

中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 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：兴业证券股份有限公司

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。

基金托管人兴业证券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	12
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61

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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
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	65
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	中欧中证 500 指数增强		
基金主代码	015453		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 5 月 6 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	兴业证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,662,084,472.85 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 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
下属分级基金的交易代码	015453	015454	019694
报告期末下属分级基金的份额总额	928,010,873.88 份	651,945,021.39 份	82,128,577.58 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，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%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 500 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%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证 500 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。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 500 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。

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	兴业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	李少峰
	联系电话	021-68609600	021-20370710

	电子邮箱	liyihai@zofund.com	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95562
传真		021-50190017	0591-38507797
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	福建省福州市湖东路 268 号证券大厦
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	上海浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 11 楼
邮政编码		200120	200135
法定代表人		窦玉明	苏军良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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)		
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
本期已实现收益	278,272,691.64	153,454,849.95	18,718,797.78
本期利润	284,150,619.46	126,837,269.47	18,606,436.19
加权平均基金份额本期利润	0.2407	0.1836	0.2293
本期加权平均净值利润率	15.47%	12.06%	14.90%
本期基金份额	19.03%	18.68%	18.73%

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	487,318,063.12	317,687,411.74	41,468,741.73
期末可供分 配基金份额 利润	0.5251	0.4873	0.5049
期末基金资 产净值	1,549,481,682.88	1,061,849,031.80	135,351,361.69
期末基金份 额净值	1.6697	1.6287	1.6480
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	66.97%	62.87%	85.36%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证 500 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
过去三个月	16.19%	1.51%	17.61%	1.56%	-1.42%	-0.05%
过去六个月	19.03%	1.55%	19.93%	1.58%	-0.90%	-0.03%
过去一年	53.23%	1.34%	49.68%	1.35%	3.55%	-0.01%

过去三年	75.74%	1.39%	48.15%	1.41%	27.59%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	66.97%	1.25%	55.99%	1.30%	10.98%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 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 500 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
过去三个月	16.01%	1.51%	17.61%	1.56%	-1.60%	-0.05%
过去六个月	18.68%	1.55%	19.93%	1.58%	-1.25%	-0.03%
过去一年	52.31%	1.34%	49.68%	1.35%	2.63%	-0.01%
过去三年	72.60%	1.39%	48.15%	1.41%	24.45%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	62.87%	1.25%	55.99%	1.30%	6.88%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 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 500 指数增强 E

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	16.04%	1.51%	17.61%	1.56%	-1.57%	-0.05%
过去六个月	18.73%	1.55%	19.93%	1.58%	-1.20%	-0.03%
过去一年	52.47%	1.34%	49.68%	1.35%	2.79%	-0.01%
自基金份额起始运 作日至今	85.36%	1.44%	60.57%	1.47%	24.79%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 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500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



中欧中证500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



中欧中证500指数增强E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 2023 年 11 月 1 日新增 E 类份额，图示日期为 2023 年 11 月 2 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		
钱亚婷	基金经理 / 基金经理助理	2022-05-06	—	10 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任分析师、基金经理助理。
赵子衡	基金经理 / 基金经	2024-04-23	—	4 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

	理助理				
徐熙宁	基金经理 / 基金经理助理	2026-03-09	-	3 年	2022-07-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
宋婷	量化投委会委员 / 基金经理	2025-02-21	-	8 年	历任上海千象资产管理有限公司股票研究员、股票投资经理。2023-07-03 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中钱亚婷担任本基金的基金经理；赵子衡担任本基金的基金经理助理；徐熙宁担任本基金的基金经理助理。

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

2026 年上半年，国内经济在温和通胀、政策积极支持的背景下平稳运行，呈现外需相对稳定、内需逐步恢复、新动能表现较好的特点，并在二季度进一步确认了温和复苏的方向，海外则始终笼罩在不确定性之中，美伊冲突推升油价与美联储货币政策转鹰成为贯穿全程的两条外部压制线索，而国内层面 3 月 PPI 同比 41 个月来首次转正、企业盈利拐点显现；行业层面，年初能源与资源板块成为亮点，但 5 月以来随大宗价格高位回落而明显调整，电子、通信为代表的“新质生产力”持续领涨，消费板块则全程偏弱。

因子表现方面，今年以来表现突出的因子中，动量与 Beta 表现最为强劲，说明市场呈现显著的趋势行情，资金积极追逐高弹性资产。同时，成长性因子表现亮眼。相对而言，基本面质量与价值因子表现承压。投资质量、短期反转及盈利质量的表现偏弱，说明市场对传统防御性质量因子并不买账。市场呈现出极强的动量延续效应。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，在中证 500 成分股内进行选股，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差力争控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。本基金的选股策略是基于交易所深度行情和上市公司基本面等信息，应用数量化的投资方法，系统性地捕捉市场的非有效性，力争获取相对基准的超额收益。展望 2026 年，在经济温和复苏与政策支撑并存的背景下，市场机会与风险并存，风格轮动可能加快。我们借助基本面因子和量价因子的负相关性，持续挖掘数据特征规律，平衡高波动环境下的风险，力争让量化组合的超额收益更为平稳。

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 19.03%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；基金 C 类份额净值增长率为 18.68%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；基金 E 类份额净值增长率为 18.73%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对中国主要股指持积极看多的判断，主要逻辑有三：其一，随着“反内卷”政策引导与供给自然出清逐见成效，资本开支增速下行，部分行业供需格局已显著改善，A 股有望从流动性驱动转向业绩驱动，行情或得以延续；其二，估值仍有空间，横向折价充分。当前 A 股相较美股、韩股显著折价，与欧日大体接近，性价比突出；其三，《关于推动中长期资金入市工作的实施方案》落地，保险、社保、年金等长期资金加大入市力度，三年长周期考核引导“长钱长投”，资金端的制度红利将持续释放。

我们将坚持稳健克制的原则，通过基本面因子与量价因子的特征规律挖掘，平衡组合在高波动环境下的风险暴露。同时，密切关注宏观经济走势、政策导向落地节奏以及行业供需格局变化，把握结构性的投资机会；严格控制组合风险暴露，借助基本面与量价因子的负相关性，力争实现超额收益的平稳性。

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，基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定，遵守基金合同和托管协议的约定，勤勉尽责履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害基金份额持有人利益的行为，基金管理人在各重要方面的运作符合法律规定和基金合同约定。

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

基金托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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	132,582,253.50	77,100,259.60
结算备付金		17,381,675.04	2,853,011.12
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	2,636,847,811.73	1,707,098,593.86
其中：股票投资		2,586,752,846.53	1,681,521,030.57
基金投资		—	—
债券投资		50,094,965.20	25,577,563.29
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		12,807,776.48	55,738,646.19
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,799,619,516.75	1,842,790,510.77
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 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		34,990,841.09	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		14,475,888.28	39,327,696.01
应付管理人报酬		2,296,096.74	1,634,144.45
应付托管费		344,414.50	245,121.66
应付销售服务费		577,965.24	288,290.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		863.86	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	251,370.67	50,000.00
负债合计		52,937,440.38	41,545,252.40
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	1,662,084,472.85	1,292,272,732.09
未分配利润	6.4.7.8	1,084,597,603.52	508,972,526.28
净资产合计		2,746,682,076.37	1,801,245,258.37
负债和净资产总计		2,799,619,516.75	1,842,790,510.77

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,662,084,472.85 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.6697 元，基金份额总额 928,010,873.88 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.6287 元，基金份额总额 651,945,021.39 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 1.6480 元，基金份额总额 82,128,577.58 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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		450,378,313.66	43,733,513.56
1. 利息收入		160,708.57	65,826.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	160,708.57	65,826.93
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）		470,486,274.39	25,685,014.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	446,635,433.75	20,301,785.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	185,348.86	45,883.20
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	3,992,242.64	1,107,982.92
股利收益	6.4.7.14	19,673,249.14	4,229,362.46
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	-20,852,014.25	17,917,435.37
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	583,344.95	65,236.81
减：二、营业总支出		20,783,988.54	2,579,806.62
1. 管理人报酬		14,931,009.88	1,777,253.90
2. 托管费		2,239,651.49	266,588.11
3. 销售服务费		3,426,566.86	432,897.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		77,175.87	5,452.09
其中：卖出回购金融资产支出		77,175.87	5,452.09
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		16,232.16	3,999.91
8. 其他费用	6.4.7.18	93,352.28	93,615.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		429,594,325.12	41,153,706.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		429,594,325.12	41,153,706.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		429,594,325.12	41,153,706.94

