

中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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	51
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	52
§ 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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 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	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金		
基金简称	中欧沪深 300 指数发起		
基金主代码	021877		
基金运作方式	契约型、开放式、发起式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 29 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	139,222,009.97 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
下属分级基金的交易代码	021877	021878	022899
报告期末下属分级基金的份额总额	92,997,377.67 份	40,825,684.01 份	5,398,948.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	方圆
	联系电话	021-68609600	95559

	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95559
传真		021-50190017	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		窦玉明	任德奇

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)		
	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
本期已实现收益	7,410,734.84	2,919,508.95	342,081.03
本期利润	10,204,285.50	4,328,703.01	511,782.02
加权平均基金份额本期利润	0.1080	0.1195	0.1247
本期加权平均净值利润率	8.64%	9.58%	9.91%
本期基金份额	9.36%	9.23%	9.52%

额 净 值 增 长 率			
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分 配利润	16, 573, 742. 25	7, 074, 416. 87	993, 979. 04
期末可供分 配基金份额 利润	0. 1782	0. 1733	0. 1841
期末基金资 产净值	123, 370, 719. 79	53, 943, 626. 56	7, 196, 301. 07
期末基金份 额净值	1. 3266	1. 3213	1. 3329
3.1.3 累 计期末指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累 计净值增长 率	32. 66%	32. 13%	33. 25%

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

中欧沪深 300 指数发起 A

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	13. 14%	1. 20%	11. 30%	1. 19%	1. 84%	0. 01%
过去六个月	9. 36%	1. 08%	7. 20%	1. 07%	2. 16%	0. 01%
过去一年	31. 29%	0. 98%	25. 13%	0. 97%	6. 16%	0. 01%

自基金合同生效起 至今	32.66%	0.95%	27.13%	0.96%	5.53%	-0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 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。

中欧沪深 300 指数发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.08%	1.20%	11.30%	1.19%	1.78%	0.01%
过去六个月	9.23%	1.08%	7.20%	1.07%	2.03%	0.01%
过去一年	30.96%	0.98%	25.13%	0.97%	5.83%	0.01%
自基金合同生效起 至今	32.13%	0.95%	27.13%	0.96%	5.00%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 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。

中欧沪深 300 指数发起 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.24%	1.20%	11.30%	1.19%	1.94%	0.01%
过去六个月	9.52%	1.08%	7.20%	1.07%	2.32%	0.01%
过去一年	31.70%	0.98%	25.13%	0.97%	6.57%	0.01%
自基金份额起始运 作日至今	33.25%	0.96%	25.26%	0.96%	7.99%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 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

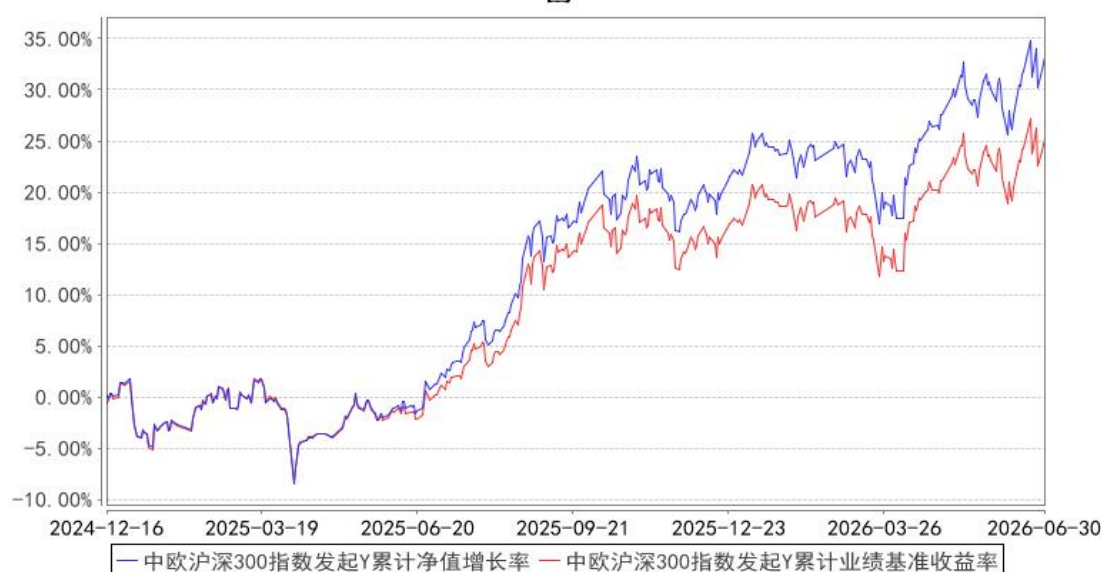
中欧沪深300指数发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧沪深300指数发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧沪深300指数发起Y累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额，图示日期为 2024 年 12 月 16 日至 2026 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋巍巍	量化投委会委员 / 基金经理	2024-11-29	-	9 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 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

上半年，沪深 300 指数上涨 7.55%，其中一季度下跌 3.89%、二季度上涨 11.90%。

2026 年上半年，A 股走出一条“倒 V 型开局、V 型反转收官”的完整曲线：一季度受海外实际利率上行冲击深度回调，二季度在地缘风险出清与国内制度供给的双轮驱动下强势修复，上半年整体呈现“先抑后扬、结构剧烈分化”的格局。理解上半年行情，关键在于把握两个周期锚——外部的美国货币政策周期（实际利率）与内部的中国经济复苏周期（消费与地产的内生动能）——的节奏与矛盾。具体而言，全球产业周期在 A 股映射得淋漓尽致——半导体存储周期（供给刚性收缩驱动全链条涨价）、全球 AI 算力周期（海外云厂资本开支扩张带动硬件订单兑现）、国内 AI 产业化周期（国产算力进入商业化、科创板制度供给共振）；而与全球产业趋势关联度较弱的国内消

费周期（红利低波、自由现金流所锚定的高股息稳健资产）与汽车周期（电动化深化但价格战重启）则相对承压。这一“产业趋势主导、传统价值退潮”的分化格局，构成理解各产品上半年表现分化、并推演下半年走势的基本盘。

