

中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 03 月 02 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧中证 1000 指数增强	
基金主代码	017919	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,171,729,343.70 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 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017919	017920
报告期末下属分级基金的份额总额	750,673,420.93 份	421,055,922.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。</p> <p>同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用公司量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。以争取实现指数增强型的目标。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中欧基金管理有限公司	招商证券股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	韩鑫普
	联系电话	021-68609600	0755-82943666
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95565	
传真	021-33830351	0755-82960794	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	
邮政编码	200120	518000	
法定代表人	窦玉明	霍达	

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-3,141,941.14	-2,569,185.73
本期利润	7,201,115.72	4,186,051.87
加权平均基金份额本期利润	0.0099	0.0091
本期加权平均净值利润率	1.00%	0.91%
本期基金份额净值增长率	0.95%	0.75%
3.1.2 期末数据和	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	

指标		
期末可供分配利润	-2,136,418.04	-2,027,195.96
期末可供分配基金份额利润	-0.0028	-0.0048
期末基金资产净值	757,816,919.29	424,220,540.39
期末基金份额净值	1.0095	1.0075
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.95%	0.75%

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

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

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

4、本基金合同自 2023 年 3 月 2 日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.38%	0.95%	0.59%	0.99%	1.79%	-0.04%
过去三个月	0.87%	0.79%	-3.77%	0.87%	4.64%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.95%	0.67%	-5.42%	0.85%	6.37%	-0.18%

注：本基金业绩比较基准为：中证 1000 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。

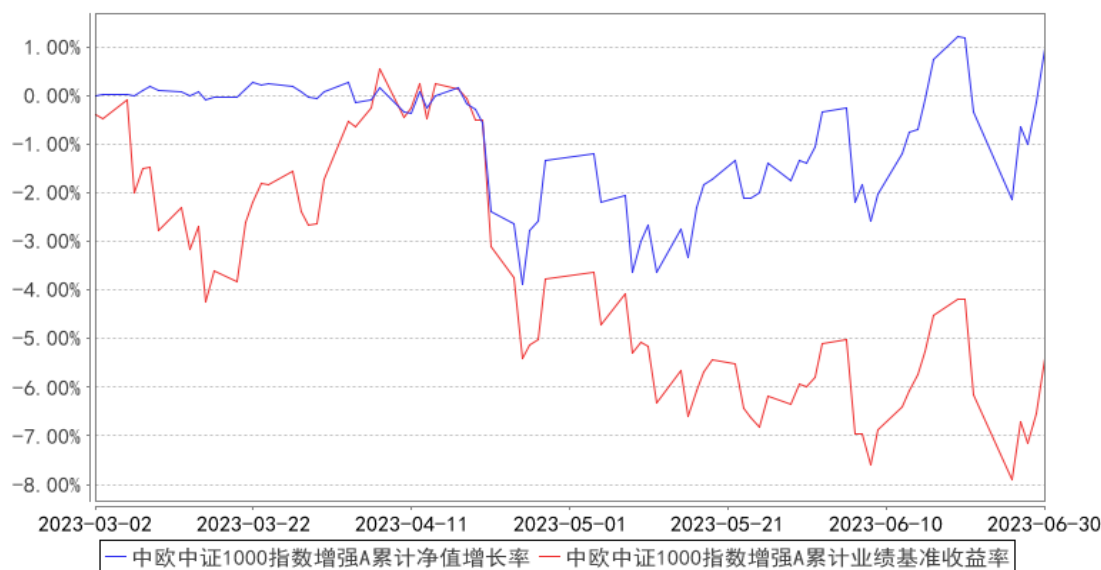
中欧中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.34%	0.95%	0.59%	0.99%	1.75%	-0.04%
过去三个月	0.71%	0.79%	-3.77%	0.87%	4.48%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.75%	0.67%	-5.42%	0.85%	6.17%	-0.18%

注：本基金业绩比较基准为：中证 1000 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。

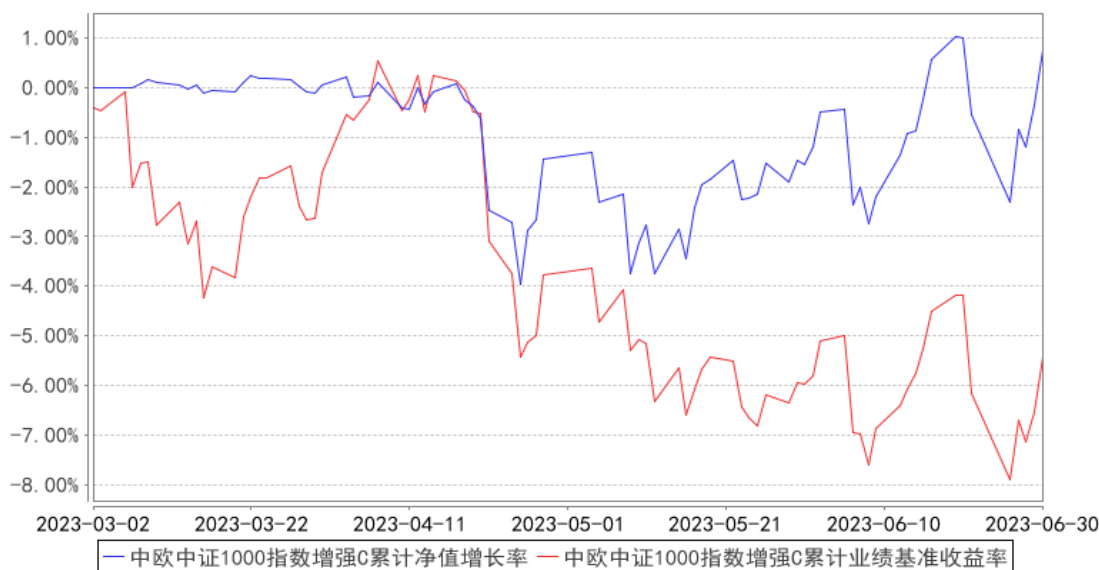
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 3 月 2 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应当符合基金合同约定。