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 500 指数增强型证券投资基金

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	1,292,272,732.09	—	508,972,526.28	1,801,245,258.37
二、本期期初净资产	1,292,272,732.09	—	508,972,526.28	1,801,245,258.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	369,811,740.76	—	575,625,077.24	945,436,818.00
(一)、综合收益总额	—	—	429,594,325.12	429,594,325.12
(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)	369,811,740.76	—	146,030,752.12	515,842,492.88
其中：1. 基金申购款	3,204,247,725.34	—	1,694,664,869.87	4,898,912,595.21
2. 基金赎回款	-2,834,435,984.58	—	-1,548,634,117.75	-4,383,070,102.33
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—	—
四、本期期末净资产	1,662,084,472.85	—	1,084,597,603.52	2,746,682,076.37
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	321,151,363.97	—	-8,671,042.07	312,480,321.90

二、本期期初净资产	321,151,363.97	-	-8,671,042.07	312,480,321.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	50,413,437.59	-	38,775,669.89	89,189,107.48
(一)、综合收益总额	-	-	41,153,706.94	41,153,706.94
(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)	50,413,437.59	-	-2,378,037.05	48,035,400.54
其中：1. 基金申购款	518,947,667.83	-	7,583,568.29	526,531,236.12
2. 基金赎回款	-468,534,230.24	-	-9,961,605.34	-478,495,835.58
(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	371,564,801.56	-	30,104,627.82	401,669,429.38

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

中欧中证 500 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[2022]452 号《关于准予中欧中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 500 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 554,717,103.97 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第 61362990_B28 号验资报告予以验证。经向

中国证监会备案,《中欧中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 554,773,443.76 份基金份额,其中包含认购资金利息折合 56,339.79 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 239,826,320.08 份,包含认购利息折合 37,397.50 份;C 类基金的基金份额总额为 314,947,123.68 份,包含认购利息折合 18,942.29 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 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	20,007.02
等于：本金	20,000.00
加：应计利息	7.02
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	132,562,246.48
等于：本金	132,560,343.93
加：应计利息	1,902.55
减：坏账准备	-
合计	132,582,253.50

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,527,734,211.38	-	2,586,752,846.53	59,018,635.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,771,636.00	300,205.20	50,094,965.20	23,124.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	49,771,636.00	300,205.20	50,094,965.20	23,124.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,577,505,847.38	300,205.20	2,636,847,811.73	59,041,759.15

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	167,068.05
预提费用-审计费	24,795.19
应付补差费	0.06
合计	251,370.67

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 500 指数增强 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	876,442,559.35	876,442,559.35
本期申购	1,584,242,516.37	1,584,242,516.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,532,674,201.84	-1,532,674,201.84
本期末	928,010,873.88	928,010,873.88

中欧中证 500 指数增强 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	347,420,429.54	347,420,429.54
本期申购	1,492,182,123.15	1,492,182,123.15
本期赎回（以“-”号填列）	-1,187,657,531.30	-1,187,657,531.30
本期末	651,945,021.39	651,945,021.39

中欧中证 500 指数增强 E

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	68,409,743.20	68,409,743.20
本期申购	127,823,085.82	127,823,085.82
本期赎回（以“-”号填列）	-114,104,251.44	-114,104,251.44
本期末	82,128,577.58	82,128,577.58

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

中欧中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	249,482,097.64	103,556,547.45	353,038,645.09
本期期初	249,482,097.64	103,556,547.45	353,038,645.09
本期利润	278,272,691.64	5,877,927.82	284,150,619.46
本期基金份额交易产生的变动数	-40,436,726.16	24,718,270.61	-15,718,455.55
其中：基金申购款	552,249,973.42	296,444,852.12	848,694,825.54
基金赎回款	-592,686,699.58	-271,726,581.51	-864,413,281.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	487,318,063.12	134,152,745.88	621,470,809.00

中欧中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	89,224,814.11	40,163,746.15	129,388,560.26
本期期初	89,224,814.11	40,163,746.15	129,388,560.26
本期利润	153,454,849.95	-26,617,580.48	126,837,269.47
本期基金份额交易产生的变动数	75,007,747.68	78,670,433.00	153,678,180.68
其中：基金申购款	520,195,768.71	257,072,445.88	777,268,214.59
基金赎回款	-445,188,021.03	-178,402,012.88	-623,590,033.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	317,687,411.74	92,216,598.67	409,904,010.41

中欧中证 500 指数增强 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,542,603.78	8,002,717.15	26,545,320.93
本期期初	18,542,603.78	8,002,717.15	26,545,320.93
本期利润	18,718,797.78	-112,361.59	18,606,436.19
本期基金份额交易产生的变动数	4,207,340.17	3,863,686.82	8,071,026.99
其中：基金申购款	47,459,809.58	21,242,020.16	68,701,829.74
基金赎回款	-43,252,469.41	-17,378,333.34	-60,630,802.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,468,741.73	11,754,042.38	53,222,784.11

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	9,949.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	43,858.74
结算备付金利息收入	102,233.23
其他	4,667.34
合计	160,708.57

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	10,688,299,173.05
减：卖出股票成本总额	10,231,950,203.00
减：交易费用	9,713,536.30
买卖股票差价收入	446,635,433.75

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	187,370.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,022.00
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	185,348.86

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	6,082,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,002,022.00
减：应计利息总额	82,200.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,022.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,992,242.64

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	19,673,249.14
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	19,673,249.14

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	-20,852,014.25
股票投资	-20,878,076.25
债券投资	26,062.00
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	-20,852,014.25

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	574,170.21
基金转换费收入	9,174.74
合计	583,344.95

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	9,000.00
存托服务费	49.72
合计	93,352.28

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
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	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
自然人股东	基金管理人的股东
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（%）
兴业证券	14,600,986,548.02	66.85	1,012,199,429.81	78.71

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 (%)
兴业证券	30,387,111.23	100.00	3,324,834.52	100.00

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 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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
兴业证券	626,741,000.00	100.00	19,800,000.00	100.00

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 (%)
兴业证券	1,984,388.10	66.85	-	-
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 (%)
兴业证券	188,578.06	78.74	-	-

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	14,931,009.88	1,777,253.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,702,524.73	546,786.03
应支付基金管理人的净管理费	9,228,485.15	1,230,467.87

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。

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
当期发生的基金应支付的托管费	2,239,651.49	266,588.11

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

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			
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E	合计
国都证券	0.00	75.91	0.00	75.91

兴业证券股份有限公司	0.00	323,383.02	0.00	323,383.02
中欧财富	0.00	10,717.97	924.75	11,642.72
中欧基金	0.00	68,972.49	78,435.40	147,407.89
合计	0.00	403,149.39	79,360.15	482,509.54
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			
	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E	合计
国都证券	0.00	46.35	0.00	46.35
兴业证券股份有限公司	0.00	189,543.46	0.00	189,543.46
中欧财富	0.00	148.02	372.80	520.82
中欧基金	0.00	29,885.15	42,740.15	72,625.30
合计	0.00	219,622.98	43,112.95	262,735.93

注：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：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

D 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销售服务费按前一日 E 类基金份额的基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=D \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

D 为 E 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、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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

中欧中证 500 指数增强 E

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	0.00	168,709.93
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	168,709.93
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00	0.53%

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

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧中证 500 指数增强 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中欧财富	372.22	0.00%	867.93	0.00%
自然人股东	124,712.91	0.02%	165,426.66	0.05%

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

2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 A 类基金份额、E 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
兴业证券股份有限公司	89,920,161.73	34,200.17	15,413,529.66	47,142.62

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（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	57	1,596.00	1,583.46	-

001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇	2026 年 4 月	6 个月	新股流通	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

	智能	月 22 日		受限						
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信	2026 年 1	6 个月	新股流通	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

	股份	月 8 日		受限						
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
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	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思	2026 年 2	6 个月	新股 流通	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