一季度，指数呈“倒 V 型”走势：1 月上涨 1.65%、2 月上涨 0.09%、3 月下跌 5.53%。贯穿一季度的核心矛盾是外因美国实际利率的变化与内因中国经济基本面的持续向好。1 月的上涨源于美联储重启扩表、人民币汇率升值、中美经济周期错位的共振；2 月国内经济数据确认内生复苏动能，指数在监管降温与有色板块回调的扰动下维持韧性。3 月 18 日美联储 FOMC 会议维持利率不变、政策基调偏鹰并上调通胀预期，彻底打破市场对“美联储在油价上涨中坚持宽松”的幻想，3 月中下旬 A 股连续大幅下跌，上证指数一度跌破 4000 点、探至 3800 点附近。

二季度，指数上涨 11.90%。4 月大幅上涨 8.03%：美伊临时停火后地缘风险溢价快速回吐，叠加 4 月 8 日央行、金融监管总局与中央汇金联合发声形成政策提振，市场进入“地缘脱敏”阶段，投资逻辑从避险切换至基本面验证；月末政治局会议定调进一步修复风险偏好。5 月上涨 1.76%：“降准降息”组合拳落地后市场进入震荡整理，PMI 连续位于扩张区间但动能边际减弱。6 月上涨 1.78%：美伊正式停战推动指数冲高，6 月下旬美联储鹰派信号与季末兑现压力引发较大回调，月末企稳收官。

在投资策略方面，本基金作为跟踪沪深 300 指数的被动指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 9.36%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；基金 C 类份额净值增长率为 9.23%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；基金 Y 类份额净值增长率为 9.52%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

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，从周期定位看，国内经济延续内生复苏态势，PPI 延续上行、工业企业盈利修复趋势渐明，权益市场驱动力正处在从“政策博弈”向“盈利驱动”过渡的窗口，大盘蓝筹的盈利锚随企业盈利周期上行而逐步夯实。作为聚焦大盘蓝筹的核心宽基，沪深 300 的走势与国内经济复苏周期的强度、权重行业（金融、消费、制造）的盈利兑现高度相关，PPI 上行斜率、企业盈利改善的广度是核心观测变量。外部方面，美国进入加息周期，地缘风险出清后加息性质由“被迫”转向“从容”，但实际利率维持高位是大盘估值的外部约束项；后续美国通胀与就业数据的边际变化，将影响加息节奏与实际利率方向，进而影响大盘蓝筹的估值空间。全年 A 股定价处在“国内复

苏强度”与“海外货币政策节奏”两个周期变量的相互作用中，国内基本面是更根本的主导力量。

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，基金托管人在中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中欧基金管理有限公司在中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托

管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,333,833.70	3,100,518.11
结算备付金		68,649.26	29,433.31
存出保证金		19,134.28	49,040.42
交易性金融资产	6.4.7.2	184,778,330.57	172,910,051.70
其中：股票投资		175,297,468.05	166,242,674.16
基金投资		—	—
债券投资		9,480,862.52	6,667,377.54
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		—	97,937.24
应收股利		—	—
应收申购款		770,493.10	243,095.43
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		189,970,440.91	176,430,076.21
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 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		3,000,126.16	—
应付清算款		1,763,370.94	—
应付赎回款		504,037.24	72,747.98
应付管理人报酬		74,343.67	74,871.63
应付托管费		14,868.77	14,974.34
应付销售服务费		11,963.55	10,548.65
应付投资顾问费		—	—
应交税费		237.91	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	90,845.25	49,303.31
负债合计		5,459,793.49	222,445.91
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	139,222,009.97	145,352,990.14
未分配利润	6.4.7.8	45,288,637.45	30,854,640.16
净资产合计		184,510,647.42	176,207,630.30
负债和净资产总计		189,970,440.91	176,430,076.21

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 139,222,009.97 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.3266 元，基金份额总额 92,997,377.67 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.3213 元，基金份额总额 40,825,684.01 份；下属 Y 类基金份额净值为人民币 1.3329 元，基金份额总额 5,398,948.29 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		15,701,971.64	4,635,932.98
1. 利息收入		5,552.65	14,025.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,552.65	14,025.24
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产		—	—

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,311,594.91	2,604,057.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,653,980.36	-144,707.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	55,255.29	32,949.64
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,602,359.26	2,715,814.78
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	4,372,445.71	2,017,316.73
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	12,378.37	533.67
减：二、营业总支出		657,201.11	693,243.60
1. 管理人报酬		410,466.83	436,338.85
2. 托管费		82,093.34	87,267.78
3. 销售服务费		55,823.78	102,726.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		20,401.87	-
其中：卖出回购金融资产 支出		20,401.87	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		72.13	-
8. 其他费用	6.4.7.18	88,343.16	66,910.61
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		15,044,770.53	3,942,689.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		15,044,770.53	3,942,689.38
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		15,044,770.53	3,942,689.38

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	145,352,990.14	-	30,854,640.16	176,207,630.30
二、本期期初净资产	145,352,990.14	-	30,854,640.16	176,207,630.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,130,980.17	-	14,433,997.29	8,303,017.12
(一)、综合收益总额	-	-	15,044,770.53	15,044,770.53
(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)	-6,130,980.17	-	-610,773.24	-6,741,753.41
其中：1. 基金申购款	53,647,746.84	-	14,397,748.05	68,045,494.89
2. 基金赎回款	-59,778,727.01	-	-15,008,521.29	-74,787,248.30
(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	139,222,009.97	-	45,288,637.45	184,510,647.42
项目	上年度可比期间 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	88,971,200.90	-	127,125.56	89,098,326.46
二、本期期初净资产	88,971,200.90	-	127,125.56	89,098,326.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	124,960,836.97	-	1,984,306.65	126,945,143.62
(一)、综合收益总额	-	-	3,942,689.38	3,942,689.38

(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)	124,960,836.97	-	-1,958,382.73	123,002,454.24
其中: 1. 基金申购款	241,379,697.34	-	-2,120,569.50	239,259,127.84
2. 基金赎回款	-116,418,860.37	-	162,186.77	-116,256,673.60
(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	213,932,037.87	-	2,111,432.21	216,043,470.08