中欧中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 3 月 2 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应当符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理	2023-03-02	-	7 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 69 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，市场先扬后抑，波动加剧。在宏观经济实现恢复性增长的背景下，各行业景气程度较为分化。非制造业 PMI 连续处于荣枯线上方，反映了消费和服务业的景气复苏强于制造业。在我国产业结构转型，高质量发展的大背景下，对于经济刺激的政策比较克制，没有进行大规模的低效投资，因此上游资源品需求不足，PPI 相对较弱，财政政策相对更加向战略新兴产业倾斜。展望下半年，我们当前的观点是“聚焦实业复苏，在短期波动中逢低布局”。

本基金是以中证 1000 指数为主要基准的指数增强产品。上半年里，我们按照“在小市值里寻找未来有业绩增长潜力，同时目前没有得到市场的充分认知的公司”的选股思路，重点在机械设备、医药生物、基础化工行业进行深入研究，但视野并不拘泥于这几个行业。我们在不同行业里用多个逻辑链条进行选股，一是关注前两年受到客观因素业绩下滑，今年恢复性增长的机会；二

是寻找子赛道处于周期底部，供给存在出清，格局变优的机会；三是筛选存在技术优势，具有国产替代空间或者符合新产业发展的机会。

投资操作层面，我们在成立后的两个月内稳步提升到满仓，交易时会充分考虑个股的流动性因素，当申购金额较大而流动性较差时用股指期货多单进行补仓来降低冲击成本。我们的投资方法是以企业下半年到一年的业绩为抓手，希望赚的是业绩持续景气，或者业绩的反转超过了市场预期，而带来的股价上涨的收益。是基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式。我们希望从基本面选股逻辑出发，在被主流投资市场疏漏的小盘领域选择质地优秀的公司，借助量化模型的高效率来实现价值发现的功能，并且在持股的过程中，陪伴公司成长。同时，我们加深了行业和个股基本面的研究深度，这有利于我们进一步提高投资的集中度。目前我们的投资分散程度跟传统量化策略比较相似，相比于主动基金还是过于分散。因此，在更深入理解基本面的基础上，提高投资的集中度，才能进一步提高超额收益的锐度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%；基金 C 类份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济可能会维持“弱复苏”的趋势，在权益资产中我们相对看好小盘成长风格。从历史复盘来看，大小盘风格和经济复苏的强度以及主导复苏的产业较为相关。当经济强劲复苏、传统产业主导的时期，大盘风格相对更加占优；当经济弱复苏、新兴产业技术进步较快时小盘风格相对更加占优。当前时期，经济复苏力度较弱，同时人工智能、新能源产业技术升级、工业自动化等新兴产业的活跃度高于传统周期产业，货币政策较为宽松，在这种宏观环境下我们认为小盘风格可能会更加占优，也更受益于经济转型、高质量发展的产业支持政策。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投

资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	151,079,546.34
结算备付金		4,448,047.56
存出保证金		12,113,438.40
交易性金融资产	6.4.7.2	1,028,023,531.64
其中: 股票投资		1,010,914,768.63
基金投资		-
债券投资		17,108,763.01
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		8,424,808.13
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	1.69
资产总计		1,204,089,373.76
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		13,001,336.09
应付清算款		-
应付赎回款		7,715,403.62
应付管理人报酬		910,574.49
应付托管费		91,057.47
应付销售服务费		222,045.79
应付投资顾问费		-
应交税费		0.05
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	6.4.7.6	111,496.57
负债合计		22,051,914.08
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	1,171,729,343.70
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	10,308,115.98
净资产合计		1,182,037,459.68
负债和净资产总计		1,204,089,373.76

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,171,729,343.70 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0095 元，基金份额总额 750,673,420.93 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0075 元，基金份额总额 421,055,922.77 份。

2. 本基金基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,620,577.79
1. 利息收入		2,659,440.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,441,037.20
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		1,218,402.07
证券出借利息收入		1.64
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,189,698.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,494,711.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	40,816.45
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	-33,994.82
股利收益	6.4.7.14	7,298,191.00
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	17,098,294.46

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	52, 540. 81
减：二、营业总支出		5, 233, 410. 20
1. 管理人报酬		3, 863, 810. 62
2. 托管费		386, 381. 07
3. 销售服务费		902, 681. 02
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		7, 926. 89
其中：卖出回购金融资产支出		7, 926. 89
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	72, 610. 60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 387, 167. 59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 387, 167. 59
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11, 387, 167. 59

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1, 227, 306, 584. 43	-	-	1, 227, 306, 584. 43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-55, 577, 240. 73	-	10, 308, 115. 98	-45, 269, 124. 75
（一）、综合收益总额	-	-	11, 387, 167. 59	11, 387, 167. 59
（二）、本期基金份额交易产生的	-55, 577, 240. 73	-	-1, 079, 051. 61	-56, 656, 292. 34

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中：1. 基金申 购款	571,761,507.21	-	-7,577,737.80	564,183,769.41
2. 基金赎 回款	-627,338,747.9 4	-	6,498,686.19	-620,840,061.75
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	1,171,729,343. 70	-	10,308,115.98	1,182,037,459.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]275 号文《关于准予中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,227,079,276.03 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61362990_B09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,227,306,584.43 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 227,308.40 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 754,558,392.41