	维	月 4 日		受限						
688818	电 科 蓝 天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 34,990,841.09 元，于 2026 年 7 月 6 日和 7 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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，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%的基础上，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的检查和反馈。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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	132,582,253.50	-	-	-	132,582,253.50
结算备付金	17,381,675.04	-	-	-	17,381,675.04
交易性金融资产	50,094,965.20	-	-	-2,586,752,846.53	2,636,847,811.73
应收申购款	-	-	-	12,807,776.48	12,807,776.48
资产总计	200,058,893.74	-	-	-2,599,560,623.01	2,799,619,516.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,475,888.28	14,475,888.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,296,096.74	2,296,096.74
应付托管费	-	-	-	344,414.50	344,414.50
卖出回购金融资产款	34,990,841.09	-	-	-	34,990,841.09
应付销售服务费	-	-	-	577,965.24	577,965.24
应交税费	-	-	-	863.86	863.86
其他负债	-	-	-	251,370.67	251,370.67
负债总计	34,990,841.09	-	-	17,946,599.29	52,937,440.38
利率敏感度缺口	165,068,052.65	-	-	-2,581,614,023.72	2,746,682,076.37
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	77,100,259.60	-	-	-	77,100,259.60
结算备付金	2,853,011.12	-	-	-	2,853,011.12
交易性金融资产	25,577,563.29	-	-	-1,681,521,030.57	1,707,098,593.86
应收申购款	-	-	-	55,738,646.19	55,738,646.19
资产总计	105,530,834.01	-	-	-1,737,259,676.76	1,842,790,510.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,327,696.01	39,327,696.01
应付管理人报酬	-	-	-	1,634,144.45	1,634,144.45
应付托管费	-	-	-	245,121.66	245,121.66
应付销售服务费	-	-	-	288,290.28	288,290.28
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	41,545,252.40	41,545,252.40
利率敏感度缺口	105,530,834.01	-	-	-1,695,714,424.36	1,801,245,258.37

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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 1.82%（2025 年 12 月 31 日：1.42%），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（%）
交易性金融资产—股票投资	2,586,752,846.53	94.18	1,681,521,030.57	93.35
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	2,586,752,846.53	94.18	1,681,521,030.57	93.35

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%	132,464,174.96	88,236,653.89
	业绩比较基准下降	-132,464,174.96	-88,236,653.89

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,583,721,217.40	1,679,330,562.44
第二层次	50,945,256.64	25,577,563.29
第三层次	2,181,337.69	2,190,468.13
合计	2,636,847,811.73	1,707,098,593.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	2,586,752,846.53	92.40
	其中：股票	2,586,752,846.53	92.40
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	50,094,965.20	1.79
	其中：债券	50,094,965.20	1.79
	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	149,963,928.54	5.36
8	其他各项资产	12,807,776.48	0.46
9	合计	2,799,619,516.75	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	5,487,692.00	0.20
B	采矿业	102,180,390.10	3.72
C	制造业	1,888,505,782.94	68.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,438,621.90	1.73
E	建筑业	13,229,956.03	0.48
F	批发和零售业	68,376,725.00	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	19,587,753.57	0.71
H	住宿和餐饮业	5,742,408.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	150,965,334.55	5.50

J	金融业	186,178,002.69	6.78
K	房地产业	13,026,019.64	0.47
L	租赁和商务服务业	24,027,329.72	0.87
M	科学研究和技术服务业	23,764,244.40	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	24,921,928.00	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	968,968.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	5,470,115.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	2,579,871,271.54	93.93

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	69,414.00	0.00
B	采矿业	95,983.42	0.00
C	制造业	5,386,683.05	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	928,511.44	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,976.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,145.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,711.12	0.01
J	金融业	30,902.00	0.00
K	房地产业	51,063.00	0.00
L	租赁和商务服务业	73,257.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	33,478.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	27,450.00	0.00
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	6,881,574.99	0.25

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	688498	源杰科技	23,079	43,526,994.00	1.58
2	600390	五矿资本	8,392,120	38,268,067.20	1.39
3	300604	长川科技	103,900	35,473,538.00	1.29
4	001309	德明利	36,800	34,698,720.00	1.26
5	002008	大族激光	228,200	34,255,102.00	1.25
6	300857	协创数据	98,600	33,514,140.00	1.22
7	601665	齐鲁银行	5,486,000	31,654,220.00	1.15
8	688347	华虹宏力	91,686	30,834,001.80	1.12
9	002299	圣农发展	1,998,406	30,295,834.96	1.10
10	300475	香农芯创	97,700	29,310,000.00	1.07
11	300223	君正股份	112,700	28,051,030.00	1.02
12	002281	光迅科技	103,400	26,567,596.00	0.97
13	300073	当升科技	547,800	26,316,312.00	0.96
14	688561	奇安信	1,078,850	25,870,823.00	0.94
15	600105	永鼎股份	350,700	23,665,236.00	0.86
16	002273	水晶光电	641,600	22,763,968.00	0.83
17	000060	中金岭南	2,737,271	20,721,141.47	0.75
18	688469	芯联集成	1,930,670	20,484,408.70	0.75
19	688361	中科飞测	46,422	19,961,460.00	0.73
20	002436	兴森科技	385,700	19,651,415.00	0.72
21	688002	睿创微纳	124,839	19,311,344.91	0.70
22	002266	浙富控股	3,808,100	19,268,986.00	0.70
23	000683	博源化工	3,305,380	19,038,988.80	0.69
24	300054	鼎龙股份	174,200	18,459,974.00	0.67
25	300373	扬杰科技	114,450	17,994,973.50	0.66
26	300136	信维通信	145,800	17,386,650.00	0.63
27	600601	方正科技	1,240,200	17,164,368.00	0.62
28	300285	国瓷材料	164,900	17,014,382.00	0.62
29	688220	翱捷科技	136,097	16,919,579.04	0.62
30	002851	麦格米特	100,100	16,734,718.00	0.61
31	002738	中矿资源	281,160	16,585,628.40	0.60
32	002517	恺英网络	1,011,900	16,443,375.00	0.60
33	300757	罗博特科	26,500	16,403,500.00	0.60

34	688120	华海清科	50,742	16,348,057.56	0.60
35	603256	宏和科技	60,400	16,025,932.00	0.58
36	603077	和邦生物	6,897,900	16,003,128.00	0.58
37	603345	安井食品	198,801	15,941,852.19	0.58
38	001286	陕西能源	1,532,400	15,538,536.00	0.57
39	600801	华新建材	992,100	15,476,760.00	0.56
40	301526	国际复材	323,300	15,088,411.00	0.55
41	601555	东吴证券	1,905,000	15,087,600.00	0.55
42	600352	浙江龙盛	1,235,400	14,960,694.00	0.54
43	002465	海格通信	1,167,000	14,902,590.00	0.54
44	002064	华峰化学	1,564,500	14,847,105.00	0.54
45	002126	银轮股份	287,600	14,322,480.00	0.52
46	688180	君实生物	418,154	14,141,968.28	0.51
47	300548	长芯博创	50,200	13,955,600.00	0.51
48	600711	盛屯矿业	1,266,800	13,896,796.00	0.51
49	300390	天华新能	147,100	13,755,321.00	0.50
50	300666	江丰电子	36,600	13,490,760.00	0.49
51	300919	中伟新材	306,500	13,409,375.00	0.49
52	600369	西南证券	3,334,300	13,403,886.00	0.49
53	002152	广电运通	1,427,861	13,393,336.18	0.49
54	601699	潞安环能	936,200	13,368,936.00	0.49
55	300759	康龙化成	458,300	13,258,619.00	0.48
56	001389	广合科技	55,800	13,238,550.00	0.48
57	300623	捷捷微电	292,800	13,173,072.00	0.48
58	688777	中控技术	111,431	13,093,142.50	0.48
59	300115	长盈精密	467,800	13,070,332.00	0.48
60	300395	菲利华	97,100	12,985,183.00	0.47
61	603308	应流股份	214,400	12,949,760.00	0.47
62	601608	中信重工	2,713,800	12,944,826.00	0.47
63	600498	烽火通信	174,200	12,821,120.00	0.47
64	600380	健康元	1,343,402	12,654,846.84	0.46
65	601233	桐昆股份	583,600	12,634,940.00	0.46
66	600595	中孚实业	2,242,000	12,600,040.00	0.46
67	002271	东方雨虹	1,054,700	12,519,289.00	0.46
68	603939	益丰药房	695,100	12,497,898.00	0.46
69	688599	天合光能	873,062	12,327,635.44	0.45
70	603225	新凤鸣	626,760	12,315,834.00	0.45
71	300432	富临精工	610,200	12,258,918.00	0.45
72	000629	钒钛股份	3,664,900	12,240,766.00	0.45
73	300017	网宿科技	931,724	12,121,729.24	0.44
74	600256	广汇能源	2,431,700	12,012,598.00	0.44
75	601108	财通证券	1,388,560	12,011,044.00	0.44
76	688538	和辉光电	4,597,579	11,953,705.40	0.44