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

中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]955 号文《关于准予中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 205,662,220.00 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2024)验字第 70028871_B23 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 29 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 205,776,141.49 份基金份额,其中包含认购资金利息折合 113,921.49 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 61,116,394.56 份,包含认购利息折合 25,544.08 份;C 类基金的基金份额总额为 144,659,746.93 份,包含认购利息折

合 88,377.41 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 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‰；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、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。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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《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

本基金运作过程中如有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《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《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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,333,833.70
等于：本金	4,333,248.63
加：应计利息	585.07
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	4,333,833.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		149,404,212.53	-	175,297,468.05	25,893,255.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,407,189.00	74,262.52	9,480,862.52	-589.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,407,189.00	74,262.52	9,480,862.52	-589.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		158,811,401.53	74,262.52	184,778,330.57	25,892,666.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	11,502.09
其中：交易所市场	11,502.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37

合计	90,845.25
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧沪深 300 指数发起 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,820,069.67	104,820,069.67
本期申购	12,291,735.78	12,291,735.78
本期赎回（以“-”号填列）	-24,114,427.78	-24,114,427.78
本期末	92,997,377.67	92,997,377.67

中欧沪深 300 指数发起 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,306,233.12	38,306,233.12
本期申购	36,112,464.21	36,112,464.21
本期赎回（以“-”号填列）	-33,593,013.32	-33,593,013.32
本期末	40,825,684.01	40,825,684.01

中欧沪深 300 指数发起 Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,226,687.35	2,226,687.35
本期申购	5,243,546.85	5,243,546.85
本期赎回（以“-”号填列）	-2,071,285.91	-2,071,285.91
本期末	5,398,948.29	5,398,948.29

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

中欧沪深 300 指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,394,025.15	11,942,682.15	22,336,707.30
本期期初	10,394,025.15	11,942,682.15	22,336,707.30
本期利润	7,410,734.84	2,793,550.66	10,204,285.50
本期基金份额交易产生的变动数	-1,231,017.74	-936,632.94	-2,167,650.68
其中：基金申购款	1,772,973.01	1,547,399.44	3,320,372.45
基金赎回款	-3,003,990.75	-2,484,032.38	-5,488,023.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,573,742.25	13,799,599.87	30,373,342.12

中欧沪深 300 指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,678,606.04	4,356,072.79	8,034,678.83
本期期初	3,678,606.04	4,356,072.79	8,034,678.83
本期利润	2,919,508.95	1,409,194.06	4,328,703.01
本期基金份额交易产生的变动数	476,301.88	278,258.83	754,560.71
其中：基金申购款	5,008,312.40	4,710,570.25	9,718,882.65
基金赎回款	-4,532,010.52	-4,432,311.42	-8,964,321.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,074,416.87	6,043,525.68	13,117,942.55

中欧沪深 300 指数发起 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	228,998.80	254,255.23	483,254.03
本期期初	228,998.80	254,255.23	483,254.03
本期利润	342,081.03	169,700.99	511,782.02
本期基金份额交易产生的变动数	422,899.21	379,417.52	802,316.73
其中：基金申购款	716,009.35	642,483.60	1,358,492.95
基金赎回款	-293,110.14	-263,066.08	-556,176.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	993,979.04	803,373.74	1,797,352.78

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,345.68
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	147.08
其他	59.89
合计	5,552.65

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,787,572.86
减：卖出股票成本总额	45,080,257.64
减：交易费用	53,334.86
买卖股票差价收入	9,653,980.36

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	55,145.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	110.00
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	55,255.29

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,688,910.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,599,850.00
减：应计利息总额	88,950.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	110.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,602,359.26
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	1,602,359.26
----	--------------

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,372,445.71
股票投资	4,374,954.71
债券投资	-2,509.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,372,445.71

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,684.08
基金转换费收入	1,694.29
合计	12,378.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	88,343.16

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、关联关系

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、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：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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	323,578,093.06	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比 例（%）
国都证券	-	-	9,017,169.34	100.00

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 2026年1月1日至2026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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	60,149.49	100.00	27,545.79	100.00

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	410,466.83	436,338.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,363.36	127,035.26
应支付基金管理人的净管理费	329,103.47	309,303.59

注：本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的年管理费率为 0.50%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.25%。三类基金份额的管理费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金管理费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	82,093.34	87,267.78

注：本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的年托管费率为 0.10%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.05%。三类基金份额的托管费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金托管费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y	合计
交通银行股份有限公司	0.00	31,139.13	0.00	31,139.13
中欧财富	0.00	79.26	0.00	79.26
中欧基金	0.00	10,389.98	0.00	10,389.98
合计	0.00	41,608.37	0.00	41,608.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y	合计
交通银行股份有限公司	0.00	79,089.73	0.00	79,089.73
中欧财富	0.00	21.03	0.00	21.03
中欧基金	0.00	5,913.44	0.00	5,913.44
合计	0.00	85,024.20	0.00	85,024.20

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

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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

中欧沪深 300 指数发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,001,350.14	10,001,350.14
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
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	10,001,350.14	10,001,350.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.75%	7.47%

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

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
交通银行股份有限公司	4,333,833.70	5,345.68	4,305,251.04	10,992.70

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	46	1,288.00	1,277.88	-
001248	华润	2026 年 6 月	6 个月	新股流通	10.11	10.11	5,338	53,967.18	53,967.18	-

	新 能 源	月 24 日		受限						
001248	华 润 新 能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	10.11	10.11	2,287	23,121.57	23,121.57	-
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	7.82	20.74	701	5,481.82	14,538.74	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.12	27.73	896	9,067.52	24,846.08	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	244	11,243.52	113,052.52	-
301669	高 特 电 子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	338	2,393.04	9,599.20	-
301680	固 德 电 材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	56	3,248.00	6,280.96	-
301682	宏 明 电 子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	69.66	160.06	156	10,866.96	24,969.36	-
301683	慧 谷 新 材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	39	3,056.82	4,749.03	-
301687	新 广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	21.93	77.78	146	3,201.78	11,355.88	-
301696	三 瑞 智 能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	24.68	86.80	112	2,764.16	9,721.60	-