份，包含认购利息折合 137,183.25 份；C 类基金的基金份额总额为 472,748,192.02 份，包含认购利息折合 90,125.15 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品（不含合约类）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 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自 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 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，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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‰；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计

税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

税：

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

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	106,111,203.39
等于：本金	106,099,618.10
加：应计利息	11,585.29
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	44,968,342.95
等于：本金	44,963,083.47
加：应计利息	5,259.48
减：坏账准备	-
合计	151,079,546.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	995,355,828.17	-	1,010,914,768.63	15,558,940.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	17,029,426.00	78,263.01	17,108,763.01	1,074.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,029,426.00	78,263.01	17,108,763.01	1,074.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,012,385,254.17	78,263.01	1,028,023,531.64	15,560,014.46

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 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	99,407,040.00	-	-	
其中：股指期货投资	99,407,040.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	99,407,040.00	-	-	

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
IM2308	IM2308	63.00	82,643,400.00	1,252,760.00
IM2309	IM2309	14.00	18,301,920.00	285,520.00
合计				1,538,280.00
减：可抵销期货暂收款				1,538,280.00
净额				0.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1.69
待摊费用	-
合计	1.69

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	40,086.00
预提费用-审计费	31,738.30
预提费用-信息披露费	39,672.27
合计	111,496.57

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	754,558,392.41	754,558,392.41
本期申购	164,401,480.78	164,401,480.78
本期赎回（以“-”号填列）	-168,286,452.26	-168,286,452.26
本期末	750,673,420.93	750,673,420.93

中欧中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	472,748,192.02	472,748,192.02
本期申购	407,360,026.43	407,360,026.43
本期赎回（以“-”号填列）	-459,052,295.68	-459,052,295.68
本期末	421,055,922.77	421,055,922.77

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 2023 年 3 月 2 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,227,306,584.43 份（其中 A 类为 754,558,392.41 份，C 类为 472,748,192.02 份），其中认购利息折合 227,308.40 份基金份额（其中 A 类为 137,183.25 份，C 类为 90,125.15 份）。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,141,941.14	10,343,056.86	7,201,115.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,005,523.10	-1,063,140.46	-57,617.36
其中：基金申购款	-684,144.57	-995,958.59	-1,680,103.16
基金赎回款	1,689,667.67	-67,181.87	1,622,485.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,136,418.04	9,279,916.40	7,143,498.36

中欧中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,569,185.73	6,755,237.60	4,186,051.87
本期基金份额交易产生的变动数	541,989.77	-1,563,424.02	-1,021,434.25
其中：基金申购款	-4,987,847.80	-909,786.84	-5,897,634.64
基金赎回款	5,529,837.57	-653,637.18	4,876,200.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,027,195.96	5,191,813.58	3,164,617.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	648,947.74
定期存款利息收入	649,222.22
其他存款利息收入	135,666.46
结算备付金利息收入	7,200.78
其他	-
合计	1,441,037.20

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6

	月 30 日
卖出股票成交总额	2,227,985,605.64
减：卖出股票成本总额	2,232,978,232.37
减：交易费用	5,502,084.29
买卖股票差价收入	-10,494,711.02

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	40,816.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	40,816.45

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	本期收益金额 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股指期货投资收益	-33,994.82

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,298,191.00
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	7,298,191.00

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,560,014.46
股票投资	15,558,940.46
债券投资	1,074.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,538,280.00
权证投资	-
期货投资	1,538,280.00
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	17,098,294.46

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	52,537.84
基金转换费收入	2.97
合计	52,540.81

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	31,738.30
信息披露费	39,672.27
证券出借违约金	-
开户费	1,200.00
存托服务费	0.03
合计	72,610.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：

WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）

招商证券	1,137,436,058.49	20.85
------	------------------	-------

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
招商证券	1,024,105,000.00	28.74

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券	592,917.32	20.85	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月2日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	1,412,331.38

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核

对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、本基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	386,381.07

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、本基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C	合计
国都证券	-	97.57	97.57
招商证券	-	74,535.26	74,535.26
中欧财富	-	22.62	22.62
合计	-	74,655.45	74,655.45

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

2、本基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，故无上年度可比期间数据。

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

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	106,111,203.39	648,947.74

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600530	交大昂立	2023 年 5 月 4 日	重大事项停牌	2.49	2023 年 7 月 5 日	2.37	81,000	275,726.00	201,690.00	-

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 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 13,001,336.09 元，于 2023 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600129	太极集团	2023 年 7 月 6 日	59.49	1,000	59,490.00
合计	-	-	-	-	1,000	59,490.00

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，其预期风险及预期收益高于货币市场基金、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。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理和风险控制，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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于开放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发行的证券不得超过该证券的 10%。在开放期，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 2022 年 06 月 34 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、公开募集的证券投资基金、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，

证券投资基金可在基金销售机构申购、赎回，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	151,079,546.34	-	-	-	151,079,546.34
结算备付金	4,448,047.56	-	-	-	4,448,047.56
存出保证金	-	-	-	12,113,438.40	12,113,438.40
交易性金融资产	17,108,763.01	-	-	1,010,914,768.63	1,028,023,531.64
应收申购款	-	-	-	8,424,808.13	8,424,808.13
其他资产	-	-	-	1.69	1.69
资产总计	172,636,356.91	-	-	1,031,453,016.85	1,204,089,373.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,715,403.62	7,715,403.62
应付管理人报酬	-	-	-	910,574.49	910,574.49
应付托管费	-	-	-	91,057.47	91,057.47
卖出回购金融资产款	13,001,336.09	-	-	-	13,001,336.09
应付销售服务费	-	-	-	222,045.79	222,045.79
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	111,496.57	111,496.57
负债总计	13,001,336.09	-	-	9,050,577.99	22,051,914.08
利率敏感度缺口	159,635,020.82	-	-	1,022,402,438.86	1,182,037,459.68

