乔治白	108,200	502,048.00	0.11
230	300621	维业股份	56,400	501,396.00	0.11
231	600333	长春燃气	103,100	501,066.00	0.11
232	600470	六国化工	80,300	500,269.00	0.11
233	000798	中水渔业	67,300	499,366.00	0.11
234	688448	磁谷科技	17,000	497,930.00	0.11
235	688115	思林杰	9,680	497,552.00	0.11
236	603878	武进不锈	91,300	494,846.00	0.11
237	301321	翰博高新	32,300	493,867.00	0.11
238	688370	丛麟科技	25,840	493,802.40	0.11
239	603810	丰山集团	30,300	492,981.00	0.11
240	001333	光华股份	24,100	492,845.00	0.11
241	001331	胜通能源	50,120	490,173.60	0.10
242	002330	得利斯	107,000	490,060.00	0.10
243	002790	瑞尔特	67,300	489,271.00	0.10
244	001358	兴欣新材	20,400	488,172.00	0.10
245	600573	惠泉啤酒	39,800	486,356.00	0.10
246	002864	盘龙药业	17,000	480,590.00	0.10
247	688455	科捷智能	34,060	479,224.20	0.10
248	002998	优彩资源	65,900	478,434.00	0.10
249	688210	统联精密	20,900	476,520.00	0.10
250	605169	洪通燃气	44,700	475,161.00	0.10
251	02331	李宁	30,500	470,620.92	0.10
252	603500	祥和实业	49,200	450,672.00	0.10
253	002916	深南电路	3,860	416,146.60	0.09
254	300811	铂科新材	8,900	413,049.00	0.09
255	301413	安培龙	5,400	412,830.00	0.09
256	601555	东吴证券	43,600	381,500.00	0.08
257	603233	大参林	23,200	378,160.00	0.08
258	688313	仕佳光子	9,800	372,890.00	0.08
259	600299	安迪苏	38,200	368,630.00	0.08
260	300573	兴齐眼药	6,920	358,386.80	0.08

261	002668	TCL 智家	35,800	349,766.00	0.07
262	300548	长芯博创	5,200	347,204.00	0.07
263	002970	锐明技术	7,000	345,800.00	0.07
264	600276	恒瑞医药	6,500	337,350.00	0.07
265	002846	英联股份	16,600	331,336.00	0.07
266	300870	欧陆通	2,600	328,900.00	0.07
267	603300	海南华铁	29,300	326,695.00	0.07
268	688607	康众医疗	17,300	324,375.00	0.07
269	688573	信宇人	9,300	321,780.00	0.07
270	688303	大全能源	15,000	319,800.00	0.07
271	301308	江波龙	3,600	314,964.00	0.07
272	688372	伟测科技	5,200	314,080.00	0.07
273	688300	联瑞新材	6,700	311,885.00	0.07
274	600398	海澜之家	44,700	311,112.00	0.07
275	603619	中曼石油	15,500	311,085.00	0.07
276	600674	川投能源	19,200	307,968.00	0.07
277	688499	利元亨	7,400	307,914.00	0.07
278	688458	美芯晟	6,500	306,540.00	0.07
279	000596	古井贡酒	2,300	306,245.00	0.07
280	600795	国电电力	62,800	303,952.00	0.06
281	300750	宁德时代	1,200	302,664.00	0.06
282	600057	厦门象屿	42,900	301,587.00	0.06
283	300450	先导智能	12,100	300,685.00	0.06
284	688170	德龙激光	11,900	299,880.00	0.06
285	688518	联赢激光	14,700	299,733.00	0.06
286	688199	久日新材	12,700	299,720.00	0.06
287	002395	双象股份	16,900	299,130.00	0.06
288	600055	万东医疗	17,300	298,944.00	0.06
289	301392	汇成真空	2,500	298,025.00	0.06
290	002286	保龄宝	26,300	297,979.00	0.06
291	300009	安科生物	35,600	297,972.00	0.06
292	603345	安井食品	3,700	297,554.00	0.06
293	600483	福能股份	30,800	296,912.00	0.06
294	688778	厦钨新能	5,300	296,376.00	0.06
295	688152	麒麟信安	6,300	295,218.00	0.06
296	603929	亚翔集成	8,400	294,840.00	0.06
297	301216	万凯新材	23,600	294,292.00	0.06
298	688503	聚和材料	7,100	293,869.00	0.06
299	002182	宝武镁业	24,000	293,760.00	0.06
300	600666	奥瑞德	81,500	293,400.00	0.06
301	600529	山东药玻	13,200	292,248.00	0.06
302	600732	爱旭股份	22,300	292,130.00	0.06
303	300308	中际旭创	2,000	291,720.00	0.06