601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	166	1,855.88	2,919.94	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	35	1,325.80	1,220.45	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	29	971.21	983.97	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	62	1,356.56	1,582.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	107	1,483.02	7,860.22	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	74	1,166.24	3,456.54	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	115	2,035.50	9,696.80	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	758	13,280.16	27,227.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	320	7,257.60	15,235.20	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	44	4,055.92	20,378.60	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	67	2,985.52	31,400.89	-

688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	40	3,275.20	63,373.20	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	534	3,422.94	12,885.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	128	3,363.84	22,027.52	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	71	3,972.45	4,054.10	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	528	5,000.16	37,033.92	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	236	4,644.48	33,391.64	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	1,038	639,111.77	912,952.14	-

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 2026 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 2026 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 3,000,126.16 元，于 2026 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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	4,333,833.70	-	-	-	4,333,833.70
结算备付金	68,649.26	-	-	-	68,649.26
存出保证金	19,134.28	-	-	-	19,134.28
交易性金融资产	9,480,862.52	-	-	175,297,468.05	184,778,330.57
应收申购款	-	-	-	770,493.10	770,493.10
资产总计	13,902,479.76	-	-	176,067,961.15	189,970,440.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	504,037.24	504,037.24
应付管理人报酬	-	-	-	74,343.67	74,343.67
应付托管费	-	-	-	14,868.77	14,868.77
应付清算款	-	-	-	1,763,370.94	1,763,370.94
卖出回购金融资产款	3,000,126.16	-	-	-	3,000,126.16
应付销售服务费	-	-	-	11,963.55	11,963.55
应交税费	-	-	-	237.91	237.91
其他负债	-	-	-	90,845.25	90,845.25
负债总计	3,000,126.16	-	-	2,459,667.33	5,459,793.49
利率敏感度缺口	10,902,353.60	-	-	173,608,293.82	184,510,647.42
上年度末 2025 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	3,100,518.11	-	-	-	3,100,518.11
结算备付金	29,433.31	-	-	-	29,433.31
存出保证金	49,040.42	-	-	-	49,040.42
交易性金融资产	6,667,377.54	-	-	166,242,674.16	172,910,051.70

应收申购款	-	-	-	243,095.43	243,095.43
应收清算款	-	-	-	97,937.24	97,937.24
资产总计	9,846,369.38	-	-	166,583,706.83	176,430,076.21
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	72,747.98	72,747.98
应付管理人报酬	-	-	-	74,871.63	74,871.63
应付托管费	-	-	-	14,974.34	14,974.34
应付销售服务费	-	-	-	10,548.65	10,548.65
其他负债	-	-	-	49,303.31	49,303.31
负债总计	-	-	-	222,445.91	222,445.91
利率敏感度缺口	9,846,369.38	-	-	-166,361,260.92	176,207,630.30

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 2026 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 5.14%（2025 年 12 月 31 日：3.78%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	175,297,468.05	95.01	166,242,674.16	94.34

产—股票投资				
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	175,297,468.05	95.01	166,242,674.16	94.34

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	9,281,957.74	8,885,424.72
	业绩比较基准下降 5%	-9,281,957.74	-8,885,424.72

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	173,792,307.90	164,232,916.55
第二层次	10,470,903.41	7,856,057.46

第三层次	515, 119. 26	821, 077. 69
合计	184, 778, 330. 57	172, 910, 051. 70

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 2026 年 8 月 27 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	175, 297, 468. 05	92. 28
	其中：股票	175, 297, 468. 05	92. 28
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9, 480, 862. 52	4. 99
	其中：债券	9, 480, 862. 52	4. 99
	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	4, 402, 482. 96	2. 32
8	其他各项资产	789, 627. 38	0. 42
9	合计	189, 970, 440. 91	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	984,733.00	0.53
B	采矿业	7,415,879.90	4.02
C	制造业	111,718,046.38	60.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,366,577.78	2.37
E	建筑业	2,010,224.00	1.09
F	批发和零售业	268,352.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,225,195.00	2.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,463,583.70	5.13
J	金融业	30,561,799.00	16.56
K	房地产业	593,565.00	0.32
L	租赁和商务服务业	801,302.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,929,905.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	246,974.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	105,355.00	0.06
S	综合	—	—
	合计	174,691,491.76	94.68

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	14,538.74	0.01
C	制造业	510,168.42	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,088.75	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,277.88	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,902.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	605,976.29	0.33

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	300308	中际旭创	6,800	8,636,000.00	4.68
2	300750	宁德时代	16,200	6,366,762.00	3.45
3	300502	新易盛	8,500	5,159,500.00	2.80
4	600519	贵州茅台	3,900	4,623,411.00	2.51
5	603986	兆易创新	4,400	3,586,000.00	1.94
6	688256	寒武纪	1,996	3,184,717.80	1.73
7	601318	中国平安	66,000	3,150,840.00	1.71
8	600036	招商银行	76,800	2,726,400.00	1.48
9	601899	紫金矿业	105,000	2,639,700.00	1.43
10	002371	北方华创	2,600	2,299,856.00	1.25
11	000333	美的集团	29,700	2,243,241.00	1.22
12	688008	澜起科技	7,167	2,221,053.30	1.20
13	688012	中微公司	4,708	2,205,698.00	1.20
14	002475	立讯精密	31,200	2,196,480.00	1.19
15	002384	东山精密	7,900	2,072,565.00	1.12
16	688041	海光信息	5,557	2,057,757.10	1.12
17	600900	长江电力	75,800	2,006,426.00	1.09