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 1.45%（2022 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,010,914,768.63	85.52
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	1,010,914,768.63	85.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	38,747,148.40
	业绩比较基准下降 5%	-38,747,148.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	1,010,713,078.63
第二层次	17,310,453.01
第三层次	-
合计	1,028,023,531.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,010,914,768.63	83.96
	其中：股票	1,010,914,768.63	83.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,108,763.01	1.42
	其中：债券	17,108,763.01	1.42

	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	155,527,593.90	12.92
8	其他各项资产	20,538,248.22	1.71
9	合计	1,204,089,373.76	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	10,939,638.00	0.93
B	采矿业	6,674,105.00	0.56
C	制造业	580,117,645.03	49.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,927,752.00	0.25
E	建筑业	16,480,500.00	1.39
F	批发和零售业	21,732,484.00	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	11,288,472.00	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,628,898.67	8.51
J	金融业	2,754,029.50	0.23
K	房地产业	3,634,740.00	0.31
L	租赁和商务服务业	3,310,332.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	2,167,375.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,638,842.00	0.22
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	9,190,399.00	0.78
S	综合	7,797,426.14	0.66
	合计	782,282,638.34	66.18

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	598,482.00	0.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	173,094,502.43	14.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,121,379.00	0.09
E	建筑业	5,165,204.00	0.44
F	批发和零售业	3,485,484.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	10,770,735.50	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,568,398.92	1.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,896,202.50	0.25
M	科学研究和技术服务业	5,413,345.94	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	5,431,188.00	0.46
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	543,168.00	0.05
S	综合	544,040.00	0.05
	合计	228,632,130.29	19.34

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	002126	银轮股份	600,500	10,628,850.00	0.90
2	603187	海容冷链	497,460	9,944,225.40	0.84
3	002851	麦格米特	267,200	9,744,784.00	0.82
4	603896	寿仙谷	218,300	9,670,690.00	0.82

5	688556	高测股份	177,047	9,408,277.58	0.80
6	002639	雪人股份	1,088,300	9,065,539.00	0.77
7	603985	恒润股份	422,100	8,851,437.00	0.75
8	002239	奥特佳	3,293,064	8,792,480.88	0.74
9	001696	宗申动力	1,231,000	8,715,480.00	0.74
10	605338	巴比食品	345,100	8,713,775.00	0.74
11	300263	隆华科技	1,039,300	8,646,976.00	0.73
12	002097	山河智能	1,287,000	8,558,550.00	0.72
13	603959	百利科技	738,800	8,496,200.00	0.72
14	002218	拓日新能	1,753,700	8,417,760.00	0.71
15	300348	长亮科技	802,625	8,379,405.00	0.71
16	000030	富奥股份	1,655,800	8,345,232.00	0.71
17	002234	民和股份	456,800	8,318,328.00	0.70
18	300762	上海瀚讯	695,400	8,184,858.00	0.69
19	000982	中银绒业	5,227,800	7,946,256.00	0.67
20	688148	芳源股份	639,875	7,806,475.00	0.66
21	600770	综艺股份	1,384,978	7,797,426.14	0.66
22	603530	神马电力	500,200	7,778,110.00	0.66
23	300123	亚光科技	1,066,598	7,764,833.44	0.66
24	688277	天智航	419,583	7,737,110.52	0.65
25	002123	梦网科技	577,400	7,673,646.00	0.65
26	600569	安阳钢铁	3,838,600	7,638,814.00	0.65
27	600720	祁连山	670,200	7,620,174.00	0.64
28	601515	东风股份	1,707,500	7,478,850.00	0.63
29	600811	东方集团	3,318,900	7,434,336.00	0.63
30	605388	均瑶健康	573,900	7,294,269.00	0.62
31	002891	中宠股份	301,500	7,278,210.00	0.62
32	688575	亚辉龙	374,475	6,909,063.75	0.58
33	688158	优刻得	329,827	6,227,133.76	0.53
34	003012	东鹏控股	728,200	5,891,138.00	0.50
35	601137	博威合金	373,500	5,811,660.00	0.49
36	000829	天音控股	626,100	5,659,944.00	0.48
37	002106	莱宝高科	654,400	5,562,400.00	0.47
38	300131	英唐智控	1,056,200	5,545,050.00	0.47
39	300942	易瑞生物	442,000	5,520,580.00	0.47
40	603010	万盛股份	507,200	5,513,264.00	0.47
41	605199	葫芦娃	363,300	5,500,362.00	0.47
42	002017	东信和平	418,860	5,491,254.60	0.46
43	002243	力合科创	644,500	5,484,695.00	0.46
44	000612	焦作万方	1,122,400	5,432,416.00	0.46
45	000789	万年青	699,600	5,421,900.00	0.46
46	603881	数据港	239,380	5,407,594.20	0.46
47	300687	赛意信息	192,800	5,355,984.00	0.45