304	601890	亚星锚链	28,500	290,415.00	0.06
305	688197	首药控股	8,000	289,600.00	0.06
306	600025	华能水电	30,300	289,365.00	0.06
307	000719	中原传媒	23,300	289,153.00	0.06
308	300457	赢合科技	12,500	287,500.00	0.06
309	605319	无锡振华	8,400	286,944.00	0.06
310	002179	中航光电	7,100	286,556.00	0.06
311	603281	江瀚新材	11,400	285,684.00	0.06
312	603086	先达股份	29,100	285,180.00	0.06
313	000728	国元证券	36,100	284,829.00	0.06
314	601595	上海电影	9,600	284,544.00	0.06
315	000768	中航西飞	10,400	284,336.00	0.06
316	300130	新国都	8,000	284,240.00	0.06
317	002027	分众传媒	38,800	283,240.00	0.06
318	603099	长白山	7,400	281,644.00	0.06
319	300037	新宙邦	8,000	281,600.00	0.06
320	688182	灿勤科技	10,200	281,112.00	0.06
321	603725	天安新材	32,600	280,360.00	0.06
322	688333	铂力特	4,700	279,932.00	0.06
323	603565	中谷物流	29,300	279,815.00	0.06
324	301323	新莱福	6,300	279,468.00	0.06
325	300633	开立医疗	9,400	279,368.00	0.06
326	001206	依依股份	13,300	279,300.00	0.06
327	301038	深水规院	16,700	278,890.00	0.06
328	000899	赣能股份	32,300	278,749.00	0.06
329	000963	华东医药	6,900	278,484.00	0.06
330	600570	恒生电子	8,300	278,382.00	0.06
331	300859	西域旅游	6,900	277,863.00	0.06
332	600170	上海建工	116,200	277,718.00	0.06
333	301511	德福科技	13,400	277,380.00	0.06
334	600746	江苏索普	35,500	277,255.00	0.06
335	000989	九芝堂	30,900	277,173.00	0.06
336	301165	锐捷网络	4,500	276,570.00	0.06
337	301219	腾远钴业	5,200	276,224.00	0.06
338	600536	中国软件	5,900	275,943.00	0.06
339	000403	派林生物	15,200	275,576.00	0.06
340	600900	长江电力	9,100	274,274.00	0.06
341	603776	永安行	13,600	274,040.00	0.06
342	603286	日盈电子	9,200	273,976.00	0.06
343	603567	珍宝岛	23,300	273,775.00	0.06
344	300085	银之杰	6,200	273,172.00	0.06
345	603444	吉比特	900	271,755.00	0.06
346	600367	红星发展	17,200	269,868.00	0.06