77	301358	湖南裕能	153,000	11,608,110.00	0.42
78	000415	渤海租赁	2,840,068	11,559,076.76	0.42
79	002065	东华软件	1,615,800	11,536,812.00	0.42
80	002841	视源股份	328,100	11,329,293.00	0.41
81	605358	立昂微	145,800	11,314,080.00	0.41
82	688578	艾力斯	101,948	11,132,721.60	0.41
83	000960	锡业股份	255,800	10,920,102.00	0.40
84	600166	福田汽车	3,724,500	10,838,295.00	0.39
85	600499	科达制造	780,680	10,773,384.00	0.39
86	000967	盈峰环境	1,022,000	10,761,660.00	0.39
87	601869	长飞光纤	19,500	10,645,050.00	0.39
88	600606	绿地控股	8,786,743	10,631,959.03	0.39
89	603920	世运电路	218,600	10,501,544.00	0.38
90	300207	欣旺达	550,856	10,460,755.44	0.38
91	300567	精测电子	32,800	10,417,280.00	0.38
92	600497	驰宏锌锗	856,600	10,373,426.00	0.38
93	300748	金力永磁	331,185	10,217,057.25	0.37
94	003022	联泓新科	390,000	10,101,000.00	0.37
95	300058	蓝色光标	733,521	10,093,248.96	0.37
96	000987	越秀资本	1,283,100	10,033,842.00	0.37
97	603659	璞泰来	346,400	10,021,352.00	0.36
98	600316	洪都航空	358,500	10,016,490.00	0.36
99	000027	深圳能源	1,609,400	9,978,280.00	0.36
100	300346	南大光电	107,600	9,969,140.00	0.36
101	688099	晶晨股份	96,616	9,941,786.40	0.36
102	301536	星辰科技	76,269	9,816,582.99	0.36
103	601106	中国一重	2,969,200	9,798,360.00	0.36
104	688166	博瑞医药	278,705	9,757,462.05	0.36
105	688200	华峰测控	18,462	9,694,396.20	0.35
106	600884	杉杉股份	713,200	9,663,860.00	0.35
107	688172	燕东微	114,977	9,618,975.82	0.35
108	600885	宏发股份	278,800	9,615,812.00	0.35
109	600685	中船防务	374,100	9,517,104.00	0.35
110	000039	中集集团	1,167,800	9,470,858.00	0.34
111	688387	信科移动	468,843	9,301,845.12	0.34
112	000623	吉林敖东	523,100	9,274,563.00	0.34
113	688313	仕佳光子	49,886	9,211,449.90	0.34
114	002812	恩捷股份	137,200	9,180,052.00	0.33
115	300037	新宙邦	98,600	9,155,010.00	0.33
116	300751	迈为股份	32,300	9,123,458.00	0.33
117	600988	赤峰黄金	335,500	8,830,360.00	0.32
118	300953	震裕科技	65,380	8,741,306.00	0.32
119	002429	兆驰股份	841,000	8,737,990.00	0.32

120	002056	横店东磁	284,200	8,662,416.00	0.32
121	688037	芯源微	19,613	8,611,087.65	0.31
122	000951	中国重汽	441,109	8,606,036.59	0.31
123	600060	海信视像	304,400	8,483,628.00	0.31
124	000155	川能动力	697,200	8,352,456.00	0.30
125	300676	华大基因	236,000	8,274,160.00	0.30
126	603179	新泉股份	165,320	8,208,138.00	0.30
127	000800	一汽解放	1,364,800	8,120,560.00	0.30
128	002155	湖南黄金	340,000	8,115,800.00	0.30
129	000898	鞍钢股份	4,330,200	8,097,474.00	0.29
130	002414	高德红外	605,900	8,034,234.00	0.29
131	000783	长江证券	823,800	8,032,050.00	0.29
132	000034	神州数码	288,140	7,995,885.00	0.29
133	300620	光库科技	21,100	7,980,020.00	0.29
134	000750	国海证券	2,167,200	7,975,296.00	0.29
135	603379	三美股份	103,400	7,847,026.00	0.29
136	600655	豫园股份	1,906,000	7,833,660.00	0.29
137	600535	天士力	591,110	7,820,385.30	0.28
138	603658	安图生物	269,264	7,814,041.28	0.28
139	600927	永安期货	626,700	7,802,415.00	0.28
140	688778	厦钨新能	142,263	7,739,107.20	0.28
141	002120	韵达股份	1,194,100	7,594,476.00	0.28
142	688702	盛科通信	19,415	7,571,655.85	0.28
143	002153	石基信息	1,041,200	7,527,876.00	0.27
144	000893	亚钾国际	183,200	7,491,048.00	0.27
145	000703	恒逸石化	547,400	7,428,218.00	0.27
146	600764	中国海防	425,500	7,416,465.00	0.27
147	000878	云南铜业	466,200	7,403,256.00	0.27
148	301377	鼎泰高科	13,300	7,326,970.00	0.27
149	688385	复旦微电	101,479	7,234,437.91	0.26
150	002850	科达利	37,200	7,041,960.00	0.26
151	002265	建设工业	400,700	6,972,180.00	0.25
152	003031	中瓷电子	38,600	6,959,580.00	0.25
153	002756	永兴材料	120,600	6,830,784.00	0.25
154	688019	安集科技	19,933	6,766,456.18	0.25
155	688052	纳芯微	22,802	6,574,044.62	0.24
156	002487	大金重工	112,300	6,510,031.00	0.24
157	301611	珂玛科技	35,800	6,446,506.00	0.23
158	600663	陆家嘴	1,020,888	6,411,176.64	0.23
159	301200	大族数控	17,600	6,347,440.00	0.23
160	000830	鲁西化工	517,700	6,212,400.00	0.23
161	603766	隆鑫通用	513,900	6,130,827.00	0.22
162	002402	和而泰	234,500	6,057,135.00	0.22

163	000825	太钢不锈	1,763,100	6,012,171.00	0.22
164	600109	国金证券	662,168	5,813,835.04	0.21
165	600754	锦江酒店	319,200	5,742,408.00	0.21
166	600521	华海药业	398,000	5,731,200.00	0.21
167	600143	金发科技	369,000	5,701,050.00	0.21
168	688343	云天励飞	68,447	5,589,382.02	0.20
169	600546	山煤国际	504,800	5,517,464.00	0.20
170	600598	北大荒	505,700	5,481,788.00	0.20
171	300144	宋城演艺	941,500	5,470,115.00	0.20
172	601216	君正集团	1,217,900	5,431,834.00	0.20
173	600816	建元信托	2,213,400	5,400,696.00	0.20
174	600808	马钢股份	2,128,500	5,321,250.00	0.19
175	300957	贝泰妮	168,800	5,318,888.00	0.19
176	002966	苏州银行	761,100	5,297,256.00	0.19
177	001203	大中矿业	171,998	5,151,340.10	0.19
178	300458	全志科技	128,640	5,076,134.40	0.18
179	300735	光弘科技	222,982	5,070,610.68	0.18
180	600348	华阳股份	659,300	5,043,645.00	0.18
181	603087	甘李药业	88,700	5,034,612.00	0.18
182	603233	大参林	334,900	5,033,547.00	0.18
183	601156	东航物流	311,300	5,018,156.00	0.18
184	688213	思特威	46,493	4,978,005.51	0.18
185	603885	吉祥航空	478,900	4,927,881.00	0.18
186	601212	白银有色	967,300	4,913,884.00	0.18
187	002821	凯莱英	30,300	4,908,600.00	0.18
188	600100	同方股份	715,200	4,899,120.00	0.18
189	601399	国机重装	1,368,100	4,788,350.00	0.17
190	300677	英科医疗	121,300	4,751,321.00	0.17
191	300339	润和软件	120,200	4,628,902.00	0.17
192	300002	神州泰岳	590,100	4,608,681.00	0.17
193	688475	萤石网络	163,531	4,472,572.85	0.16
194	603156	养元饮品	90,900	4,460,463.00	0.16
195	600985	淮北矿业	315,700	4,435,585.00	0.16
196	000983	山西焦煤	764,600	4,434,680.00	0.16
197	000831	中国稀土	79,700	4,422,553.00	0.16
198	002926	华西证券	538,900	4,402,813.00	0.16
199	002683	广东宏大	149,600	4,381,784.00	0.16
200	688411	海博思创	14,936	4,349,363.20	0.16
201	688234	天岳先进	24,978	4,333,932.78	0.16
202	002500	山西证券	834,960	4,308,393.60	0.16
203	002432	九安医疗	60,900	4,304,412.00	0.16
204	600208	衢州发展	1,513,700	4,283,771.00	0.16
205	002203	海亮股份	181,900	4,156,415.00	0.15