48	300443	金雷股份	150,621	5,339,514.45	0.45
49	300747	锐科激光	173,500	5,288,280.00	0.45
50	002979	雷赛智能	220,833	5,246,992.08	0.44
51	000828	东莞控股	572,000	5,233,800.00	0.44
52	600984	建设机械	1,125,144	5,085,650.88	0.43
53	600400	红豆股份	1,512,800	4,961,984.00	0.42
54	002367	康力电梯	540,600	4,935,678.00	0.42
55	300180	华峰超纤	1,348,100	4,866,641.00	0.41
56	600990	四创电子	152,896	4,837,629.44	0.41
57	603466	风语筑	345,400	4,801,060.00	0.41
58	002768	国恩股份	198,400	4,799,296.00	0.41
59	002950	奥美医疗	461,500	4,790,370.00	0.41
60	300485	赛升药业	466,300	4,770,249.00	0.40
61	000813	德展健康	1,617,700	4,756,038.00	0.40
62	002283	天润工业	734,000	4,712,280.00	0.40
63	300055	万邦达	652,900	4,700,880.00	0.40
64	002993	奥海科技	138,580	4,700,633.60	0.40
65	603601	再升科技	1,100,200	4,697,854.00	0.40
66	002589	瑞康医药	1,370,200	4,658,680.00	0.39
67	603105	芯能科技	275,600	4,654,884.00	0.39
68	002859	洁美科技	168,000	4,653,600.00	0.39
69	300455	康拓红外	401,800	4,600,610.00	0.39
70	600477	杭萧钢构	1,101,900	4,506,771.00	0.38
71	601700	风范股份	842,300	4,472,613.00	0.38
72	000657	中钨高新	459,030	4,448,000.70	0.38
73	600490	鹏欣资源	1,207,700	4,444,336.00	0.38
74	688085	三友医疗	168,639	4,428,460.14	0.37
75	002130	沃尔核材	543,000	4,409,160.00	0.37
76	600285	羚锐制药	274,100	4,402,046.00	0.37
77	688037	芯源微	25,389	4,340,249.55	0.37
78	300672	国科微	51,600	4,300,860.00	0.36
79	002063	远光软件	492,120	4,271,601.60	0.36
80	603876	鼎胜新材	217,140	4,166,916.60	0.35
81	002446	盛路通信	417,800	3,948,210.00	0.33
82	002558	巨人网络	218,600	3,919,498.00	0.33
83	600458	时代新材	325,900	3,907,541.00	0.33
84	601208	东材科技	303,600	3,855,720.00	0.33
85	688262	国芯科技	91,747	3,733,185.43	0.32
86	002929	润建股份	84,400	3,663,804.00	0.31
87	688066	航天宏图	60,122	3,661,429.80	0.31
88	300034	钢研高纳	92,500	3,643,575.00	0.31
89	002389	航天彩虹	163,900	3,640,219.00	0.31
90	603609	禾丰股份	400,000	3,640,000.00	0.31

91	600266	城建发展	715,500	3,634,740.00	0.31
92	002984	森麒麟	115,200	3,624,192.00	0.31
93	603305	旭升集团	129,860	3,619,198.20	0.31
94	688023	安恒信息	20,684	3,613,701.64	0.31
95	300226	上海钢联	111,240	3,604,176.00	0.30
96	603169	兰石重装	484,100	3,601,704.00	0.30
97	002544	普天科技	156,500	3,583,850.00	0.30
98	300502	新易盛	52,380	3,560,268.60	0.30
99	300456	赛微电子	143,800	3,520,224.00	0.30
100	600835	上海机电	204,100	3,506,438.00	0.30
101	688326	经纬恒润	24,131	3,484,275.09	0.29
102	300315	掌趣科技	445,400	3,474,120.00	0.29
103	003031	中瓷电子	26,000	3,461,120.00	0.29
104	002151	北斗星通	97,300	3,421,068.00	0.29
105	300451	创业慧康	407,900	3,418,202.00	0.29
106	002006	精功科技	156,300	3,371,391.00	0.29
107	300036	超图软件	141,900	3,364,449.00	0.28
108	600572	康恩贝	479,700	3,285,945.00	0.28
109	000032	深桑达 A	99,800	3,283,420.00	0.28
110	600729	重庆百货	103,200	3,244,608.00	0.27
111	603179	新泉股份	73,400	3,221,526.00	0.27
112	300068	南都电源	166,000	3,213,760.00	0.27
113	688198	佰仁医疗	30,256	3,210,464.16	0.27
114	002865	钧达股份	20,817	3,175,217.01	0.27
115	002472	双环传动	87,400	3,172,620.00	0.27
116	002088	鲁阳节能	170,600	3,145,864.00	0.27
117	601702	华峰铝业	229,200	3,135,456.00	0.27
118	688007	光峰科技	149,603	3,119,222.55	0.26
119	001269	欧晶科技	42,100	3,095,613.00	0.26
120	605123	派克新材	28,454	3,091,527.10	0.26
121	600583	海油工程	525,500	3,074,175.00	0.26
122	600587	新华医疗	86,700	3,063,111.00	0.26
123	002832	比音勒芬	86,200	3,052,342.00	0.26
124	300613	富瀚微	53,500	3,035,590.00	0.26
125	600612	老凤祥	43,100	3,011,828.00	0.25
126	603128	华贸物流	325,000	2,960,750.00	0.25
127	300910	瑞丰新材	58,590	2,947,077.00	0.25
128	688088	虹软科技	67,585	2,889,258.75	0.24
129	002212	天融信	295,700	2,868,290.00	0.24
130	300573	兴齐眼药	13,300	2,843,540.00	0.24
131	002517	恺英网络	180,200	2,836,348.00	0.24
132	688239	航宇科技	40,227	2,813,878.65	0.24
133	002262	恩华药业	89,500	2,759,285.00	0.23

