

中欧上证科创板综合指数量化增强型证券
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧上证科创板综合指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	中欧上证科创板综合指数量化增强	
基金主代码	024891	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 1 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	114,690,016.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	中欧上证科创板综合指数量化增强 C
下属分级基金的交 易代码	024891	024892
报告期末下属分级 基金的份额总额	76,136,890.20 份	38,553,126.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用基金管理人量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合，以争取实现指数增强型基金的目标。 本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。本基金坚持研究创造价值的理念，通过对上市公司深入、持续的研究，依托基金管理人研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合，精选具有较强竞争优势的公司，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×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，跟踪上证科创板综合指数，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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	张姗
	联系电话	021-68609600	400-61-95555
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	400-61-95555
传真		021-50190017	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		窦玉明	缪建民

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)	
	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	中欧上证科创板综合指数量化增强 C
本期已实现收益	54,185,468.51	28,416,647.64
本期利润	66,270,609.94	33,333,382.97
加权平均基金份 额本期利润	0.4806	0.4776

本期加权平均净 值利润率	41.07%	40.80%
本期基金份额净 值增长率	53.92%	53.59%
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	36,221,705.84	18,151,855.63
期末可供分配基 金份额利润	0.4757	0.4708
期末基金资产净 值	119,624,049.35	60,371,592.07
期末基金份额净 值	1.5712	1.5659
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	57.12%	56.59%

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

中欧上证科创板综合指数量化增强 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	53.74%	2.35%	52.44%	2.24%	1.30%	0.11%
过去六个月	53.92%	2.22%	50.92%	2.11%	3.00%	0.11%
自基金合同生效起 至今	57.12%	1.83%	54.03%	1.96%	3.09%	-0.13%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*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。

中欧上证科创板综合指数量化增强 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	53.58%	2.35%	52.44%	2.24%	1.14%	0.11%
过去六个月	53.59%	2.22%	50.92%	2.11%	2.67%	0.11%
自基金合同生效起至今	56.59%	1.83%	54.03%	1.96%	2.56%	-0.13%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*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

中欧上证科创板综合指数量化增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 1 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧上证科创板综合指数量化增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 1 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

§ 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	2025-09-01	-	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 经理助理	2025-10-21	-	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。
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。

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。

本基金是以上证科创板综合指数为基准的指数增强基金，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，整体组合持仓较为分散。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，追求穿越周期的稳健超额。

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 53.92%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；基金 C 类份额净值增长率为 53.59%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在

虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧上证科创板综合指数量化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	10,671,456.12	28,418,571.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	169,178,069.69	316,633,521.72
其中：股票投资		169,178,069.69	316,633,521.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		877,366.48	1,629,253.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		180,726,892.29	346,681,346.51
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		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		499,247.07	3,672,801.94
应付管理人报酬		119,297.73	236,316.04
应付托管费		22,368.34	44,309.29
应付销售服务费		20,679.61	40,541.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	69,658.12	18,026.16
负债合计		731,250.87	4,011,994.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	114,690,016.80	335,828,916.52
未分配利润	6.4.7.8	65,305,624.62	6,840,435.31
净资产合计		179,995,641.42	342,669,351.83
负债和净资产总计		180,726,892.29	346,681,346.51

注： 1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 114,690,016.80 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.5712 元，基金份额总额 76,136,890.20 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.5659 元，基金份额总额 38,553,126.60 份。

2. 本基金基金合同于 2025 年 09 月 01 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧上证科创板综合指数数量化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
一、营业总收入		101,008,012.95
1. 利息收入		5,329.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,329.94
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）		83,898,991.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	83,618,278.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	280,712.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	17,001,876.76
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	101,814.87
减：二、营业总支出		1,404,020.04
1. 管理人报酬		973,644.21
2. 托管费		182,558.31
3. 销售服务费		163,549.65
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	84,267.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		99,603,992.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		99,603,992.91
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		99,603,992.91

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧上证科创板综合指数量化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	335,828,916.52	-	6,840,435.31	342,669,351.83
二、本期期初净资产	335,828,916.52	-	6,840,435.31	342,669,351.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-221,138,899.72	-	58,465,189.31	-162,673,710.41
（一）、综合收益总额	-	-	99,603,992.91	99,603,992.91
（二）、本期基金	-221,138,899.7	-	-41,138,803.60	-262,277,703.32

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	2			
其中：1. 基金申 购款	203,681,268.53	-	41,887,418.43	245,568,686.96
2. 基金赎 回款	-424,820,168.25	-	-83,026,222.03	-507,846,390.28
(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	114,690,016.80	-	65,305,624.62	179,995,641.42

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
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

中欧上证科创板综合指数量化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[2025]1355号《关于准予中欧上证科创板综合指数量化增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧上证科创板综合指数量化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356,827,799.59元，经向中国证监会备案，《中欧上证科创板综合指数量化增强型证券投资基金基金合同》于2025年9月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为356,875,148.82份基金份额，其中包含认购资金利息折合47,349.23份基金份额。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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和其他相

关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财税[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》、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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入