206	000739	普洛药业	248,400	4,138,344.00	0.15
207	002409	雅克科技	18,200	4,085,900.00	0.15
208	603806	福斯特	239,300	4,017,847.00	0.15
209	600583	海油工程	791,100	3,979,233.00	0.14
210	300699	光威复材	138,800	3,976,620.00	0.14
211	000519	中兵红箭	184,300	3,883,201.00	0.14
212	300570	太辰光	15,500	3,824,005.00	0.14
213	688728	格科微	180,640	3,800,665.60	0.14
214	603979	金诚信	64,100	3,783,823.00	0.14
215	000062	深圳华强	117,600	3,742,032.00	0.14
216	600901	江苏金租	649,727	3,735,930.25	0.14
217	300496	中科创达	60,300	3,725,937.00	0.14
218	601139	深圳燃气	625,400	3,539,764.00	0.13
219	603699	纽威股份	69,998	3,520,899.40	0.13
220	688629	华丰科技	18,670	3,500,811.70	0.13
221	600282	南钢股份	762,400	3,499,416.00	0.13
222	688281	华秦科技	69,133	3,472,550.59	0.13
223	688676	金盘科技	38,939	3,295,796.96	0.12
224	600292	电投水电	261,800	3,152,072.00	0.11
225	300454	深信服	32,000	3,078,400.00	0.11
226	000883	湖北能源	704,700	3,044,304.00	0.11
227	601001	晋控煤业	175,000	3,043,250.00	0.11
228	688322	奥比中光	23,204	3,029,282.20	0.11
229	603596	伯特利	116,500	2,893,860.00	0.11
230	300679	电连技术	47,000	2,819,530.00	0.10
231	002603	以岭药业	187,200	2,808,000.00	0.10
232	601997	贵阳银行	528,200	2,709,666.00	0.10
233	600329	达仁堂	71,700	2,668,674.00	0.10
234	002195	岩山科技	401,100	2,623,194.00	0.10
235	000032	深桑达 A	103,860	2,591,307.00	0.09
236	000728	国元证券	345,220	2,585,697.80	0.09
237	300763	锦浪科技	28,200	2,547,870.00	0.09
238	600562	国睿科技	114,900	2,438,178.00	0.09
239	002185	华天科技	107,300	2,393,863.00	0.09
240	002131	利欧股份	499,500	2,372,625.00	0.09
241	600688	上海石化	807,000	2,364,510.00	0.09
242	601155	新城控股	227,200	2,331,072.00	0.08
243	688187	时代电气	33,749	2,317,206.34	0.08
244	300012	华测检测	157,100	2,177,406.00	0.08
245	600637	东方明珠	259,200	2,153,952.00	0.08
246	600483	福能股份	207,000	2,109,330.00	0.08
247	600871	石化油服	1,025,100	2,080,953.00	0.08
248	000738	航发控制	113,600	2,077,744.00	0.08

249	002945	华林证券	152,900	2,053,447.00	0.07
250	600299	安迪苏	261,300	2,051,205.00	0.07
251	600295	鄂尔多斯	190,376	2,040,830.72	0.07
252	600566	济川药业	91,200	2,023,728.00	0.07
253	300383	光环新网	160,000	1,990,400.00	0.07
254	600998	九州通	418,700	1,963,703.00	0.07
255	600312	平高电气	109,500	1,933,770.00	0.07
256	000709	河钢股份	993,200	1,926,808.00	0.07
257	301606	绿联科技	30,800	1,879,416.00	0.07
258	600642	申能股份	214,798	1,875,186.54	0.07
259	600392	盛和资源	62,800	1,869,556.00	0.07
260	002130	沃尔核材	98,500	1,867,560.00	0.07
261	002939	长城证券	216,400	1,804,776.00	0.07
262	688568	中科星图	43,503	1,804,069.41	0.07
263	600141	兴发集团	37,600	1,766,072.00	0.06
264	000997	新大陆	107,500	1,752,250.00	0.06
265	002025	航天电器	22,800	1,737,816.00	0.06
266	300001	特锐德	44,800	1,694,784.00	0.06
267	300140	节能环保	339,800	1,688,806.00	0.06
268	688192	迪哲医药	42,191	1,684,686.63	0.06
269	002472	双环传动	40,300	1,672,853.00	0.06
270	000921	海信家电	59,900	1,636,468.00	0.06
271	601666	平煤股份	222,300	1,589,445.00	0.06
272	600699	均胜电子	73,200	1,581,852.00	0.06
273	600602	云赛智联	98,200	1,579,056.00	0.06
274	601198	东兴证券	114,700	1,558,773.00	0.06
275	603486	科沃斯	29,500	1,497,125.00	0.05
276	000737	北方铜业	111,600	1,475,352.00	0.05
277	300146	汤臣倍健	155,500	1,405,720.00	0.05
278	300474	景嘉微	23,000	1,391,040.00	0.05
279	601696	中银证券	109,900	1,390,235.00	0.05
280	600098	广州发展	233,496	1,379,961.36	0.05
281	000050	深天马 A	137,100	1,358,661.00	0.05
282	600339	中油工程	437,300	1,342,511.00	0.05
283	002624	完美世界	105,450	1,309,689.00	0.05
284	000582	北部湾港	120,100	1,288,673.00	0.05
285	000559	万向钱潮	94,200	1,218,006.00	0.04
286	000733	振华科技	21,500	1,217,760.00	0.04
287	601958	金钼股份	41,700	1,172,187.00	0.04
288	688772	珠海冠宇	59,412	1,166,257.56	0.04
289	600126	杭钢股份	184,100	1,128,533.00	0.04
290	000959	首钢股份	310,100	1,088,451.00	0.04
291	601567	三星电气	72,100	1,077,174.00	0.04