18	688981	中芯国际	12,426	1,973,497.32	1.07
19	600030	中信证券	68,400	1,965,132.00	1.07
20	603259	药明康德	15,500	1,929,905.00	1.05
21	000725	京东方 A	222,100	1,927,828.00	1.04
22	300059	东方财富	90,200	1,838,276.00	1.00
23	601166	兴业银行	105,700	1,750,392.00	0.95
24	601138	工业富联	24,200	1,746,030.00	0.95
25	600183	生益科技	8,900	1,543,260.00	0.84
26	300408	三环集团	8,700	1,452,030.00	0.79
27	601211	国泰海通	79,100	1,439,620.00	0.78
28	601398	工商银行	202,100	1,428,847.00	0.77
29	600276	恒瑞医药	27,300	1,420,692.00	0.77
30	300274	阳光电源	8,900	1,415,278.00	0.77
31	002594	比亚迪	16,600	1,323,020.00	0.72
32	300476	胜宏科技	3,700	1,281,791.00	0.69
33	002463	沪电股份	8,200	1,252,960.00	0.68
34	300394	天孚通信	4,000	1,210,720.00	0.66
35	000988	华工科技	6,300	1,163,043.00	0.63
36	301308	江波龙	1,600	1,126,080.00	0.61
37	600176	中国巨石	15,400	1,122,352.00	0.61
38	601288	农业银行	175,600	1,065,892.00	0.58
39	000651	格力电器	27,400	1,027,500.00	0.56
40	600522	中天科技	16,700	1,013,356.00	0.55
41	603993	洛阳钼业	55,800	979,290.00	0.53
42	688521	芯原股份	2,630	976,098.20	0.53
43	600584	长电科技	9,400	973,370.00	0.53
44	600919	江苏银行	89,800	968,044.00	0.52
45	603019	中科曙光	8,900	954,347.00	0.52
46	600150	中国船舶	27,600	932,604.00	0.51
47	600887	伊利股份	38,700	927,252.00	0.50
48	688072	拓荆科技	1,038	912,952.14	0.49
49	000338	潍柴动力	32,800	893,800.00	0.48
50	000858	五 粮 液	11,900	880,600.00	0.48
51	601688	华泰证券	40,900	843,358.00	0.46
52	600309	万华化学	12,000	820,920.00	0.44
53	601816	京沪高铁	179,300	812,229.00	0.44
54	002916	深南电路	1,700	778,430.00	0.42
55	300124	汇川技术	11,600	769,428.00	0.42
56	002415	海康威视	22,400	766,080.00	0.42
57	600111	北方稀土	15,500	744,775.00	0.40
58	000100	TCL 科技	127,000	739,140.00	0.40
59	000063	中兴通讯	19,700	712,943.00	0.39
60	600000	浦发银行	81,400	700,854.00	0.38

61	601857	中国石油	80,600	699,608.00	0.38
62	600089	特变电工	30,900	695,250.00	0.38
63	300433	蓝思科技	12,400	665,384.00	0.36
64	002028	思源电气	3,800	657,400.00	0.36
65	601088	中国神华	16,800	655,872.00	0.36
66	600031	三一重工	36,300	627,264.00	0.34
67	300014	亿纬锂能	9,400	611,282.00	0.33
68	002050	三花智控	13,900	609,237.00	0.33
69	002142	宁波银行	20,200	599,738.00	0.33
70	601601	中国太保	20,900	596,068.00	0.32
71	000001	平安银行	59,300	595,965.00	0.32
72	600549	厦门钨业	6,900	587,880.00	0.32
73	000792	盐湖股份	19,400	585,686.00	0.32
74	002714	牧原股份	16,700	584,333.00	0.32
75	002353	杰瑞股份	3,800	579,500.00	0.31
76	600406	国电南瑞	24,500	559,825.00	0.30
77	600999	招商证券	26,000	548,600.00	0.30
78	601668	中国建筑	126,200	547,708.00	0.30
79	000657	中钨高新	5,600	536,032.00	0.29
80	601229	上海银行	60,900	528,612.00	0.29
81	601919	中远海控	39,200	519,792.00	0.28
82	002602	世纪华通	36,100	509,010.00	0.28
83	300760	迈瑞医疗	3,700	502,571.00	0.27
84	601988	中国银行	87,400	499,928.00	0.27
85	601939	建设银行	51,800	498,834.00	0.27
86	600660	福耀玻璃	9,800	494,312.00	0.27
87	603501	豪威集团	5,200	493,220.00	0.27
88	601728	中国电信	94,800	492,012.00	0.27
89	600016	民生银行	151,700	488,474.00	0.26
90	601012	隆基绿能	37,100	486,752.00	0.26
91	000776	广发证券	20,700	484,380.00	0.26
92	601225	陕西煤业	23,700	482,295.00	0.26
93	002230	科大讯飞	11,700	477,828.00	0.26
94	600941	中国移动	5,500	473,715.00	0.26
95	600690	海尔智家	22,900	467,389.00	0.25
96	002352	顺丰控股	14,700	459,522.00	0.25
97	603799	华友钴业	9,500	458,470.00	0.25
98	600160	巨化股份	8,600	455,886.00	0.25
99	601985	中国核电	50,400	455,112.00	0.25
100	002938	鹏鼎控股	4,300	453,134.00	0.25
101	002460	赣锋锂业	6,900	451,260.00	0.24
102	600926	杭州银行	31,000	447,950.00	0.24
103	002709	天赐材料	8,700	447,441.00	0.24