增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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. 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，暂不计缴企业所得税。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	29,987.02
等于：本金	29,985.00
加：应计利息	2.02
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	10,641,469.10
等于：本金	10,641,308.22
加：应计利息	160.88
减：坏账准备	—
合计	10,671,456.12

注：其他存款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		148,312,253.90	—	169,178,069.69	20,865,815.79
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		148,312,253.90	—	169,178,069.69	20,865,815.79

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	58.44
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
预提费用-审计费	8,926.92
其他应付	1,165.39
合计	69,658.12

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧上证科创板综合指数量化增强 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	222,431,791.63	222,431,791.63
本期申购	139,170,595.95	139,170,595.95
本期赎回（以“-”号填列）	-285,465,497.38	-285,465,497.38
本期末	76,136,890.20	76,136,890.20

中欧上证科创板综合指数量化增强 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	113,397,124.89	113,397,124.89
本期申购	64,510,672.58	64,510,672.58
本期赎回（以“-”号填列）	-139,354,670.87	-139,354,670.87
本期末	38,553,126.60	38,553,126.60

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

中欧上证科创板综合指数量化增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2, 118, 194. 70	2, 514, 383. 73	4, 632, 578. 43
本期期初	2, 118, 194. 70	2, 514, 383. 73	4, 632, 578. 43
本期利润	54, 185, 468. 51	12, 085, 141. 43	66, 270, 609. 94
本期基金份额交易产生的变动数	-20, 081, 957. 37	-7, 334, 071. 85	-27, 416, 029. 22
其中：基金申购款	25, 198, 366. 08	3, 093, 643. 32	28, 292, 009. 40
基金赎回款	-45, 280, 323. 45	-10, 427, 715. 17	-55, 708, 038. 62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36, 221, 705. 84	7, 265, 453. 31	43, 487, 159. 15

中欧上证科创板综合指数量化增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	928, 300. 62	1, 279, 556. 26	2, 207, 856. 88
本期期初	928, 300. 62	1, 279, 556. 26	2, 207, 856. 88
本期利润	28, 416, 647. 64	4, 916, 735. 33	33, 333, 382. 97
本期基金份额交易产生的变动数	-11, 193, 092. 63	-2, 529, 681. 75	-13, 722, 774. 38
其中：基金申购款	12, 136, 534. 49	1, 458, 874. 54	13, 595, 409. 03
基金赎回款	-23, 329, 627. 12	-3, 988, 556. 29	-27, 318, 183. 41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18, 151, 855. 63	3, 666, 609. 84	21, 818, 465. 47

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	973. 52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4, 356. 42
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5, 329. 94

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	1, 876, 462, 336. 38
减：卖出股票成本总额	1, 791, 032, 546. 51
减：交易费用	1, 811, 511. 18
买卖股票差价收入	83, 618, 278. 69

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	280,712.69
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	280,712.69

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	17,001,876.76
股票投资	17,001,876.76
债券投资	-
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	17,001,876.76
----	---------------

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	101,679.85
基金转换费收入	135.02
合计	101,814.87

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	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,833.26
账户维护费	9,000.00
存托服务费	0.32
合计	84,267.87

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	973,644.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	435,153.73
应支付基金管理人的净管理费	538,490.48

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.80% / 当年天数。

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
当期发生的基金应支付的托管费	182,558.31

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.15% / 当年天数。

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		
	中欧上证科创板综合 指数量化增强 A	中欧上证科创板综合 指数量化增强 C	合计
招商银行股份有限公司	-	131,191.29	131,191.29
中欧财富	-	693.92	693.92
合计	-	131,885.21	131,885.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	29,987.02	973.52

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（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
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	280	3,130.40	4,925.20	-
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	47	1,574.03	1,594.71	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集	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	-

	团									
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	93	1,465.68	4,344.03	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	172	3,044.40	14,503.04	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	1,233	21,602.16	44,289.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	22.68	47.61	515	11,680.20	24,519.15	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	92.18	463.15	80	7,374.40	37,052.00	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	44.56	468.67	75	3,342.00	35,150.25	-
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	63	5,158.44	99,812.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	6.41	24.13	803	5,147.23	19,376.39	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.09	198	5,203.44	34,073.82	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	55.95	57.10	124	6,937.80	7,080.40	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	9.47	70.14	886	8,390.42	62,144.04	-
688820	盛合	2026 年 4 月	6 个月	新股 流通	19.68	141.49	373	7,340.64	52,775.77	-

	晶 微	13 日		受限						
--	--------	------	--	----	--	--	--	--	--	--

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 7 月 13 日	890.99	2,587	1,618,184.54	2,275,344.11	-

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 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指

导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制 在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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	10,671,456.12	-	-	-	10,671,456.12
交易性金融资产	-	-	-	169,178,069.69	169,178,069.69
应收申购款	-	-	-	877,366.48	877,366.48