292	000021	深科技	16,400	1,054,028.00	0.04
293	603858	步长制药	69,900	1,020,540.00	0.04
294	600763	通策医疗	28,600	968,968.00	0.04
295	300718	长盛轴承	15,338	935,157.86	0.03
296	603728	鸣志电器	14,700	895,524.00	0.03
297	000932	华菱钢铁	256,500	890,055.00	0.03
298	600863	华能蒙电	181,000	850,700.00	0.03
299	603568	伟明环保	52,800	812,064.00	0.03
300	601577	长沙银行	87,700	763,867.00	0.03
301	600008	首创环保	278,500	757,520.00	0.03
302	603298	杭叉集团	30,100	718,186.00	0.03
303	600563	法拉电子	3,600	686,880.00	0.03
304	601615	明阳智能	57,200	661,804.00	0.02
305	600298	安琪酵母	17,700	640,740.00	0.02
306	688017	绿的谐波	1,409	588,764.74	0.02
307	002601	龙佰集团	35,300	581,744.00	0.02
308	688331	荣昌生物	4,338	565,067.88	0.02
309	002078	太阳纸业	40,100	500,849.00	0.02
310	601000	唐山港	111,098	461,056.70	0.02
311	688235	百济神州	1,793	456,515.73	0.02
312	600131	国网信通	30,500	445,300.00	0.02
313	002340	格林美	66,000	436,260.00	0.02
314	301301	川宁生物	49,400	392,236.00	0.01
315	600737	中粮糖业	31,100	383,463.00	0.01
316	300003	乐普医疗	32,100	380,385.00	0.01
317	600967	内蒙一机	27,700	300,545.00	0.01
318	603565	中谷物流	29,827	292,602.87	0.01
319	300487	蓝晓科技	4,800	282,480.00	0.01
320	002831	裕同科技	7,800	277,368.00	0.01
321	688301	奕瑞科技	2,108	261,392.00	0.01
322	603119	浙江荣泰	3,300	218,922.00	0.01
323	688266	泽璟制药	1,597	186,306.02	0.01
324	688375	国博电子	1,261	131,522.30	0.00
325	603737	三棵树	5,400	130,140.00	0.00
326	600363	联创光电	2,600	93,028.00	0.00
327	002407	多氟多	1,500	75,345.00	0.00
328	688122	西部超导	1,060	66,578.60	0.00
329	600517	国网英大	12,135	56,791.80	0.00
330	600486	扬农化工	900	45,630.00	0.00
331	688248	南网科技	630	43,583.40	0.00
332	603160	汇顶科技	600	37,026.00	0.00
333	600177	雅戈尔	3,600	27,108.00	0.00
334	688520	神州细胞	600	20,526.00	0.00

335	600909	华安证券	1,800	19,998.00	0.00
336	600536	中国软件	600	16,872.00	0.00
337	601865	福莱特	1,500	15,765.00	0.00
338	300142	沃森生物	1,200	15,588.00	0.00
339	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
340	603049	中策橡胶	300	13,443.00	0.00
341	603341	龙旗科技	300	12,747.00	0.00
342	600332	白云山	600	12,024.00	0.00
343	003035	南网能源	1,800	10,476.00	0.00
344	600021	上海电力	600	9,042.00	0.00
345	300627	华测导航	300	8,520.00	0.00
346	002423	中粮资本	900	7,407.00	0.00
347	601611	中国核建	600	6,690.00	0.00
348	601118	海南橡胶	1,200	5,904.00	0.00
349	000088	盐田港	1,200	4,908.00	0.00
350	600062	华润双鹤	300	4,812.00	0.00
351	600398	海澜之家	800	4,184.00	0.00
352	601717	中创智领	300	4,173.00	0.00
353	600765	中航重机	300	3,876.00	0.00
354	600157	永泰能源	2,200	3,542.00	0.00
355	000729	燕京啤酒	300	3,039.00	0.00
356	600153	建发股份	300	2,379.00	0.00

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	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
3	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
4	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
5	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
6	002012	凯恩股份	19,400	124,354.00	0.00
7	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
8	688700	东威科技	1,291	115,415.40	0.00
9	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.00
10	301439	泓淋电力	7,300	114,756.00	0.00
11	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
12	688005	容百科技	3,593	109,945.80	0.00
13	002443	金洲管道	11,100	105,783.00	0.00
14	688182	灿勤科技	2,367	101,946.69	0.00
15	300034	钢研高纳	5,900	101,126.00	0.00
16	301285	鸿日达	900	99,297.00	0.00
17	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
18	300489	光智科技	300	93,585.00	0.00

19	603897	长城科技	2,800	90,888.00	0.00
20	603926	铁流股份	5,100	90,219.00	0.00
21	300672	国科微	300	88,500.00	0.00
22	301500	飞南资源	3,300	85,965.00	0.00
23	000338	潍柴动力	3,000	81,750.00	0.00
24	000553	安道麦 A	15,100	80,785.00	0.00
25	300317	珈伟新能	19,700	79,194.00	0.00
26	601566	九牧王	9,600	78,048.00	0.00
27	002053	云南能投	7,500	73,725.00	0.00
28	688379	华光新材	866	72,769.98	0.00
29	688556	高测股份	5,415	71,911.20	0.00
30	300511	雪榕生物	13,800	69,414.00	0.00
31	603703	盛洋科技	6,100	67,710.00	0.00
32	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
33	002406	远东传动	9,300	61,008.00	0.00
34	301150	中一科技	960	60,585.60	0.00
35	688449	联芸科技	696	60,071.76	0.00
36	300839	博汇股份	5,100	59,721.00	0.00
37	002838	道恩股份	1,800	55,116.00	0.00
38	688035	德邦科技	600	55,080.00	0.00
39	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
40	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
41	688512	慧智微	3,299	52,685.03	0.00
42	301056	森赫股份	4,500	50,400.00	0.00
43	002115	三维通信	4,400	45,320.00	0.00
44	300568	星源材质	2,400	44,928.00	0.00
45	000045	深纺织 A	4,200	44,268.00	0.00
46	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
47	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
48	603985	恒润股份	1,500	36,030.00	0.00
49	603638	艾迪精密	1,500	35,175.00	0.00
50	300715	凯伦股份	2,100	34,566.00	0.00
51	000863	三湘印象	8,100	34,020.00	0.00
52	600409	三友化工	5,400	32,994.00	0.00
53	300249	依米康	2,100	32,340.00	0.00
54	603790	雅运股份	1,500	32,010.00	0.00
55	300697	电工合金	2,100	31,815.00	0.00
56	600623	华谊集团	3,800	30,666.00	0.00
57	688299	长阳科技	1,810	30,245.10	0.00
58	300016	北陆药业	3,900	29,913.00	0.00
59	000607	华媒控股	9,100	27,937.00	0.00
60	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
61	600475	华光环能	1,800	27,450.00	0.00

62	002795	永和智控	3,900	26,091.00	0.00
63	600549	厦门钨业	300	25,560.00	0.00
64	000957	中通客车	2,700	25,272.00	0.00
65	600188	兖矿能源	1,300	23,101.00	0.00
66	600717	天津港	5,800	22,562.00	0.00
67	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
68	002099	海翔药业	3,900	20,592.00	0.00
69	301260	格力博	1,500	20,265.00	0.00
70	605228	神通科技	1,500	20,145.00	0.00
71	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
72	002228	合兴包装	6,800	19,992.00	0.00
73	601168	西部矿业	700	18,998.00	0.00
74	300201	海伦哲	900	18,963.00	0.00
75	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
76	301189	奥尼电子	300	17,679.00	0.00
77	301096	百诚医药	300	17,157.00	0.00
78	601777	千里科技	2,100	17,136.00	0.00
79	000036	华联控股	3,900	17,043.00	0.00
80	000782	恒申新材	2,100	16,968.00	0.00
81	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
82	002979	雷赛智能	300	16,734.00	0.00
83	300523	辰安科技	900	16,542.00	0.00
84	688472	阿特斯	1,487	16,089.34	0.00
85	688658	悦康药业	1,247	16,036.42	0.00
86	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
87	000599	青岛双星	3,600	15,192.00	0.00
88	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
89	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
90	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
91	603799	华友钴业	300	14,478.00	0.00
92	603803	瑞斯康达	1,200	14,088.00	0.00
93	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
94	002793	罗欣药业	3,600	13,824.00	0.00
95	301382	蜂助手	300	13,800.00	0.00
96	603286	日盈电子	300	13,689.00	0.00
97	301136	招标股份	1,200	13,176.00	0.00
98	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
99	002286	保龄宝	1,500	12,375.00	0.00
100	600135	乐凯胶片	1,500	11,985.00	0.00
101	688619	罗普特	732	11,880.36	0.00
102	601969	海南矿业	1,500	11,865.00	0.00
103	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
104	000059	华锦股份	3,100	11,625.00	0.00