104	601169	北京银行	90,300	442,470.00	0.24
105	000977	浪潮信息	6,300	441,000.00	0.24
106	300033	同花顺	1,800	433,800.00	0.24
107	300442	润泽科技	5,100	423,657.00	0.23
108	688126	沪硅产业	10,336	412,303.04	0.22
109	000425	徐工机械	50,000	404,500.00	0.22
110	300498	温氏股份	32,500	400,400.00	0.22
111	601600	中国铝业	48,400	397,848.00	0.22
112	600028	中国石化	89,100	397,386.00	0.22
113	600938	中国海油	14,600	396,390.00	0.21
114	002600	领益智造	22,800	395,352.00	0.21
115	688082	盛美上海	905	390,960.00	0.21
116	600460	士兰微	7,100	388,086.00	0.21
117	300661	圣邦股份	2,700	387,396.00	0.21
118	002202	金风科技	16,200	387,180.00	0.21
119	601766	中国中车	74,400	386,880.00	0.21
120	002466	天齐锂业	6,300	386,316.00	0.21
121	600050	中国联通	95,500	382,000.00	0.21
122	000938	紫光股份	13,000	375,180.00	0.20
123	002837	英维克	4,700	373,932.00	0.20
124	601009	南京银行	37,800	373,842.00	0.20
125	002049	紫光国微	4,200	372,750.00	0.20
126	601628	中国人寿	10,300	364,105.00	0.20
127	002179	中航光电	7,800	360,360.00	0.20
128	601100	恒立液压	3,300	354,948.00	0.19
129	000568	泸州老窖	4,500	348,840.00	0.19
130	601872	招商轮船	19,700	346,129.00	0.19
131	600958	东方证券	36,600	345,504.00	0.19
132	002241	歌尔股份	15,200	342,456.00	0.19
133	600809	山西汾酒	3,100	339,047.00	0.18
134	603288	海天味业	10,200	338,232.00	0.18
135	601006	大秦铁路	72,900	336,069.00	0.18
136	601888	中国中免	6,200	333,002.00	0.18
137	601658	邮储银行	67,500	332,775.00	0.18
138	000408	藏格矿业	4,800	332,736.00	0.18
139	688396	华润微	3,377	329,426.35	0.18
140	605117	德业股份	3,100	329,158.00	0.18
141	601818	光大银行	113,300	327,437.00	0.18
142	600905	三峡能源	87,200	323,512.00	0.18
143	000630	铜陵有色	50,700	322,452.00	0.17
144	600489	中金黄金	17,800	321,290.00	0.17
145	002625	光启技术	10,500	318,360.00	0.17
146	688271	联影医疗	3,144	318,267.12	0.17

147	600893	航发动力	8,100	310,554.00	0.17
148	601336	新华保险	5,200	310,232.00	0.17
149	600010	包钢股份	138,300	308,409.00	0.17
150	601127	赛力斯	5,000	306,250.00	0.17
151	601689	拓普集团	5,300	299,026.00	0.16
152	002027	分众传媒	61,700	298,628.00	0.16
153	688111	金山办公	1,394	296,991.70	0.16
154	601995	中金公司	8,200	296,430.00	0.16
155	600118	中国卫星	3,600	295,380.00	0.16
156	601377	兴业证券	48,300	291,732.00	0.16
157	600019	宝钢股份	53,200	288,876.00	0.16
158	601838	成都银行	16,100	284,970.00	0.15
159	600760	中航沈飞	6,900	283,590.00	0.15
160	000807	云铝股份	12,700	281,178.00	0.15
161	000166	申万宏源	63,300	278,520.00	0.15
162	600362	江西铜业	6,400	277,120.00	0.15
163	600875	东方电气	9,600	276,192.00	0.15
164	600989	宝丰能源	13,500	274,455.00	0.15
165	600104	上汽集团	28,000	273,280.00	0.15
166	300450	先导智能	6,700	272,824.00	0.15
167	000538	云南白药	5,700	270,009.00	0.15
168	601727	上海电气	38,500	269,500.00	0.15
169	002001	新 和 成	9,400	267,148.00	0.14
170	002422	科伦药业	6,900	265,788.00	0.14
171	601066	中信建投	9,100	264,537.00	0.14
172	601825	沪农商行	35,300	264,397.00	0.14
173	688183	生益电子	1,969	260,695.60	0.14
174	601390	中国中铁	62,400	260,208.00	0.14
175	600795	国电电力	54,500	254,515.00	0.14
176	600547	山东黄金	11,000	253,990.00	0.14
177	603296	华勤技术	3,400	252,518.00	0.14
178	601916	浙商银行	96,000	252,480.00	0.14
179	600015	华夏银行	39,000	249,210.00	0.14
180	600585	海螺水泥	14,700	249,165.00	0.14
181	601669	中国电建	52,800	248,160.00	0.13
182	300015	爱尔眼科	29,900	246,974.00	0.13
183	603893	瑞芯微	1,300	244,868.00	0.13
184	002648	卫星化学	10,300	241,947.00	0.13
185	300316	晶盛机电	4,000	241,600.00	0.13
186	601998	中信银行	33,200	230,076.00	0.12
187	601698	中国卫通	7,600	229,900.00	0.12
188	601868	中国能建	85,700	228,819.00	0.12
189	600346	恒力石化	12,900	228,459.00	0.12

190	600482	中国动力	6,900	226,320.00	0.12
191	002558	巨人网络	8,200	225,992.00	0.12
192	002311	海大集团	5,000	223,050.00	0.12
193	300418	昆仑万维	5,500	221,980.00	0.12
194	002532	天山铝业	20,600	221,038.00	0.12
195	000625	长安汽车	30,400	217,968.00	0.12
196	600426	华鲁恒升	9,100	217,672.00	0.12
197	600066	宇通客车	8,100	217,161.00	0.12
198	002736	国信证券	21,500	214,785.00	0.12
199	600048	保利发展	45,900	212,517.00	0.12
200	600221	海航控股	156,900	211,815.00	0.11
201	000157	中联重科	30,300	211,191.00	0.11
202	605499	东鹏饮料	1,700	209,831.00	0.11
203	601901	方正证券	28,900	208,080.00	0.11
204	688036	传音控股	3,508	206,796.60	0.11
205	600886	国投电力	15,500	206,305.00	0.11
206	601077	渝农商行	33,700	205,907.00	0.11
207	600011	华能国际	26,800	203,412.00	0.11
208	601881	中国银河	16,100	202,377.00	0.11
209	300803	指南针	2,200	201,674.00	0.11
210	600438	通威股份	16,500	199,815.00	0.11
211	600115	中国东航	52,000	198,120.00	0.11
212	002236	大华股份	12,000	197,880.00	0.11
213	600570	恒生电子	9,300	197,067.00	0.11
214	002493	荣盛石化	18,300	196,725.00	0.11
215	600436	片仔癀	1,800	196,704.00	0.11
216	601788	光大证券	13,600	196,248.00	0.11
217	601058	赛轮轮胎	17,000	196,010.00	0.11
218	600188	兖矿能源	10,900	193,693.00	0.10
219	003816	中国广核	47,900	187,289.00	0.10
220	688047	龙芯中科	1,203	186,068.01	0.10
221	601360	三六零	21,400	185,966.00	0.10
222	600009	上海机场	8,000	184,800.00	0.10
223	000301	东方盛虹	16,100	184,345.00	0.10
224	600026	中远海能	10,200	182,988.00	0.10
225	600196	复星医药	8,100	182,007.00	0.10
226	002074	国轩高科	6,600	181,566.00	0.10
227	600674	川投能源	12,600	178,542.00	0.10
228	601186	中国铁建	29,700	176,715.00	0.10
229	688506	百利天恒	601	176,712.03	0.10
230	601877	正泰电器	7,000	175,490.00	0.10
231	601111	中国国航	29,000	175,450.00	0.10
232	000768	中航西飞	8,500	174,080.00	0.09