资产总计	10,671,456.12	-	-	-170,055,436.17	180,726,892.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	499,247.07	499,247.07
应付管理人报酬	-	-	-	119,297.73	119,297.73
应付托管费	-	-	-	22,368.34	22,368.34
应付销售服务费	-	-	-	20,679.61	20,679.61
其他负债	-	-	-	69,658.12	69,658.12
负债总计	-	-	-	731,250.87	731,250.87
利率敏感度缺口	10,671,456.12	-	-	-169,324,185.30	179,995,641.42
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	28,418,571.58	-	-	-	28,418,571.58
交易性金融资产	-	-	-	-316,633,521.72	316,633,521.72
应收申购款	-	-	-	1,629,253.21	1,629,253.21
资产总计	28,418,571.58	-	-	-318,262,774.93	346,681,346.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,672,801.94	3,672,801.94
应付管理人报酬	-	-	-	236,316.04	236,316.04
应付托管费	-	-	-	44,309.29	44,309.29
应付销售服务费	-	-	-	40,541.25	40,541.25
其他负债	-	-	-	18,026.16	18,026.16
负债总计	-	-	-	4,011,994.68	4,011,994.68
利率敏感度缺口	28,418,571.58	-	-	-314,250,780.25	342,669,351.83

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 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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	169,178,069.69	93.99	316,633,521.72	92.40
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	169,178,069.69	93.99	316,633,521.72	92.40

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%	9,341,355.09	8,501,456.94
	业绩比较基准下降 5%	-9,341,355.09	-8,501,456.94

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	166,446,558.35	309,092,779.83
第二层次	2,275,344.11	7,173,452.80
第三层次	456,167.23	367,289.09
合计	169,178,069.69	316,633,521.72

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	169,178,069.69	93.61
	其中：股票	169,178,069.69	93.61
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	10,671,456.12	5.90
8	其他各项资产	877,366.48	0.49
9	合计	180,726,892.29	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	113,708,345.09	63.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,126,166.66	14.51
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	2,389,161.79	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	1,028,061.24	0.57
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	143, 251, 734. 78	79. 59

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	462, 756. 00	0. 26
C	制造业	17, 564, 856. 51	9. 76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8, 652. 00	0. 00
E	建筑业	842, 269. 00	0. 47
F	批发和零售业	2, 655, 162. 00	1. 48
G	交通运输、仓储和邮政业	561, 410. 00	0. 31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	236, 952. 00	0. 13
J	金融业	3, 141, 424. 00	1. 75
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18, 405. 40	0. 01
O	居民服务、修理和其他服务业	297, 600. 00	0. 17
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	123, 416. 00	0. 07
S	综合	13, 432. 00	0. 01
	合计	25, 926, 334. 91	14. 40

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	688256	寒武纪	7,003	11,173,636.65	6.21
2	688041	海光信息	28,076	10,396,542.80	5.78
3	688012	中微公司	9,285	4,350,022.50	2.42
4	688981	中芯国际	23,824	3,783,727.68	2.10
5	688008	澜起科技	12,147	3,764,355.30	2.09
6	688498	源杰科技	1,802	3,398,572.00	1.89
7	688582	芯动联科	50,882	3,307,330.00	1.84
8	688668	鼎通科技	8,766	3,272,347.80	1.82
9	688469	芯联集成	235,257	2,496,076.77	1.39
10	688629	华丰科技	13,271	2,488,445.21	1.38
11	688072	拓荆科技	2,587	2,275,344.11	1.26
12	688521	芯原股份	6,113	2,268,778.82	1.26
13	688249	晶合集成	37,484	2,212,680.52	1.23
14	688183	生益电子	16,360	2,166,064.00	1.20
15	688120	华海清科	6,669	2,148,618.42	1.19
16	688167	炬光科技	5,979	2,117,821.59	1.18
17	688396	华润微	21,526	2,099,861.30	1.17
18	688766	普冉股份	2,655	2,035,323.00	1.13
19	688331	荣昌生物	14,122	1,839,531.72	1.02
20	688266	泽璟制药	14,175	1,653,655.50	0.92
21	688368	晶丰明源	7,354	1,592,288.08	0.88
22	688433	华曙高科	18,440	1,578,464.00	0.88
23	688110	东芯股份	7,464	1,520,416.80	0.84
24	688367	工大高科	43,757	1,457,108.10	0.81
25	688065	凯赛生物	29,304	1,402,196.40	0.78
26	688322	奥比中光	9,982	1,303,150.10	0.72
27	688525	佰维存储	2,628	1,300,150.44	0.72
28	688329	艾隆科技	64,174	1,296,956.54	0.72
29	688800	瑞可达	12,962	1,243,963.14	0.69
30	688248	南网科技	17,592	1,217,014.56	0.68
31	688718	唯赛勃	76,129	1,215,780.13	0.68
32	688382	益方生物	66,133	1,190,394.00	0.66
33	688758	赛分科技	53,292	1,172,956.92	0.65
34	688025	杰普特	2,465	1,158,550.00	0.64
35	688539	高华科技	36,225	1,154,853.00	0.64
36	688343	云天励飞	13,956	1,139,646.96	0.63
37	688035	德邦科技	12,163	1,116,563.40	0.62
38	688082	盛美上海	2,536	1,095,552.00	0.61
39	688141	杰华特	7,108	1,091,078.00	0.61
40	688578	艾力斯	9,923	1,083,591.60	0.60
41	688772	珠海冠宇	52,989	1,040,174.07	0.58
42	688234	天岳先进	5,960	1,034,119.60	0.57
43	688180	君实生物	29,968	1,013,517.76	0.56