347	000408	藏格矿业	6,300	268,821.00	0.06
348	300698	万马科技	5,700	263,226.00	0.06
349	300206	理邦仪器	21,300	256,026.00	0.05
350	300972	万辰集团	1,400	252,336.00	0.05
351	301498	乖宝宠物	2,300	251,551.00	0.05
352	002497	雅化集团	21,800	248,520.00	0.05
353	002738	中矿资源	7,700	247,632.00	0.05
354	000623	吉林敖东	14,300	242,385.00	0.05
355	605598	上海港湾	11,000	235,070.00	0.05
356	01211	比亚迪股份	2,000	223,427.75	0.05
357	600987	航民股份	31,000	219,170.00	0.05
358	600160	巨化股份	7,400	212,232.00	0.05
359	001696	宗申动力	9,100	204,295.00	0.04
360	002815	崇达技术	16,800	190,344.00	0.04
361	300649	杭州园林	8,900	169,990.00	0.04
362	300628	亿联网络	4,800	166,848.00	0.04
363	688472	阿特斯	18,076	165,395.40	0.04
364	002407	多氟多	13,500	164,565.00	0.04
365	002517	恺英网络	7,500	144,825.00	0.03
366	002841	视源股份	3,900	134,940.00	0.03
367	300168	万达信息	16,900	129,623.00	0.03
368	605077	华康股份	7,700	124,586.00	0.03
369	605116	奥锐特	5,300	110,770.00	0.02
370	600578	京能电力	20,500	92,045.00	0.02
371	603083	剑桥科技	1,900	89,870.00	0.02
372	300738	奥飞数据	3,900	81,627.00	0.02
373	300627	华测导航	2,260	79,100.00	0.02
374	300611	美力科技	3,200	74,528.00	0.02
375	002938	鹏鼎控股	2,200	70,466.00	0.02
376	300119	瑞普生物	3,600	69,912.00	0.01
377	301018	申菱环境	1,800	68,292.00	0.01
378	09988	阿里巴巴-W	600	60,079.27	0.01
379	688775	影石创新	384	47,677.44	0.01
380	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
381	601900	南方传媒	2,600	40,664.00	0.01
382	301536	星辰科技	481	29,004.30	0.01
383	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
384	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
385	301277	新天地	1,324	19,025.88	0.00
386	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
387	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
388	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
389	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00

390	001388	C 信通电子	937	15,385.54	0.00
391	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
392	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.00
393	300926	博俊科技	500	13,235.00	0.00
394	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
395	002714	牧原股份	300	12,603.00	0.00
396	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
397	301381	赛维时代	600	11,970.00	0.00
398	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
399	605168	三人行	400	11,772.00	0.00
400	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
401	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
402	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
403	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
404	002636	金安国纪	1,000	9,480.00	0.00
405	603049	中策橡胶	213	9,127.05	0.00
406	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
407	300400	劲拓股份	500	8,420.00	0.00
408	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
409	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
410	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
411	603202	天有为	77	6,980.82	0.00
412	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
413	001359	平安电工	184	6,417.92	0.00
414	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
415	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
416	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
417	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
418	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
419	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
420	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
421	603409	XD 汇通控	100	3,332.00	0.00
422	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
423	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
424	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
425	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
426	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
427	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	00700	腾讯控股	23,517,208.61	6.26
2	002335	科华数据	20,370,662.00	5.43
3	00981	中芯国际	12,674,194.74	3.38
3	688981	中芯国际	3,925,771.09	1.05
4	300972	万辰集团	14,062,817.00	3.75
5	03690	美团-W	13,392,224.97	3.57
6	600941	中国移动	8,720,375.63	2.32
6	00941	中国移动	3,516,270.50	0.94
7	002847	盐津铺子	11,762,906.00	3.13
8	300502	新易盛	11,611,162.00	3.09
9	600292	远达环保	10,910,003.00	2.91
10	002487	大金重工	10,831,438.00	2.88
11	300395	菲利华	10,309,131.00	2.75
12	002624	完美世界	10,113,286.00	2.69
13	002345	潮宏基	9,475,003.00	2.52
14	601208	东材科技	9,471,210.00	2.52
15	300723	一品红	9,418,221.50	2.51
16	605208	永茂泰	9,235,133.25	2.46
17	601579	会稽山	9,128,922.98	2.43
18	000729	燕京啤酒	9,085,918.00	2.42
19	600938	中国海油	5,529,262.00	1.47
19	00883	中国海洋石油	3,490,601.87	0.93
20	300570	太辰光	8,968,060.00	2.39
21	000596	古井贡酒	8,935,379.00	2.38
22	000600	建投能源	8,816,515.00	2.35
23	300850	新强联	8,574,675.30	2.28
24	600861	北京人力	8,571,032.96	2.28
25	301280	珠城科技	8,474,908.00	2.26
26	002991	甘源食品	8,444,797.00	2.25
27	300731	科创新源	8,427,254.00	2.24
28	300014	亿纬锂能	8,358,549.00	2.23
29	600585	海螺水泥	8,330,429.84	2.22
30	605117	德业股份	8,257,253.20	2.20
31	000938	紫光股份	7,984,020.00	2.13
32	000063	中兴通讯	5,018,319.49	1.34
32	00763	中兴通讯	2,861,770.69	0.76
33	600027	华电国际	4,928,668.00	1.31
33	01071	华电国际电力股份	2,852,260.91	0.76
34	300765	新诺威	7,774,794.00	2.07
35	688196	卓越新能	7,721,404.78	2.06
36	600188	兖矿能源	6,520,111.30	1.74
36	01171	兖矿能源	1,111,336.46	0.30
37	601998	中信银行	5,228,805.00	1.39