233	601456	国联民生	19,600	173,264.00	0.09
234	601117	中国化学	23,500	172,725.00	0.09
235	000975	山金国际	10,100	171,700.00	0.09
236	600233	圆通速递	10,900	171,675.00	0.09
237	600029	南方航空	33,000	170,940.00	0.09
238	600372	中航机载	15,700	170,345.00	0.09
239	301236	软通动力	4,000	169,800.00	0.09
240	600415	小商品城	16,700	169,672.00	0.09
241	600219	南山铝业	42,200	168,378.00	0.09
242	301269	华大九天	1,400	167,188.00	0.09
243	600741	华域汽车	10,300	159,856.00	0.09
244	000963	华东医药	5,600	157,472.00	0.09
245	001979	招商蛇口	23,200	149,176.00	0.08
246	000895	双汇发展	6,600	147,840.00	0.08
247	002920	德赛西威	1,800	146,700.00	0.08
248	300866	安克创新	1,400	146,300.00	0.08
249	601898	中煤能源	12,000	146,160.00	0.08
250	601021	春秋航空	3,200	145,856.00	0.08
251	002304	洋河股份	3,800	144,970.00	0.08
252	600023	浙能电力	26,200	137,812.00	0.07
253	601319	中国人保	20,100	135,876.00	0.07
254	600039	四川路桥	16,900	132,158.00	0.07
255	601800	中国交建	22,900	130,759.00	0.07
256	000002	万 科 A	43,900	129,944.00	0.07
257	688223	晶科能源	26,912	127,832.00	0.07
258	600918	中泰证券	23,900	127,148.00	0.07
259	600588	用友网络	13,800	126,684.00	0.07
260	601059	信达证券	7,500	121,425.00	0.07
261	001965	招商公路	13,000	119,080.00	0.06
262	601633	长城汽车	7,800	117,702.00	0.06
263	600027	华电国际	26,100	116,145.00	0.06
264	600600	青岛啤酒	2,200	114,906.00	0.06
265	603369	今世缘	4,800	113,808.00	0.06
266	601618	中国中冶	46,300	112,972.00	0.06
267	300628	亿联网络	3,300	111,606.00	0.06
268	603260	合盛硅业	2,300	110,998.00	0.06
269	601607	上海医药	7,200	110,880.00	0.06
270	302132	中航成飞	1,900	110,808.00	0.06
271	000617	中油资本	16,600	109,394.00	0.06
272	300832	新产业	2,600	109,200.00	0.06
273	600061	国投资本	16,500	108,075.00	0.06
274	600025	华能水电	12,100	107,569.00	0.06
275	300251	光线传媒	9,500	105,355.00	0.06

276	688472	阿特斯	9,688	104,824.16	0.06
277	600515	海南机场	37,200	101,928.00	0.06
278	600085	同仁堂	4,400	101,684.00	0.06
279	000999	华润三九	4,300	96,707.00	0.05
280	600803	新奥股份	6,100	96,380.00	0.05
281	600930	华电新能	19,614	93,558.78	0.05
282	300122	智飞生物	7,900	92,351.00	0.05
283	600845	宝信软件	5,500	91,465.00	0.05
284	300999	金龙鱼	3,800	88,388.00	0.05
285	300896	爱美客	1,000	87,200.00	0.05
286	600018	上港集团	17,900	84,488.00	0.05
287	000708	中信特钢	6,500	82,030.00	0.04
288	688009	中国通号	16,845	80,182.20	0.04
289	000596	古井贡酒	1,000	79,800.00	0.04
290	601018	宁波港	25,200	79,380.00	0.04
291	001280	中国铀业	1,177	78,505.90	0.04
292	688303	大全能源	4,387	76,465.41	0.04
293	601238	广汽集团	14,500	73,660.00	0.04
294	301165	锐捷网络	900	72,405.00	0.04
295	300413	芒果超媒	4,900	71,687.00	0.04
296	603392	万泰生物	2,600	70,122.00	0.04
297	601136	首创证券	3,500	48,825.00	0.03
298	001391	国货航	6,600	26,862.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301666	大普微	244	113,052.52	0.06
2	001248	华润新能源	7,625	77,088.75	0.04
3	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.03
4	688818	电科蓝天	528	37,033.92	0.02
5	688820	盛合晶微	236	33,391.64	0.02
6	688797	臻宝科技	67	31,400.89	0.02
7	688712	北芯生命	758	27,227.36	0.01
8	301682	宏明电子	156	24,969.36	0.01
9	001399	惠科股份	896	24,846.08	0.01
10	688813	泰金新能	128	22,027.52	0.01
11	688785	恒运昌	44	20,378.60	0.01
12	688781	视涯科技	320	15,235.20	0.01
13	001257	盛龙股份	701	14,538.74	0.01
14	688811	有研复材	534	12,885.42	0.01
15	301687	新广益	146	11,355.88	0.01
16	301696	三瑞智能	112	9,721.60	0.01
17	603459	红板科技	115	9,696.80	0.01