44	688617	惠泰医疗	5,460	991,317.60	0.55
45	688361	中科飞测	2,237	961,910.00	0.53
46	688273	麦澜德	24,809	961,100.66	0.53
47	688182	灿勤科技	22,250	958,307.50	0.53
48	688002	睿创微纳	5,962	922,261.78	0.51
49	688187	时代电气	13,013	893,472.58	0.50
50	688585	上纬新材	5,377	891,506.60	0.50
51	688253	英诺特	14,263	859,773.64	0.48
52	688701	卓锦股份	113,254	852,802.62	0.47
53	688202	美迪西	10,509	848,181.39	0.47
54	688677	海泰新光	8,379	847,368.27	0.47
55	688047	龙芯中科	5,386	833,052.62	0.46
56	688702	盛科通信	2,103	820,148.97	0.46
57	688220	翱捷科技	6,254	777,497.28	0.43
58	688478	晶升股份	8,727	772,775.85	0.43
59	688728	格科微	36,425	766,382.00	0.43
60	688061	灿瑞科技	15,293	759,603.31	0.42
61	688449	联芸科技	8,672	748,480.32	0.42
62	688479	友车科技	19,129	726,328.13	0.40
63	688793	倍轻松	44,916	723,596.76	0.40
64	688038	中科通达	41,920	705,094.40	0.39
65	688428	诺诚健华	24,500	697,515.00	0.39
66	688052	纳芯微	2,359	680,123.29	0.38
67	688077	大地熊	24,308	643,918.92	0.36
68	688335	复洁科技	26,531	637,805.24	0.35
69	688652	京仪装备	3,184	637,341.28	0.35
70	688388	嘉元科技	14,261	627,484.00	0.35
71	688146	中船特气	1,745	610,732.55	0.34
72	688261	东微半导	5,814	610,063.02	0.34
73	688775	影石创新	4,341	601,879.65	0.33
74	688306	均普智能	58,411	589,951.10	0.33
75	688172	燕东微	6,549	547,889.34	0.30
76	688676	金盘科技	6,467	547,366.88	0.30
77	688310	迈得医疗	34,793	534,768.41	0.30
78	688536	思瑞浦	1,468	534,484.12	0.30
79	688021	奥福科技	27,522	532,825.92	0.30
80	688693	楷威特	4,696	488,149.20	0.27
81	688599	天合光能	34,510	487,281.20	0.27
82	688345	博力威	8,263	479,915.04	0.27
83	688717	艾罗能源	5,712	471,639.84	0.26
84	688099	晶晨股份	4,481	461,094.90	0.26
85	688411	海博思创	1,570	457,184.00	0.25
86	688429	时创能源	44,303	451,447.57	0.25

87	688380	中微半导	6,827	449,967.57	0.25
88	688484	南芯科技	7,907	446,666.43	0.25
89	688213	思特威	4,124	441,556.68	0.25
90	688235	百济神州	1,600	407,376.00	0.23
91	688153	唯捷创芯	12,313	395,493.56	0.22
92	688416	恒烁股份	2,821	394,940.00	0.22
93	688001	华兴源创	4,217	361,396.90	0.20
94	688325	赛微微电	2,729	355,888.89	0.20
95	688262	国芯科技	7,972	344,629.56	0.19
96	688347	华虹宏力	1,022	343,698.60	0.19
97	688353	华盛锂电	2,892	335,674.44	0.19
98	688528	秦川物联	35,970	328,765.80	0.18
99	688777	中控技术	2,781	326,767.50	0.18
100	688030	山石网科	20,529	324,152.91	0.18
101	688506	百利天恒	1,070	314,612.10	0.17
102	688195	腾景科技	1,626	313,135.08	0.17
103	688237	超卓航科	5,768	308,126.56	0.17
104	688200	华峰测控	583	306,133.30	0.17
105	688236	春立医疗	21,065	304,599.90	0.17
106	688516	奥特维	5,087	291,942.93	0.16
107	688560	明冠新材	23,608	279,754.80	0.16
108	688197	首药控股	8,029	268,248.89	0.15
109	688332	中科蓝讯	1,634	257,355.00	0.14
110	688020	方邦股份	1,019	254,342.40	0.14
111	688709	成都华微	6,609	251,736.81	0.14
112	688598	金博股份	4,786	236,667.70	0.13
113	688009	中国通号	49,503	235,634.28	0.13
114	688017	绿的谐波	550	229,823.00	0.13
115	688223	晶科能源	46,051	218,742.25	0.12
116	688118	普元信息	10,410	209,449.20	0.12
117	688093	世华科技	5,570	205,533.00	0.11
118	688036	传音控股	3,456	203,731.20	0.11
119	688517	金冠电气	11,577	202,365.96	0.11
120	688369	致远互联	9,486	199,300.86	0.11
121	688662	富信科技	1,121	188,328.00	0.10
122	688007	光峰科技	14,073	187,170.90	0.10
123	688004	博汇科技	10,177	185,221.40	0.10
124	688058	宝兰德	8,575	179,389.00	0.10
125	688131	皓元医药	1,880	177,848.00	0.10
126	688420	美腾科技	8,310	175,091.70	0.10
127	688277	天智航	9,468	161,902.80	0.09
128	688776	国光电气	2,627	161,140.18	0.09
129	688403	汇成股份	3,967	157,489.90	0.09