105	603093	南华期货	600	10,890.00	0.00
106	300050	世纪鼎利	1,800	10,656.00	0.00
107	600346	恒力石化	600	10,626.00	0.00
108	002519	银河电子	1,800	10,530.00	0.00
109	601688	华泰证券	500	10,310.00	0.00
110	301116	益客食品	1,200	10,272.00	0.00
111	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
112	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
113	600919	江苏银行	900	9,702.00	0.00
114	002493	荣盛石化	900	9,675.00	0.00
115	000807	云铝股份	400	8,856.00	0.00
116	688653	康希通信	496	8,620.48	0.00
117	002969	嘉美包装	600	8,448.00	0.00
118	002197	证通电子	1,400	8,036.00	0.00
119	300078	思创智联	2,700	8,019.00	0.00
120	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
121	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
122	001280	中国铀业	88	5,869.60	0.00
123	600980	北矿科技	300	5,625.00	0.00
124	301277	新天地	599	5,241.25	0.00
125	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
126	002488	金固股份	500	4,455.00	0.00
127	600886	国投电力	300	3,993.00	0.00
128	002593	日上集团	1,000	3,990.00	0.00
129	300277	汽轮科技	200	3,008.00	0.00
130	000938	紫光股份	100	2,886.00	0.00
131	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
132	603915	国茂股份	200	2,838.00	0.00
133	301039	中集车辆	400	2,820.00	0.00
134	301449	天溯计量	65	2,515.50	0.00
135	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
136	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
137	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
138	000626	远大控股	300	1,899.00	0.00
139	300933	中辰股份	300	1,824.00	0.00
140	300128	锦富技术	300	1,776.00	0.00
141	300429	强力新材	100	1,772.00	0.00
142	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
143	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
144	300424	航新科技	100	1,574.00	0.00
145	600973	宝胜股份	200	1,418.00	0.00
146	300168	万达信息	300	1,377.00	0.00
147	601700	风范股份	300	1,308.00	0.00

148	600468	百利电气	200	1,214.00	0.00
149	601061	中信金属	100	1,077.00	0.00
150	300134	大富科技	100	855.00	0.00
151	000949	新乡化纤	100	634.00	0.00
152	603126	中材节能	100	630.00	0.00
153	000100	TCL 科技	100	582.00	0.00
154	600333	长春燃气	100	502.00	0.00
155	000546	金圆股份	100	486.00	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	600487	亨通光电	91,841,984.80	5.10
2	000783	长江证券	89,892,138.00	4.99
3	600380	健康元	85,737,426.12	4.76
4	002281	光迅科技	82,827,856.03	4.60
5	000960	锡业股份	79,381,369.91	4.41
6	000060	中金岭南	78,514,214.68	4.36
7	300857	协创数据	77,936,967.90	4.33
8	600352	浙江龙盛	72,854,002.59	4.04
9	002008	大族激光	70,593,923.77	3.92
10	600863	华能蒙电	69,122,708.24	3.84
11	001286	陕西能源	67,766,769.00	3.76
12	000933	神火股份	67,410,974.00	3.74
13	603228	景旺电子	65,907,620.00	3.66
14	300073	当升科技	63,904,815.00	3.55
15	002271	东方雨虹	63,736,794.00	3.54
16	300017	网宿科技	63,124,262.33	3.50
17	000034	神州数码	62,902,768.40	3.49
18	688347	华虹宏力	62,599,424.72	3.48
19	002138	顺络电子	62,365,416.36	3.46
20	000426	兴业银锡	60,918,313.92	3.38
21	002738	中矿资源	59,510,981.20	3.30
22	688469	芯联集成	59,059,235.59	3.28
23	300604	长川科技	58,902,381.55	3.27
24	003022	联泓新科	58,825,597.00	3.27
25	601168	西部矿业	58,403,216.00	3.24
26	001389	广合科技	57,653,213.45	3.20
27	300223	君正股份	56,093,798.07	3.11
28	603659	璞泰来	55,998,872.33	3.11
29	688180	君实生物	55,574,157.12	3.09
30	603920	世运电路	55,076,741.21	3.06
31	002299	圣农发展	55,061,099.42	3.06

32	600109	国金证券	54,935,629.40	3.05
33	600497	驰宏锌锗	54,813,409.00	3.04
34	300136	信维通信	53,544,450.53	2.97
35	002436	兴森科技	53,389,540.00	2.96
36	002532	天山铝业	52,288,186.80	2.90
37	002152	广电运通	52,060,912.34	2.89
38	300735	光弘科技	51,538,413.16	2.86
39	601231	环旭电子	51,453,748.00	2.86
40	601665	齐鲁银行	50,911,451.00	2.83
41	688002	睿创微纳	50,679,639.04	2.81
42	000415	渤海租赁	50,502,938.00	2.80
43	688561	奇安信	50,459,778.91	2.80
44	000951	中国重汽	50,348,841.42	2.80
45	600499	科达制造	49,200,335.00	2.73
46	002273	水晶光电	49,164,535.00	2.73
47	002064	华峰化学	48,818,493.96	2.71
48	600390	五矿资本	48,602,597.80	2.70
49	002340	格林美	48,406,744.00	2.69
50	600663	陆家嘴	48,381,605.14	2.69
51	688599	天合光能	48,118,215.98	2.67
52	600601	方正科技	48,048,708.00	2.67
53	688525	佰维存储	48,009,384.73	2.67
54	603225	新凤鸣	47,489,930.60	2.64
55	002558	巨人网络	47,088,483.00	2.61
56	600801	华新建材	45,854,415.86	2.55
57	000728	国元证券	45,840,183.00	2.54
58	300142	沃森生物	44,784,061.92	2.49
59	300390	天华新能	44,677,836.00	2.48
60	600549	厦门钨业	44,339,353.34	2.46
61	002080	中材科技	44,055,553.25	2.45
62	301536	星宸科技	44,036,937.37	2.44
63	601958	金钼股份	43,549,190.00	2.42
64	300450	先导智能	43,516,212.00	2.42
65	300037	新宙邦	43,309,302.00	2.40
66	300373	扬杰科技	42,538,388.00	2.36
67	601198	东兴证券	42,295,656.00	2.35
68	688498	源杰科技	41,714,308.65	2.32
69	300957	贝泰妮	41,562,099.00	2.31
70	002624	完美世界	40,994,243.20	2.28
71	601555	东吴证券	40,930,950.00	2.27
72	600906	财达证券	40,424,671.00	2.24
73	002517	恺英网络	40,325,081.00	2.24
74	300454	深信服	40,227,704.00	2.23

75	600546	山煤国际	40,079,350.00	2.23
76	688220	翱捷科技	40,060,610.41	2.22
77	300757	罗博特科	39,983,990.00	2.22
78	002414	高德红外	39,958,226.86	2.22
79	002128	电投能源	39,906,703.00	2.22
80	601918	新集能源	39,860,488.00	2.21
81	600348	华阳股份	39,670,499.50	2.20
82	002851	麦格米特	39,591,649.08	2.20
83	301308	江波龙	39,583,585.00	2.20
84	601233	桐昆股份	39,325,395.82	2.18
85	688772	珠海冠宇	39,064,696.93	2.17
86	600970	中材国际	38,964,889.00	2.16
87	300395	菲利华	38,765,159.12	2.15
88	600988	赤峰黄金	38,703,643.00	2.15
89	002056	横店东磁	38,695,974.00	2.15
90	688778	厦钨新能	38,672,674.76	2.15
91	601699	潞安环能	38,283,539.10	2.13
92	002266	浙富控股	38,174,509.00	2.12
93	000683	博源化工	38,079,809.60	2.11
94	002353	杰瑞股份	38,035,732.00	2.11
95	300285	国瓷材料	38,027,379.44	2.11
96	601608	中信重工	37,634,402.50	2.09
97	300058	蓝色光标	37,444,468.10	2.08
98	603345	安井食品	36,908,502.21	2.05
99	300207	欣旺达	36,805,378.78	2.04
100	000155	川能动力	36,796,243.07	2.04
101	600685	中船防务	36,695,470.10	2.04
102	000039	中集集团	36,486,039.71	2.03

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	600487	亨通光电	127,279,363.16	7.07
2	002281	光迅科技	109,977,697.34	6.11
3	000783	长江证券	104,843,860.00	5.82
4	300857	协创数据	95,886,803.60	5.32
5	600549	厦门钨业	88,800,106.53	4.93
6	002008	大族激光	87,607,242.78	4.86
7	001389	广合科技	82,411,073.70	4.58
8	601168	西部矿业	81,604,964.40	4.53
9	000060	中金岭南	80,597,570.00	4.47
10	603228	景旺电子	79,579,682.35	4.42
11	000933	神火股份	77,041,263.22	4.28