18	301669	高特电子	338	9,599.20	0.01
19	301667	纳百川	124	8,967.68	0.00
20	603407	长裕集团	107	7,860.22	0.00
21	301680	固德电材	56	6,280.96	0.00
22	301683	慧谷新材	39	4,749.03	0.00
23	688816	易思维	71	4,054.10	0.00
24	603435	嘉德利	74	3,456.54	0.00
25	601112	振石股份	166	2,919.94	0.00
26	301449	天溯计量	75	2,902.50	0.00
27	603248	锡华科技	90	1,898.10	0.00
28	603352	至信股份	62	1,582.24	0.00
29	001220	世盟股份	46	1,277.88	0.00
30	603284	林平发展	35	1,220.45	0.00
31	603293	埃泰克	29	983.97	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	300308	中际旭创	2,085,775.00	1.18
2	300750	宁德时代	1,918,612.00	1.09
3	600519	贵州茅台	1,328,719.00	0.75
4	300502	新易盛	1,301,650.00	0.74
5	601899	紫金矿业	1,233,360.32	0.70
6	000988	华工科技	1,034,591.00	0.59
7	601318	中国平安	967,729.00	0.55
8	301308	江波龙	851,750.00	0.48
9	603986	兆易创新	798,137.00	0.45
10	600036	招商银行	705,982.00	0.40
11	002475	立讯精密	643,859.00	0.37
12	688072	拓荆科技	639,111.77	0.36
13	688521	芯原股份	636,551.93	0.36
14	002353	杰瑞股份	613,778.00	0.35
15	601138	工业富联	560,181.00	0.32
16	002602	世纪华通	552,990.00	0.31
17	000333	美的集团	534,236.00	0.30
18	300274	阳光电源	495,169.00	0.28
19	300059	东方财富	493,845.00	0.28
20	600900	长江电力	481,583.00	0.27

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	300750	宁德时代	2, 254, 000. 00	1. 28
2	300308	中际旭创	2, 147, 237. 00	1. 22
3	600519	贵州茅台	1, 634, 164. 00	0. 93
4	300502	新易盛	1, 404, 293. 60	0. 80
5	601899	紫金矿业	1, 389, 109. 08	0. 79
6	601318	中国平安	1, 228, 306. 00	0. 70
7	600036	招商银行	879, 396. 00	0. 50
8	000333	美的集团	710, 358. 00	0. 40
9	002475	立讯精密	702, 925. 00	0. 40
10	603986	兆易创新	626, 924. 00	0. 36
11	300059	东方财富	623, 067. 00	0. 35
12	601138	工业富联	615, 306. 00	0. 35
13	600900	长江电力	589, 320. 00	0. 33
14	600030	中信证券	585, 167. 00	0. 33
15	601166	兴业银行	574, 487. 00	0. 33
16	300274	阳光电源	566, 207. 00	0. 32
17	002594	比亚迪	514, 480. 00	0. 29
18	601088	中国神华	502, 822. 00	0. 29
19	603993	洛阳钼业	491, 494. 00	0. 28
20	300476	胜宏科技	483, 459. 00	0. 27

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	49, 760, 096. 82
卖出股票收入（成交）总额	54, 787, 572. 86

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	9, 480, 862. 52	5. 14
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	9, 480, 862. 52	5. 14

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	019827	26 国债 01	56,000	5,636,298.74	3.05
2	019785	25 国债 13	22,000	2,227,776.05	1.21
3	019792	25 国债 19	16,000	1,616,787.73	0.88

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约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	19,134.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	770,493.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	789,627.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	113,052.52	0.06	新股流通受限
2	001248	华润新能源	53,967.18	0.03	新股流通受限
2	001248	华润新能源	23,121.57	0.01	新股未上市
3	688808	联讯仪器	63,373.20	0.03	新股流通受限
4	688818	电科蓝天	37,033.92	0.02	新股流通受限
5	688820	盛合晶微	33,391.64	0.02	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

中欧沪深 300 指数发起 A	4,014	23,168.26	80,016,106.77	86.04%	12,981,270.90	13.96%
中欧沪深 300 指数发起 C	1,284	31,795.70	18,188,996.18	44.55%	22,636,687.83	55.45%
中欧沪深 300 指数发起 Y	1,021	5,287.90	0.00	0.00%	5,398,948.29	100.00%
合计	6,319	22,032.29	98,205,102.95	70.54%	41,016,907.02	29.46%

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	中欧沪深 300 指数发起 A	0.00	0.00%
	中欧沪深 300 指数发起 C	0.00	0.00%
	中欧沪深 300 指数发起 Y	74,184.44	1.37%
	合计	74,184.44	0.05%

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	中欧沪深 300 指数发起 A	0
	中欧沪深 300 指数发起 C	0
	中欧沪深 300 指数发起 Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧沪深 300 指数发起 A	0
	中欧沪深 300 指数发起 C	0
	中欧沪深 300 指数发起 Y	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,350.14	7.18%	10,001,350.14	7.18%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,350.14	7.18%	10,001,350.14	7.18%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
基金合同生效日（2024 年 11 月 29 日）基金份额总额	61,116,394.56	144,659,746.93	-
本报告期期初基金份额总额	104,820,069.67	38,306,233.12	2,226,687.35
本报告期基金总申购份额	12,291,735.78	36,112,464.21	5,243,546.85
减：本报告期基金总赎回份额	24,114,427.78	33,593,013.32	2,071,285.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,997,377.67	40,825,684.01	5,398,948.29

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

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国泰海通	1	46,337,446.12	44.67	8,615.52	44.69	—
华泰证券	1	45,435,075.40	43.80	8,445.27	43.81	—
申万宏源证券	1	11,867,428.95	11.44	2,205.58	11.44	—
长江证券	1	102,209.97	0.10	11.74	0.06	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	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。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,226,537.02	41.19	66,060,000.00	70.15	-	-
申万宏源证券	6,033,430.57	58.81	28,110,000.00	29.85	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22

2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
3	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（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06

§ 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	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	30,705,781.33	0.00	0.00	30,705,781.33	22.06 %
	2	2026 年 06 月 02 日至 2026 年 06 月 30 日	20,626,185.18	18,188,996.18	0.00	38,815,181.36	27.88 %
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

2026 年 8 月 29 日