130	688583	思看科技	1,743	149,497.11	0.08
131	688681	科汇股份	10,170	142,176.60	0.08
132	688102	斯瑞新材	2,961	139,699.98	0.08
133	688472	阿特斯	12,529	135,563.78	0.08
134	688127	蓝特光学	1,328	129,612.80	0.07
135	688680	海优新材	3,062	128,604.00	0.07
136	688432	有研硅	3,121	124,746.37	0.07
137	688107	安路科技	2,658	121,204.80	0.07
138	688670	金迪克	7,112	120,477.28	0.07
139	688799	华纳药厂	2,642	118,546.54	0.07
140	688819	天能股份	5,290	117,438.00	0.07
141	688151	华强科技	7,427	110,439.49	0.06
142	688408	中信博	3,281	105,484.15	0.06
143	688579	地纬智能	13,860	105,197.40	0.06
144	688318	财富趋势	1,312	93,558.72	0.05
145	688069	德林海	2,426	90,635.36	0.05
146	688620	安凯微	5,583	90,444.60	0.05
147	688659	元琛科技	8,557	89,335.08	0.05
148	688683	莱尔科技	2,346	88,960.32	0.05
149	688768	容知日新	1,718	88,545.72	0.05
150	688301	奕瑞科技	695	86,180.00	0.05
151	688485	九州一轨	1,321	84,623.26	0.05
152	688597	煜邦电力	12,908	83,902.00	0.05
153	688288	鸿泉技术	4,511	80,160.47	0.04
154	688486	龙迅股份	1,250	79,475.00	0.04
155	688591	泰凌微	2,190	75,292.20	0.04
156	688757	胜科纳米	1,099	73,303.30	0.04
157	688290	景业智能	1,050	69,678.00	0.04
158	688695	中创股份	3,570	66,759.00	0.04
159	688508	芯朋微	621	57,728.16	0.03
160	688006	杭可科技	1,351	49,379.05	0.03
161	688303	大全能源	2,696	46,991.28	0.03
162	688455	科捷智能	2,306	43,029.96	0.02
163	688281	华秦科技	800	40,184.00	0.02
164	688238	和元生物	6,785	36,774.70	0.02
165	688628	优利德	338	33,441.72	0.02
166	688510	航亚科技	1,400	33,432.00	0.02
167	688285	高铁电气	3,945	28,285.65	0.02
168	688085	三友医疗	2,359	28,237.23	0.02
169	688586	江航装备	2,287	26,735.03	0.01
170	688395	正弦电气	1,165	25,746.50	0.01
171	688373	盟科药业	5,155	23,352.15	0.01
172	688026	洁特生物	1,408	22,119.68	0.01

173	688216	气派科技	524	22,013.24	0.01
174	688315	诺禾致源	1,554	19,440.54	0.01
175	688529	豪森智能	1,137	17,885.01	0.01
176	688559	海目星	200	16,784.00	0.01
177	688548	广钢气体	200	10,420.00	0.01
178	688488	艾迪药业	760	9,766.00	0.01
179	688105	诺唯赞	558	9,681.30	0.01
180	688573	信宇人	520	9,214.40	0.01
181	688119	中钢洛耐	1,549	7,357.75	0.00
182	688357	建龙微纳	249	7,338.03	0.00
183	688657	浩辰软件	200	7,154.00	0.00
184	688289	圣湘生物	485	6,984.00	0.00
185	688265	南模生物	200	6,918.00	0.00
186	688251	井松智能	256	6,561.28	0.00
187	688276	百克生物	458	6,384.52	0.00
188	688358	祥生医疗	200	6,114.00	0.00
189	688522	纳睿雷达	302	6,046.04	0.00
190	688612	威迈斯	200	5,918.00	0.00
191	688212	澳华内镜	200	5,880.00	0.00
192	688737	中自科技	271	5,186.94	0.00
193	688282	理工导航	85	4,947.00	0.00
194	688013	天臣医疗	200	4,934.00	0.00
195	688658	悦康药业	330	4,243.80	0.00
196	688355	明志科技	200	3,850.00	0.00
197	688501	DR 青达环	200	3,840.00	0.00
198	688176	亚虹医药	381	3,779.52	0.00
199	688015	交控科技	200	3,076.00	0.00
200	688590	新致软件	200	2,486.00	0.00
201	688192	迪哲医药	43	1,716.99	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	300475	香农芯创	3,900	1,170,000.00	0.65
2	002913	奥士康	17,200	1,099,768.00	0.61
3	300408	三环集团	6,400	1,068,160.00	0.59
4	002885	京泉华	22,700	927,522.00	0.52
5	600183	生益科技	4,900	849,660.00	0.47
6	000032	深桑达 A	33,500	835,825.00	0.46
7	301099	雅创电子	8,500	811,750.00	0.45
8	600353	旭光电子	17,600	802,560.00	0.45
9	600030	中信证券	25,600	735,488.00	0.41
10	000657	中钨高新	7,600	727,472.00	0.40
11	601688	华泰证券	35,000	721,700.00	0.40