12	000960	锡业股份	76,398,709.94	4.24
13	002436	兴森科技	73,157,268.00	4.06
14	600380	健康元	73,150,873.97	4.06
15	000426	兴业银锡	71,809,812.00	3.99
16	300017	网宿科技	70,893,411.32	3.94
17	600497	驰宏锌锗	70,044,347.00	3.89
18	002080	中材科技	68,872,835.00	3.82
19	600863	华能蒙电	68,496,509.16	3.80
20	002138	顺络电子	68,257,828.24	3.79
21	688525	佰维存储	67,010,643.04	3.72
22	300735	光弘科技	66,703,404.73	3.70
23	601918	新集能源	65,213,050.15	3.62
24	002624	完美世界	64,908,144.00	3.60
25	600352	浙江龙盛	64,348,160.00	3.57
26	603920	世运电路	63,060,993.26	3.50
27	603659	璞泰来	62,657,826.06	3.48
28	300604	长川科技	62,605,150.97	3.48
29	688347	华虹宏力	61,369,934.57	3.41
30	601231	环旭电子	59,484,370.00	3.30
31	000034	神州数码	58,428,907.86	3.24
32	600499	科达制造	58,326,414.00	3.24
33	001286	陕西能源	57,272,699.00	3.18
34	600546	山煤国际	56,687,868.00	3.15
35	300136	信维通信	55,910,138.40	3.10
36	688002	睿创微纳	55,864,943.42	3.10
37	300073	当升科技	55,528,576.90	3.08
38	000415	渤海租赁	54,493,575.70	3.03
39	003022	联泓新科	54,478,538.24	3.02
40	002353	杰瑞股份	54,390,723.18	3.02
41	600673	东阳光	53,824,823.00	2.99
42	601108	财通证券	53,636,607.00	2.98
43	600739	辽宁成大	53,519,544.00	2.97
44	002340	格林美	53,139,344.00	2.95
45	002532	天山铝业	52,875,849.72	2.94
46	300223	君正股份	51,558,447.68	2.86
47	300450	先导智能	51,553,480.65	2.86
48	601958	金钼股份	51,424,862.00	2.85
49	300373	扬杰科技	51,278,400.49	2.85
50	300037	新宙邦	50,697,886.16	2.81
51	002056	横店东磁	50,493,462.21	2.80
52	000951	中国重汽	50,403,901.01	2.80
53	300003	乐普医疗	50,308,090.74	2.79
54	688772	珠海冠宇	50,253,653.22	2.79

55	300496	中科创达	50,251,184.55	2.79
56	002558	巨人网络	50,090,637.00	2.78
57	002414	高德红外	49,758,427.26	2.76
58	002271	东方雨虹	49,534,889.10	2.75
59	600663	陆家嘴	49,417,502.52	2.74
60	300142	沃森生物	48,927,682.00	2.72
61	002152	广电运通	48,579,597.00	2.70
62	000657	中钨高新	48,343,625.96	2.68
63	688220	翱捷科技	48,300,014.55	2.68
64	600166	福田汽车	47,789,046.00	2.65
65	600109	国金证券	47,738,643.30	2.65
66	000733	振华科技	47,635,060.00	2.64
67	688469	芯联集成	46,154,754.59	2.56
68	601555	东吴证券	45,990,887.45	2.55
69	688180	君实生物	45,788,701.12	2.54
70	301536	星辰科技	45,609,407.33	2.53
71	301308	江波龙	45,015,621.84	2.50
72	300390	天华新能	44,546,591.48	2.47
73	688599	天合光能	44,456,423.71	2.47
74	300567	精测电子	44,406,824.00	2.47
75	002738	中矿资源	44,061,472.04	2.45
76	300207	欣旺达	43,968,056.12	2.44
77	601061	中信金属	43,268,313.51	2.40
78	002128	电投能源	43,203,680.78	2.40
79	000050	深天马 A	42,874,966.00	2.38
80	000728	国元证券	42,034,461.40	2.33
81	603699	纽威股份	41,580,452.00	2.31
82	300454	深信服	41,277,742.00	2.29
83	300285	国瓷材料	41,150,831.00	2.28
84	600988	赤峰黄金	41,035,360.19	2.28
85	300395	菲利华	40,450,988.84	2.25
86	600906	财达证券	40,359,728.00	2.24
87	600098	广州发展	40,308,131.00	2.24
88	600378	昊华科技	40,142,919.00	2.23
89	600601	方正科技	38,591,748.40	2.14
90	600970	中材国际	38,589,314.00	2.14
91	601865	福莱特	38,509,238.00	2.14
92	603225	新凤鸣	38,463,976.00	2.14
93	601198	东兴证券	38,265,863.00	2.12
94	002273	水晶光电	37,964,124.32	2.11
95	688561	奇安信	37,836,330.05	2.10
96	600517	国网英大	37,547,318.00	2.08
97	603979	金诚信	37,503,929.44	2.08

98	000887	中鼎股份	37,238,299.26	2.07
99	300146	汤臣倍健	37,157,159.00	2.06
100	600096	云天化	36,923,371.85	2.05
101	600583	海油工程	36,542,157.00	2.03
102	002299	圣农发展	36,303,009.30	2.02
103	601717	中创智领	36,279,932.83	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,158,060,095.21
卖出股票收入（成交）总额	10,688,299,173.05

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	50,094,965.20	1.82
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	50,094,965.20	1.82

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	019835	26 国债 09	304,000	30,450,030.90	1.11
2	019785	25 国债 13	194,000	19,644,934.30	0.72

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,807,776.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,807,776.48

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	001248	华润新能源	255,085.41	0.01	新股未上市
1	001248	华润新能源	595,206.03	0.02	新股流通受限
2	301666	大普微	565,262.60	0.02	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	新股流通受限
4	688808	联讯仪器	258,245.79	0.01	新股流通受限
5	001399	惠科股份	179,912.24	0.01	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧中证 500 指数增强 A	477,473	1,943.59	193,855,202.59	20.89%	734,155,671.29	79.11%
中欧中证 500 指数增强 C	35,954	18,132.75	109,509,809.95	16.80%	542,435,211.44	83.20%
中欧中证 500 指数增强 E	13,291	6,179.26	23,128,048.98	28.16%	59,000,528.60	71.84%
合计	526,718	3,155.55	326,493,061.52	19.64%	1,335,591,411.33	80.36%

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 500 指数增强 A	127,056.67	0.01%
	中欧中证 500 指数增强 C	131,640.62	0.02%
	中欧中证 500 指数增强 E	0.00	0.00%

	合计	258,697.29	0.02%
--	----	------------	-------

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 500 指数增强 A	0
	中欧中证 500 指数增强 C	0
	中欧中证 500 指数增强 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 500 指数增强 A	0
	中欧中证 500 指数增强 C	0
	中欧中证 500 指数增强 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 500 指数增强 A	中欧中证 500 指数增强 C	中欧中证 500 指数增强 E
基金合同生效日（2022 年 5 月 6 日）基金份额总额	239,826,320.08	314,947,123.68	—
本报告期期初基金份额总额	876,442,559.35	347,420,429.54	68,409,743.20
本报告期基金总申购份额	1,584,242,516.37	1,492,182,123.15	127,823,085.82
减：本报告期基金总赎回份额	1,532,674,201.84	1,187,657,531.30	114,104,251.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	928,010,873.88	651,945,021.39	82,128,577.58

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

2026 年 6 月 5 日起，汪浩同志不再担任兴业证券资产托管部副总经理。

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

本报告期基金托管人的公募基金托管业务未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受调查或处罚。

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 (%)	
兴业证券	3	14,600,986,548.02	66.85	1,984,388.10	66.85	—
国投证券	3	7,241,856,79	33.15	984,199.14	33.15	—

		3.54				
--	--	------	--	--	--	--

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 (%)
兴业证券	30,387,111.23	100.00	626,741,000.00	100.00	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-16
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	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
4	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-27
5	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-29
6	中欧基金管理有限公司关于调整旗下	中国证监会指定媒介	2026-03-21

	部分基金持有“赤峰黄金”股票估值方法的公告		
7	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
8	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
9	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
10	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
11	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
12	中欧中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
13	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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日