134	300002	神州泰岳	195,900	2,742,600.00	0.23
135	600129	太极集团	45,900	2,730,591.00	0.23
136	603129	春风动力	16,400	2,655,160.00	0.22
137	600323	瀚蓝环境	139,400	2,638,842.00	0.22
138	603368	柳药集团	106,200	2,624,202.00	0.22
139	000917	电广传媒	358,800	2,622,828.00	0.22
140	603477	巨星农牧	78,600	2,621,310.00	0.22
141	002011	盾安环境	188,900	2,612,487.00	0.22
142	300133	华策影视	363,600	2,577,924.00	0.22
143	300811	铂科新材	43,220	2,568,996.80	0.22
144	688127	蓝特光学	127,393	2,245,938.59	0.19
145	002541	鸿路钢构	77,200	2,224,132.00	0.19
146	688800	瑞可达	35,685	2,217,822.75	0.19
147	603018	华设集团	247,700	2,167,375.00	0.18
148	002174	游族网络	129,000	2,167,200.00	0.18
149	000923	河钢资源	160,000	2,160,000.00	0.18
150	600557	康缘药业	78,100	2,144,626.00	0.18
151	002918	蒙娜丽莎	137,100	2,116,824.00	0.18
152	002605	姚记科技	40,600	1,885,058.00	0.16
153	000681	视觉中国	98,500	1,811,415.00	0.15
154	300662	科锐国际	50,500	1,786,185.00	0.15
155	688608	恒玄科技	14,737	1,783,619.11	0.15
156	300459	汤姆猫	262,900	1,706,221.00	0.14
157	600420	国药现代	141,600	1,598,664.00	0.14
158	000690	宝新能源	227,600	1,597,752.00	0.14
159	600602	云赛智联	105,100	1,582,806.00	0.13
160	603871	嘉友国际	99,400	1,561,574.00	0.13
161	000989	九芝堂	112,800	1,561,152.00	0.13
162	300856	科思股份	19,800	1,559,646.00	0.13
163	603997	继峰股份	109,000	1,558,700.00	0.13
164	688106	金宏气体	57,111	1,553,419.20	0.13
165	603713	密尔克卫	17,200	1,532,348.00	0.13
166	000915	华特达因	43,400	1,531,586.00	0.13
167	603300	华铁应急	279,660	1,524,147.00	0.13
168	688568	中科星图	18,832	1,517,482.56	0.13
169	000848	承德露露	170,400	1,508,040.00	0.13
170	002332	仙琚制药	113,700	1,506,525.00	0.13
171	300820	英杰电气	18,000	1,482,840.00	0.13
172	300723	一品红	50,050	1,466,465.00	0.12
173	300803	指南针	29,700	1,443,123.00	0.12
174	603979	金诚信	46,300	1,439,930.00	0.12
175	688232	新点软件	26,453	1,423,435.93	0.12
176	688639	华恒生物	15,369	1,390,587.12	0.12

177	600929	雪天盐业	172,800	1,372,032.00	0.12
178	601882	海天精工	41,100	1,368,630.00	0.12
179	601126	四方股份	88,700	1,347,353.00	0.11
180	688278	特宝生物	30,585	1,342,987.35	0.11
181	688050	爱博医疗	6,499	1,334,439.67	0.11
182	000860	顺鑫农业	39,600	1,334,124.00	0.11
183	600452	涪陵电力	62,500	1,330,000.00	0.11
184	002643	万润股份	76,000	1,323,160.00	0.11
185	688235	百济神州	12,077	1,317,721.47	0.11
186	601528	瑞丰银行	270,290	1,310,906.50	0.11
187	002292	奥飞娱乐	129,400	1,291,412.00	0.11
188	600685	中船防务	42,800	1,281,860.00	0.11

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	300127	银河磁体	469,800	8,517,474.00	0.72
2	000903	云内动力	3,470,567	8,190,538.12	0.69
3	603960	克来机电	431,000	8,038,150.00	0.68
4	002437	誉衡药业	3,720,700	7,962,298.00	0.67
5	300318	博晖创新	1,426,900	7,719,529.00	0.65
6	002965	祥鑫科技	101,300	5,640,384.00	0.48
7	300219	鸿利智汇	764,400	5,618,340.00	0.48
8	002449	国星光电	626,800	5,572,252.00	0.47
9	603068	博通集成	192,900	5,520,798.00	0.47
10	000910	大亚圣象	699,600	5,463,876.00	0.46
11	300867	圣元环保	311,600	5,431,188.00	0.46
12	000507	珠海港	980,900	5,424,377.00	0.46
13	300791	仙乐健康	186,000	5,401,440.00	0.46
14	603338	浙江鼎力	92,600	5,186,526.00	0.44
15	002042	华孚时尚	1,646,900	5,171,266.00	0.44
16	600590	泰豪科技	684,300	4,879,059.00	0.41
17	300326	凯利泰	735,400	4,780,100.00	0.40
18	300439	美康生物	421,000	4,761,510.00	0.40
19	300177	中海达	701,600	4,749,832.00	0.40
20	300872	天阳科技	300,100	4,663,554.00	0.39
21	002930	宏川智慧	199,290	4,537,833.30	0.38
22	300659	中孚信息	215,400	4,376,928.00	0.37
23	688550	瑞联新材	35,346	1,399,701.60	0.12
24	603255	鼎际得	27,500	1,395,900.00	0.12
25	002917	金奥博	110,300	1,363,308.00	0.12
26	002957	科瑞技术	65,700	1,331,739.00	0.11
27	688305	科德数控	13,208	1,324,234.08	0.11
28	301312	智立方	12,400	1,316,384.00	0.11