12	301123	奕东电子	5,900	712,248.00	0.40
13	301176	逸豪新材	10,400	707,200.00	0.39
14	600999	招商证券	32,000	675,200.00	0.38
15	600498	烽火通信	9,000	662,400.00	0.37
16	002028	思源电气	3,800	657,400.00	0.37
17	300939	秋田微	9,400	650,480.00	0.36
18	301177	迪阿股份	21,900	603,783.00	0.34
19	300843	胜蓝股份	3,700	578,125.00	0.32
20	300033	同花顺	2,100	506,100.00	0.28
21	001696	宗申动力	23,300	484,873.00	0.27
22	600703	三安光电	22,800	483,816.00	0.27
23	301536	星宸科技	3,600	463,356.00	0.26
24	601666	平煤股份	62,400	446,160.00	0.25
25	002931	锋龙股份	6,000	413,880.00	0.23
26	601872	招商轮船	23,000	404,110.00	0.22
27	300077	国民技术	11,900	373,065.00	0.21
28	002824	和胜股份	9,800	338,884.00	0.19
29	600714	金瑞矿业	16,500	338,745.00	0.19
30	301377	鼎泰高科	600	330,540.00	0.18
31	002916	深南电路	700	320,530.00	0.18
32	002655	共达电声	6,500	299,000.00	0.17
33	300736	百邦科技	9,600	297,600.00	0.17
34	000811	冰轮环境	5,000	281,100.00	0.16
35	002993	奥海科技	3,900	279,279.00	0.16
36	301312	智立方	2,400	278,424.00	0.15
37	300458	全志科技	6,300	248,598.00	0.14
38	601658	邮储银行	49,900	246,007.00	0.14
39	002064	华峰化学	24,000	227,760.00	0.13
40	300017	网宿科技	15,600	202,956.00	0.11
41	300726	宏达电子	2,300	194,511.00	0.11
42	603738	泰晶科技	2,900	174,145.00	0.10
43	300120	经纬辉开	15,200	172,216.00	0.10
44	301205	联特科技	500	167,050.00	0.09
45	601111	中国国航	26,000	157,300.00	0.09
46	601066	中信建投	5,300	154,071.00	0.09
47	000070	特发信息	7,200	150,048.00	0.08
48	600563	法拉电子	700	133,560.00	0.07
49	300136	信维通信	1,100	131,175.00	0.07
50	603999	读者传媒	23,800	119,000.00	0.07
51	300655	晶瑞电材	5,400	115,668.00	0.06
52	300606	金太阳	2,600	110,656.00	0.06
53	300857	协创数据	300	101,970.00	0.06
54	688808	联讯仪器	63	99,812.79	0.06

55	003042	中农联合	7,300	88,695.00	0.05
56	301189	奥尼电子	1,300	76,609.00	0.04
57	300570	太辰光	300	74,013.00	0.04
58	000776	广发证券	3,100	72,540.00	0.04
59	001287	中电港	2,100	65,415.00	0.04
60	688818	电科蓝天	886	62,144.04	0.03
61	301028	鼎熔岩	3,700	59,052.00	0.03
62	300014	亿纬锂能	900	58,527.00	0.03
63	688820	盛合晶微	373	52,775.77	0.03
64	300623	捷捷微电	1,000	44,990.00	0.02
65	688712	北芯生命	1,233	44,289.36	0.02
66	605218	伟时电子	2,600	42,978.00	0.02
67	300814	中富电路	200	40,900.00	0.02
68	600362	江西铜业	900	38,970.00	0.02
69	002057	中钢天源	3,100	38,533.00	0.02
70	688785	恒运昌	80	37,052.00	0.02
71	688797	臻宝科技	75	35,150.25	0.02
72	300870	欧陆通	100	34,569.00	0.02
73	688813	泰金新能	198	34,073.82	0.02
74	603920	世运电路	700	33,628.00	0.02
75	603697	有友食品	3,100	29,729.00	0.02
76	002897	意华股份	300	26,394.00	0.01
77	000425	徐工机械	3,200	25,888.00	0.01
78	688781	视涯科技	515	24,519.15	0.01
79	002491	通鼎互联	600	19,440.00	0.01
80	688811	有研复材	803	19,376.39	0.01
81	300059	东方财富	800	16,304.00	0.01
82	002716	湖南白银	1,800	14,562.00	0.01
83	603459	红板科技	172	14,503.04	0.01
84	002903	宇环数控	300	13,626.00	0.01
85	600673	东阳光	400	13,432.00	0.01
86	001360	南矿集团	600	10,614.00	0.01
87	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
88	002407	多氟多	200	10,046.00	0.01
89	603663	三祥新材	100	9,630.00	0.01
90	002179	中航光电	200	9,240.00	0.01
91	301382	蜂助手	200	9,200.00	0.01
92	603519	立霸股份	600	9,180.00	0.01
93	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.01
94	301321	翰博高新	200	8,830.00	0.00
95	000938	紫光股份	300	8,658.00	0.00
96	600121	郑州煤电	2,300	8,234.00	0.00
97	002084	海鸥住工	2,300	8,004.00	0.00