37	00998	中信银行	2,377,364.27	0.63
38	002851	麦格米特	7,546,928.00	2.01
39	002838	道恩股份	7,539,852.75	2.01
40	603300	海南华铁	7,526,419.00	2.00
41	301210	金杨股份	7,511,961.48	2.00

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	03690	美团-W	21,215,749.18	5.65
2	002335	科华数据	20,747,035.99	5.53
3	01810	小米集团-W	15,710,646.67	4.18
4	300972	万辰集团	13,931,426.60	3.71
5	300502	新易盛	12,567,372.20	3.35
6	600941	中国移动	8,759,383.43	2.33
6	00941	中国移动	3,649,140.23	0.97
7	002847	盐津铺子	12,212,068.20	3.25
8	00285	比亚迪电子	11,637,468.01	3.10
9	00981	中芯国际	7,701,052.73	2.05
9	688981	中芯国际	3,843,891.02	1.02
10	00700	腾讯控股	10,781,813.43	2.87
11	600292	远达环保	10,694,339.00	2.85
12	300395	菲利华	10,387,948.00	2.77
13	000729	燕京啤酒	10,253,364.00	2.73
14	605117	德业股份	10,228,070.30	2.72
15	002345	潮宏基	9,938,277.07	2.65
16	000600	建投能源	9,827,400.00	2.62
17	09868	小鹏汽车-W	9,800,851.07	2.61
18	300723	一品红	9,488,734.00	2.53
19	601579	会稽山	9,337,315.00	2.49
20	601988	中国银行	9,243,542.00	2.46
21	601939	建设银行	9,168,834.00	2.44
22	301280	珠城科技	8,935,794.60	2.38
23	688041	海光信息	8,904,792.55	2.37
24	300570	太辰光	8,676,455.00	2.31
25	300731	科创新源	8,658,244.00	2.31
26	601998	中信银行	7,261,495.00	1.93
26	00998	中信银行	1,362,793.82	0.36
27	002991	甘源食品	8,590,546.00	2.29
28	000596	古井贡酒	8,574,250.00	2.28
29	000938	紫光股份	8,478,509.00	2.26
30	301210	金杨股份	8,434,669.44	2.25

31	601288	农业银行	8,350,648.00	2.22
32	600585	海螺水泥	8,321,239.00	2.22
33	600188	兖矿能源	8,240,151.15	2.19
34	605208	永茂泰	8,220,544.60	2.19
35	688182	灿勤科技	8,152,515.14	2.17
36	002838	道恩股份	8,069,424.45	2.15
37	300476	胜宏科技	8,052,951.00	2.14
38	300765	新诺威	8,022,109.80	2.14
39	601006	大秦铁路	7,997,916.00	2.13
40	01415	高伟电子	7,988,905.47	2.13
41	688123	聚辰股份	7,970,369.33	2.12
42	600901	江苏金租	7,967,814.00	2.12
43	002487	大金重工	7,958,835.00	2.12
44	002851	麦格米特	7,870,017.00	2.10
45	600027	华电国际	5,125,760.00	1.37
45	01071	华电国际电力股份	2,735,765.89	0.73
46	600938	中国海油	5,482,984.00	1.46
46	00883	中国海洋石油	2,360,506.03	0.63
47	000063	中兴通讯	4,925,243.00	1.31
47	00763	中兴通讯	2,767,243.10	0.74
48	688196	卓越新能	7,685,513.73	2.05
49	601169	北京银行	7,644,245.00	2.04
50	600861	北京人力	7,603,406.00	2.03
51	000915	华特达因	7,545,806.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,575,562,471.79
卖出股票收入（成交）总额	3,532,364,120.93