29	688569	铁科轨道	30,796	1,295,587.72	0.11
30	603859	能科科技	25,200	1,288,476.00	0.11
31	688143	长盈通	33,442	1,260,763.40	0.11
32	688291	金橙子	39,818	1,260,637.88	0.11
33	603076	乐惠国际	26,300	1,257,403.00	0.11
34	300842	帝科股份	13,500	1,234,440.00	0.10
35	301068	大地海洋	36,600	1,230,126.00	0.10
36	300839	博汇股份	92,440	1,228,527.60	0.10
37	301257	普蕊斯	21,800	1,225,160.00	0.10
38	688687	凯因科技	41,300	1,218,350.00	0.10
39	002833	弘亚数控	61,700	1,213,022.00	0.10
40	300349	金卡智能	87,100	1,208,948.00	0.10
41	603811	诚意药业	96,940	1,204,964.20	0.10
42	000534	万泽股份	71,500	1,199,055.00	0.10
43	603163	圣晖集成	26,100	1,196,163.00	0.10
44	301162	国能日新	15,000	1,183,200.00	0.10
45	300280	紫天科技	24,700	1,179,919.00	0.10
46	301030	仕净科技	16,900	1,167,790.00	0.10
47	603667	五洲新春	78,400	1,166,592.00	0.10
48	605598	上海港湾	22,100	1,163,786.00	0.10
49	002046	国机精工	91,100	1,162,436.00	0.10
50	688621	阳光诺和	19,717	1,159,753.94	0.10
51	603676	卫信康	83,800	1,158,116.00	0.10
52	603516	淳中科技	52,500	1,157,625.00	0.10
53	300795	米奥会展	27,750	1,157,452.50	0.10
54	300407	凯发电气	126,700	1,156,771.00	0.10
55	300161	华中数控	21,600	1,156,032.00	0.10
56	603778	乾景园林	213,500	1,152,900.00	0.10
57	300951	博硕科技	21,100	1,152,693.00	0.10
58	002345	潮宏基	146,500	1,151,490.00	0.10
59	300996	普联软件	37,420	1,148,794.00	0.10
60	300592	华凯易佰	42,200	1,148,684.00	0.10
61	600488	津药药业	201,700	1,133,554.00	0.10
62	002469	三维化学	184,300	1,133,445.00	0.10
63	301286	侨源股份	38,300	1,129,850.00	0.10
64	301085	亚康股份	16,000	1,128,640.00	0.10
65	603889	新澳股份	149,820	1,125,148.20	0.10
66	002039	黔源电力	79,700	1,121,379.00	0.09
67	600686	金龙汽车	137,184	1,116,677.76	0.09
68	688378	奥来德	22,497	1,111,351.80	0.09
69	688292	浩瀚深度	38,577	1,107,159.90	0.09
70	605016	百龙创园	44,260	1,095,877.60	0.09
71	605289	罗曼股份	28,500	1,091,835.00	0.09

72	605128	上海沿浦	26,900	1,089,719.00	0.09
73	688258	卓易信息	16,238	1,083,561.74	0.09
74	688601	力芯微	22,916	1,079,343.60	0.09
75	605377	华旺科技	59,300	1,070,365.00	0.09
76	688103	国力股份	17,802	1,066,517.82	0.09
77	300389	艾比森	43,900	894,243.00	0.08
78	002338	奥普光电	20,900	880,935.00	0.07
79	603209	兴通股份	38,120	808,525.20	0.07
80	688697	纽威数控	29,166	753,357.78	0.06
81	301004	嘉益股份	18,200	706,160.00	0.06
82	688566	吉贝尔	17,978	701,321.78	0.06
83	688393	安必平	20,387	682,964.50	0.06
84	000521	长虹美菱	88,800	678,432.00	0.06
85	300586	美联新材	51,600	666,156.00	0.06
86	688668	鼎通科技	6,805	665,529.00	0.06
87	688255	凯尔达	19,475	659,423.50	0.06
88	300275	梅安森	46,940	652,466.00	0.06
89	000962	东方钽业	52,700	645,575.00	0.05
90	688308	欧科亿	15,966	638,640.00	0.05
91	300729	乐歌股份	35,600	635,104.00	0.05
92	603867	新化股份	15,600	631,800.00	0.05
93	300539	横河精密	42,400	627,944.00	0.05
94	002940	昂利康	32,655	627,302.55	0.05
95	601339	百隆东方	111,000	621,600.00	0.05
96	688078	龙软科技	12,000	618,600.00	0.05
97	003029	吉大正元	18,800	610,060.00	0.05
98	603165	荣晟环保	38,000	609,520.00	0.05
99	688768	容知日新	7,610	607,810.70	0.05
100	300779	惠城环保	11,400	607,506.00	0.05
101	600327	大东方	130,400	606,360.00	0.05
102	300622	博士眼镜	25,500	601,800.00	0.05
103	300757	罗博特科	6,800	598,468.00	0.05
104	688373	盟科药业	69,980	598,329.00	0.05
105	002880	卫光生物	15,800	595,660.00	0.05
106	301058	中粮科工	42,500	592,875.00	0.05
107	301168	通灵股份	9,500	591,850.00	0.05
108	688376	美埃科技	14,904	588,558.96	0.05
109	603121	华培动力	65,024	579,363.84	0.05
110	688300	联瑞新材	12,330	576,427.50	0.05
111	300384	三联虹普	33,900	575,961.00	0.05
112	003000	劲仔食品	45,600	574,104.00	0.05
113	301188	力诺特玻	33,500	572,180.00	0.05
114	605167	利柏特	59,000	571,120.00	0.05