98	300798	锦鸡股份	1,200	7,836.00	0.00
99	300499	高澜股份	200	7,740.00	0.00
100	300128	锦富技术	1,300	7,696.00	0.00
101	001217	华尔泰	900	7,587.00	0.00
102	300721	怡达股份	200	7,530.00	0.00
103	603177	德创环保	900	7,443.00	0.00
104	603915	国茂股份	500	7,095.00	0.00
105	301413	安培龙	100	7,088.00	0.00
106	688816	易思维	124	7,080.40	0.00
107	601628	中国人寿	200	7,070.00	0.00
108	002648	卫星化学	300	7,047.00	0.00
109	601229	上海银行	800	6,944.00	0.00
110	002929	润建股份	100	6,688.00	0.00
111	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.00
112	600761	安徽合力	400	6,544.00	0.00
113	300878	维康药业	200	6,466.00	0.00
114	002062	宏润建设	900	6,444.00	0.00
115	002151	北斗星通	200	6,350.00	0.00
116	000967	盈峰环境	600	6,318.00	0.00
117	601106	中国一重	1,900	6,270.00	0.00
118	002733	雄韬股份	200	6,196.00	0.00
119	300987	川网传媒	500	6,150.00	0.00
120	300206	理邦仪器	500	6,115.00	0.00
121	300444	双杰电气	500	6,105.00	0.00
122	603533	掌阅科技	300	6,087.00	0.00
123	002243	力合科创	900	5,913.00	0.00
124	300634	彩讯股份	300	5,871.00	0.00
125	600742	富维股份	800	5,792.00	0.00
126	001313	粤海饲料	800	5,672.00	0.00
127	600732	爱旭股份	400	5,540.00	0.00
128	000692	惠天热电	1,400	5,516.00	0.00
129	600847	万里股份	400	5,396.00	0.00
130	603980	吉华集团	800	5,312.00	0.00
131	300259	新天科技	800	5,304.00	0.00
132	300929	华骐环保	500	5,270.00	0.00
133	601918	新集能源	600	5,154.00	0.00
134	603116	红蜻蜓	900	5,112.00	0.00
135	601112	振石股份	280	4,925.20	0.00
136	301212	联盛化学	200	4,670.00	0.00
137	601999	出版传媒	800	4,416.00	0.00
138	603435	嘉德利	93	4,344.03	0.00
139	002640	跨境通	1,400	4,214.00	0.00
140	300283	温州宏丰	200	4,110.00	0.00

141	300006	莱美药业	800	4,104.00	0.00
142	300432	富临精工	200	4,018.00	0.00
143	603070	万控智造	300	3,774.00	0.00
144	002266	浙富控股	700	3,542.00	0.00
145	605177	东亚药业	200	3,422.00	0.00
146	002415	海康威视	100	3,420.00	0.00
147	603897	长城科技	100	3,246.00	0.00
148	600925	苏能股份	800	3,208.00	0.00
149	000966	长源电力	800	3,136.00	0.00
150	001260	坤泰股份	200	3,130.00	0.00
151	002079	苏州固锝	200	3,006.00	0.00
152	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
153	002125	湘潭电化	200	2,732.00	0.00
154	300490	华自科技	200	2,646.00	0.00
155	001230	劲旅环境	140	2,150.40	0.00
156	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
157	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
158	603293	埃泰克	47	1,594.71	0.00
159	002559	亚威股份	100	1,271.00	0.00
160	300839	博汇股份	100	1,171.00	0.00
161	601609	金田股份	100	1,080.00	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	688498	源杰科技	18,114,279.10	5.29
2	688072	拓荆科技	17,914,867.72	5.23
3	688702	盛科通信	13,837,583.98	4.04
4	688525	佰维存储	13,006,374.15	3.80
5	688347	华虹宏力	12,730,723.62	3.72
6	688668	鼎通科技	12,636,916.27	3.69
7	688766	普冉股份	11,586,206.86	3.38
8	688048	长光华芯	11,261,736.95	3.29
9	688172	燕东微	10,959,580.63	3.20
10	688234	天岳先进	10,452,327.25	3.05
11	688183	生益电子	10,268,227.74	3.00
12	688331	荣昌生物	9,962,974.66	2.91
13	688167	炬光科技	9,914,420.80	2.89
14	688270	ST 臻镭	9,815,229.57	2.86
15	688361	中科飞测	9,537,325.61	2.78
16	688629	华丰科技	9,332,210.40	2.72
17	688008	澜起科技	8,743,488.97	2.55
18	688200	华峰测控	8,738,691.45	2.55