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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	1,178,658.79
2	应收清算款	1,480,924.87
3	应收股利	367,254.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	518,294.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,545,132.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧量化驱动混合 A	33,037	10,583.52	230,263,787.11	65.86%	119,383,864.12	34.14%
中欧量化驱动混合 C	44	667,775.23	28,971,346.16	98.60%	410,764.04	1.40%
合计	33,081	11,457.63	259,235,133.27	68.39%	119,794,628.16	31.61%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧量化驱动混合 A	292,410.16	0.08%
	中欧量化驱动混合 C	0.00	0.00%
	合计	292,410.16	0.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧量化驱动混合 A	10~50
	中欧量化驱动混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧量化驱动混合 A	0
	中欧量化驱动混合 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化驱动混合 A	中欧量化驱动混合 C
基金合同生效日 (2018 年 5 月 16 日) 基金份额总额	244,633,211.97	—
本报告期期初基金份额总额	309,949,872.18	14,799,253.98
本报告期基金总申购份额	115,776,499.95	40,784,762.79
减：本报告期基金总赎回份额	76,078,720.90	26,201,906.57
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	349,647,651.23	29,382,110.20

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无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
民生证券	2	1,285,177,811.40	18.09	571,202.86	18.24	-
华福证券	1	1,235,162,857.21	17.38	538,478.52	17.19	-
中泰证券	2	676,573,629.99	9.52	294,923.43	9.42	-
华源证券	1	601,620,600.51	8.47	262,252.21	8.37	-
国金证券	1	493,665,870.39	6.95	215,190.19	6.87	-
国盛证券	1	389,800,348.81	5.49	169,922.46	5.42	-
兴业证券	1	372,214,170.88	5.24	162,290.77	5.18	-
浙商证券	1	346,455,221.24	4.88	160,499.69	5.12	-
天风证券	1	248,798,022.92	3.50	108,455.70	3.46	-
东吴证券	1	201,347,903	2.83	87,769.28	2.80	-

		. 76				
东方证券	1	186, 271, 795 . 39	2. 62	87, 058. 12	2. 78	—
中信证券	4	172, 644, 004 . 43	2. 43	75, 823. 45	2. 42	本报告 期新增 2 个
国信证券	1	170, 526, 348 . 45	2. 40	74, 336. 91	2. 37	—
广发证券	1	169, 148, 298 . 60	2. 38	73, 741. 45	2. 35	—
国都证券	2	128, 339, 178 . 13	1. 81	55, 942. 18	1. 79	—
申万宏源 证券	1	126, 315, 911 . 37	1. 78	55, 064. 22	1. 76	—
财通证券	1	116, 994, 507 . 27	1. 65	58, 497. 25	1. 87	—
中信建投	1	108, 156, 193 . 66	1. 52	47, 144. 75	1. 51	—
东方财富	1	49, 275, 867. 38	0. 69	21, 480. 76	0. 69	—
中金公司	1	24, 790, 259. 23	0. 35	10, 806. 01	0. 34	本报告 期新增 1 个
国海证券	1	2, 827, 937. 7 8	0. 04	1, 413. 96	0. 05	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
国联民生	1	—	—	—	—	本报告 期新增 1 个
国泰海通	2	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
华安证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	本报告 期新增

						1 个
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

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。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券，国泰君安证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

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 (%)
民生证券	-	-	20,000,000.00	15.38	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	34,000,000.00	26.15	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	76,000,000.0 0	58.46	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 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。

3、本报告期内，海通证券变更为国泰海通证券，国泰君安证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

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
3	中欧量化驱动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
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	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别份额转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-24
6	中欧量化驱动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
7	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
8	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

9	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
10	中欧量化驱动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
11	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
12	中欧量化驱动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
13	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
14	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 01 月 13 日	73,091,107.09	0.00	0.00	73,091,107.09	19.28 %
	2	2025 年 06 月 13 日至 2025 年 06 月 30 日	0.00	88,411,005.87	0.00	88,411,005.87	23.33 %
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

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。

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