115	688533	上声电子	12,205	570,339.65	0.05
116	688590	新致软件	25,008	568,431.84	0.05
117	301307	美利信	16,800	568,008.00	0.05
118	603590	康辰药业	17,100	567,720.00	0.05
119	300926	博俊科技	24,800	566,432.00	0.05
120	603639	海利尔	31,600	566,272.00	0.05
121	300517	海波重科	40,500	560,520.00	0.05
122	300688	创业黑马	16,100	558,831.00	0.05
123	300235	方直科技	44,700	556,515.00	0.05
124	688670	金迪克	11,753	553,331.24	0.05
125	300129	泰胜风能	57,200	548,548.00	0.05
126	300491	通合科技	19,100	548,170.00	0.05
127	002897	意华股份	11,800	546,104.00	0.05
128	300286	安科瑞	14,400	545,184.00	0.05
129	600212	绿能慧充	58,000	544,040.00	0.05
130	300654	世纪天鸿	41,400	543,168.00	0.05
131	603040	新坐标	20,200	537,118.00	0.05
132	300540	蜀道装备	19,600	530,768.00	0.04
133	688435	英方软件	6,964	529,542.56	0.04
134	688186	广大特材	16,124	524,513.72	0.04
135	600975	新五丰	36,900	352,764.00	0.03
136	002790	瑞尔特	35,200	337,920.00	0.03
137	688458	美芯晟	3,513	337,845.21	0.03
138	001201	东瑞股份	10,200	245,718.00	0.02
139	600530	*ST 交昂	81,000	201,690.00	0.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600400	红豆股份	13,017,388.00	1.10
2	002239	奥特佳	12,144,422.52	1.03
3	002979	雷赛智能	11,939,125.24	1.01
4	002130	沃尔核材	11,574,018.00	0.98
5	603187	海容冷链	11,423,618.60	0.97
6	002639	雪人股份	11,191,101.00	0.95
7	000048	京基智农	10,882,713.68	0.92
8	300318	博晖创新	10,836,100.00	0.92
9	603959	百利科技	10,813,696.00	0.91
10	002993	奥海科技	10,756,141.20	0.91
11	600815	厦工股份	10,660,211.00	0.90
12	300328	宜安科技	10,506,960.67	0.89
13	300348	长亮科技	10,362,778.69	0.88

14	000982	中银绒业	10,335,479.00	0.87
15	603876	鼎胜新材	10,053,117.00	0.85
16	000030	富奥股份	10,036,827.00	0.85
17	300127	银河磁体	9,784,767.00	0.83
18	603118	共进股份	9,697,877.00	0.82
19	688556	高测股份	9,671,939.99	0.82
20	603896	寿仙谷	9,651,666.10	0.82

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603118	共进股份	11,144,240.80	0.94
2	300328	宜安科技	10,803,067.51	0.91
3	600815	厦工股份	10,469,989.00	0.89
4	000048	京基智农	8,698,905.00	0.74
5	002641	公元股份	8,518,346.00	0.72
6	688258	卓易信息	8,445,796.70	0.71
7	000823	超声电子	8,195,259.00	0.69
8	300740	水羊股份	8,116,302.00	0.69
9	002857	三晖电气	8,080,745.00	0.68
10	600903	贵州燃气	7,995,837.78	0.68
11	600400	红豆股份	7,923,703.00	0.67
12	300779	惠城环保	7,578,327.00	0.64
13	002130	沃尔核材	7,407,312.00	0.63
14	600761	安徽合力	7,318,879.76	0.62
15	300719	安达维尔	7,205,540.00	0.61
16	603843	正平股份	7,164,438.00	0.61
17	000534	万泽股份	7,038,879.00	0.60
18	002886	沃特股份	7,011,634.00	0.59
19	300908	仲景食品	6,983,573.40	0.59
20	000735	罗牛山	6,912,933.00	0.58

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	3,228,334,060.54
卖出股票收入（成交）总额	2,227,985,605.64

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	17,108,763.01	1.45
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	17,108,763.01	1.45

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	019703	23 国债 10	120,000	12,063,156.16	1.02
2	019670	22 国债 05	50,000	5,045,606.85	0.43

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，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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收到公开谴责、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	12,113,438.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,424,808.13
6	其他应收款	1.69
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,538,248.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧中证	9,501	79,009.94	175,135,145.69	23.33%	575,538,275.24	76.67%

1000 指数增强 A						
中欧中证 1000 指数增强 C	4,825	87,265.48	102,621,420.90	24.37%	318,434,501.87	75.63%
合计	14,326	81,790.41	277,756,566.59	23.70%	893,972,777.11	76.30%

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	中欧中证 1000 指数增强 A	499.94	0.00%
	中欧中证 1000 指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	499.94	0.00%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员持有本基金 A 类份额的实际比例为 0.0001%，持有本基金总份额的实际比例为 0.000043%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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 1000 指数增强 A	0
	中欧中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 1000 指数增强 A	0
	中欧中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 2 日) 基金份额总额	754,558,392.41	472,748,192.02
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	164,401,480.78	407,360,026.43
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	168,286,452.26	459,052,295.68
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分	-	-

变动份额		
本报告期末基金份 额总额	750,673,420.93	421,055,922.77

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、公募基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
财通证券	3	1,923,868,019.19	35.26	1,002,889.53	35.26	本报告期新增 3 个
东莞证券	1	1,529,352,886.83	28.03	797,240.41	28.03	本报告期新增 1 个
招商证券	3	1,137,436,058.49	20.85	592,917.32	20.85	本报告期新增 3 个
国泰君安	2	865,662,701.67	15.87	451,272.71	15.87	本报告期新增 2 个

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
财通证券	-	-	1,020,571,000.00	28.64	-	-
东莞证券	-	-	1,050,518,000.00	29.48	-	-
招商证券	-	-	1,024,105,000.00	28.74	-	-
国泰君安	17,066,872.56	100.00	468,000,000.00	13.13	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2023-02-11
2	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2023-02-11
3	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-02-11
4	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2023-02-11
5	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2023-02-11
6	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2023-02-11
7	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
8	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2023-03-03
9	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-05-09
10	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
11	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金暂停代销渠道大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2023-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023年8月31日