19	688390	固德威	8,462,100.40	2.47
20	688506	百利天恒	8,117,206.27	2.37
21	688516	奥特维	8,076,522.25	2.36
22	688627	精智达	7,724,527.95	2.25
23	688717	艾罗能源	7,703,009.70	2.25
24	688777	中控技术	7,678,044.08	2.24
25	688037	芯源微	7,594,175.78	2.22
26	688409	富创精密	7,486,722.92	2.18
27	688313	仕佳光子	7,460,071.59	2.18
28	688001	华兴源创	7,448,887.75	2.17
29	688568	中科星图	7,123,506.33	2.08
30	688141	杰华特	7,121,854.39	2.08
31	688652	京仪装备	7,048,963.47	2.06
32	688047	龙芯中科	7,037,605.45	2.05
33	688012	中微公司	6,979,737.02	2.04
34	688585	上纬新材	6,855,687.37	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688256	寒武纪	24,090,193.09	7.03
2	688072	拓荆科技	21,450,036.24	6.26
3	688041	海光信息	19,375,784.06	5.65
4	688498	源杰科技	18,069,033.36	5.27
5	688702	盛科通信	16,691,591.81	4.87
6	688525	佰维存储	14,046,736.96	4.10
7	688008	澜起科技	14,040,657.78	4.10
8	688347	华虹宏力	14,034,068.64	4.10
9	688012	中微公司	13,936,866.50	4.07
10	688172	燕东微	13,136,553.91	3.83
11	688048	长光华芯	12,592,999.86	3.67
12	688183	生益电子	12,234,225.37	3.57
13	688766	普冉股份	11,515,917.92	3.36
14	688234	天岳先进	11,263,071.44	3.29
15	688668	鼎通科技	10,383,145.87	3.03
16	688390	固德威	10,175,798.18	2.97
17	688981	中芯国际	10,135,364.87	2.96
18	688375	国博电子	10,126,379.68	2.96
19	688270	ST 臻镭	10,080,155.67	2.94
20	688313	仕佳光子	10,076,122.47	2.94
21	688361	中科飞测	9,517,921.76	2.78
22	688331	荣昌生物	9,516,079.84	2.78
23	688200	华峰测控	9,301,226.83	2.71

24	688141	杰华特	9,143,837.20	2.67
25	688126	沪硅产业	9,101,635.03	2.66
26	688629	华丰科技	9,050,327.44	2.64
27	688223	晶科能源	8,919,533.29	2.60
28	688001	华兴源创	8,913,034.55	2.60
29	688506	百利天恒	8,734,802.28	2.55
30	688336	三生国健	8,592,405.75	2.51
31	688409	富创精密	8,327,186.74	2.43
32	688047	龙芯中科	8,297,675.24	2.42
33	688167	炬光科技	8,201,884.87	2.39
34	688521	芯原股份	8,181,117.92	2.39
35	688387	信科移动	8,014,336.34	2.34
36	688519	南亚新材	7,976,116.10	2.33
37	688627	精智达	7,965,044.07	2.32
38	688372	伟测科技	7,943,760.16	2.32
39	688568	中科星图	7,598,617.99	2.22
40	688303	大全能源	7,589,749.85	2.21
41	688220	翱捷科技	7,584,895.97	2.21
42	688777	中控技术	7,530,584.46	2.20
43	688205	德科立	7,379,466.61	2.15
44	688082	盛美上海	7,355,993.07	2.15
45	688717	艾罗能源	7,295,059.64	2.13
46	688123	聚辰股份	7,288,297.31	2.13
47	688037	芯源微	7,275,591.99	2.12
48	688726	拉普拉斯	7,243,238.08	2.11
49	688516	奥特维	7,199,987.18	2.10
50	688147	微导纳米	7,190,483.38	2.10
51	688343	云天励飞	7,179,670.74	2.10
52	688661	和林微纳	7,169,797.61	2.09
53	688396	华润微	7,142,047.76	2.08
54	688585	上纬新材	7,083,536.40	2.07
55	688536	思瑞浦	6,898,589.01	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	1,626,575,217.72
卖出股票收入（成交）总额	1,876,462,336.38

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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投资国债期货。

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	877,366.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	—
9	合计	877,366.48

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧上证 科创板综 合指数量 化增强 A	1,274	59,762.08	2,321,860.22	3.05%	73,815,029.98	96.95%
中欧上证 科创板综 合指数量 化增强 C	819	47,073.41	500,000.00	1.30%	38,053,126.60	98.70%
合计	2,093	54,796.95	2,821,860.22	2.46%	111,868,156.58	97.54%

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	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	0.00	0.00%
	中欧上证科创板综合指数量化增强 C	0.00	0.00%

	合计	0.00	0.00%
--	----	------	-------

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	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	0
	中欧上证科创板综合指数量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	0
	中欧上证科创板综合指数量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧上证科创板综合指数量化增强 A	中欧上证科创板综合指数量化增强 C
基金合同生效日 （2025 年 9 月 1 日） 基金份额总额	234,307,140.53	122,568,008.29
本报告期期初基金份额总额	222,431,791.63	113,397,124.89
本报告期基金总申购份额	139,170,595.95	64,510,672.58
减：本报告期基金总赎回份额	285,465,497.38	139,354,670.87
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	76,136,890.20	38,553,126.60

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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(%)	
东莞证券	3	3,502,296,408.23	100.00	648,765.30	100.00	-

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(%)
东莞证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧上证科创板综合指数量化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
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
4	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
5	中欧上证科创板综合指数量化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
6	中欧上证科创板综合指数量化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
7	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
8	中欧上证科创板综合指数量化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
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

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