

中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 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	79
8.7 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	79
8.8 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	79
8.9 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	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§ 9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 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	81
§ 10 开放式基金份额变动	81
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧中证 1000 指数增强	
基金主代码	017919	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	368,755,941.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017919	017920
报告期末下属分级基金的份额总额	161,455,817.79 份	207,300,124.12 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，以中证 1000 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用公司量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。以争取实现指数增强型的目标。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	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 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中欧基金管理有限公司		招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	韩鑫普
	联系电话	021-68609600	0755-82943666
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95565
传真		021-50190017	0755-82960794
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		200120	518000
法定代表人		窦玉明	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年 3 月 2 日-2023 年 12 月 31 日	
	中欧中证 1000 指数增 强 A	中欧中证 1000 指数增 强 C	中欧中证 1000 指数增 强 A	中欧中证 1000 指数增 强 C	中欧中证 1000 指数增 强 A	中欧中证 1000 指数增 强 C
本期已实现 收益	66,320,922 .13	61,010,522 .03	43,128,635 .43	28,779,979 .98	-25,527,45 6.42	-22,680,43 6.67
本期利润	83,147,599 .67	68,381,224 .95	16,335,779 .36	42,355,127 .73	-38,654,39 0.37	-19,134,40 1.81
加权平均基 金份额本期 利润	0.3374	0.3259	0.0335	0.0710	-0.0568	-0.0370
本期加权平	31.17%	29.56%	3.88%	8.41%	-5.87%	-3.86%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	34.26%	33.47%	5.52%	4.88%	-6.90%	-7.36%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	51,507,338.22	61,528,748.61	-8,678,655.22	-7,115,733.07	-38,482,245.50	-49,191,932.96
期末可供分配基金份额利润	0.3190	0.2968	-0.0176	-0.0284	-0.0690	-0.0736
期末基金资产净值	212,963,156.01	268,828,872.73	484,343,641.05	243,658,245.61	519,622,813.64	619,256,094.21
期末基金份额净值	1.3190	1.2968	0.9824	0.9716	0.9310	0.9264
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	31.90%	29.68%	-1.76%	-2.84%	-6.90%	-7.36%

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 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.02%	1.10%	0.28%	1.07%	2.74%	0.03%
过去六个月	24.47%	1.06%	18.49%	1.06%	5.98%	0.00%
过去一年	34.26%	1.27%	26.12%	1.32%	8.14%	-0.05%
自基金合同生效	31.90%	1.44%	8.53%	1.51%	23.37%	-0.07%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

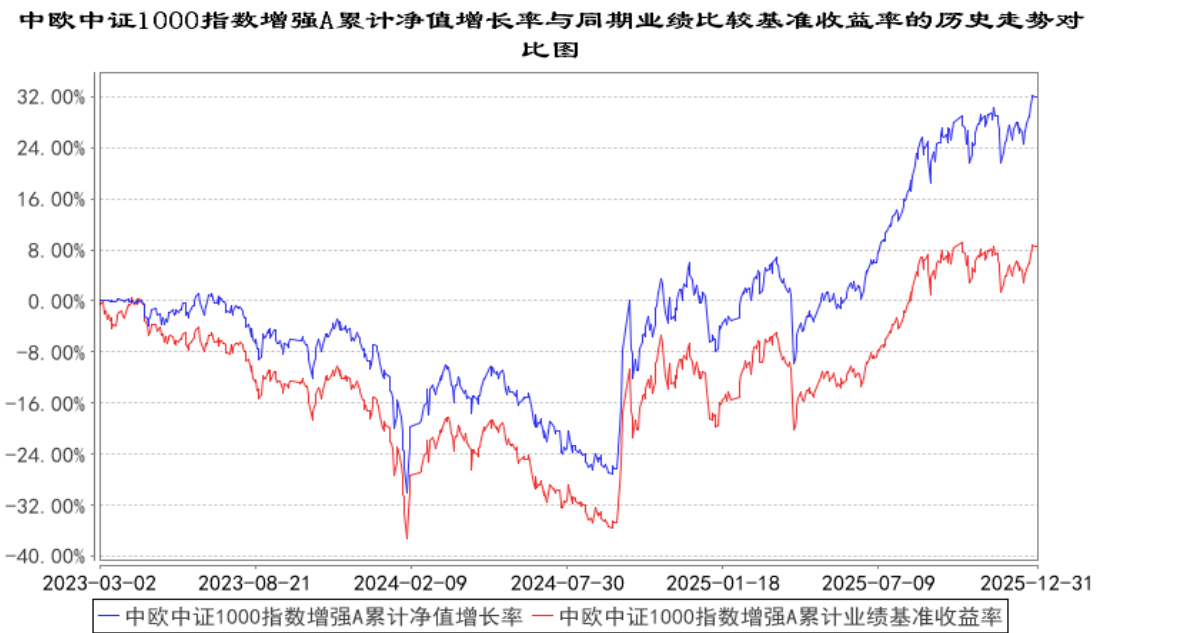
注：本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧中证 1000 指数增强 C

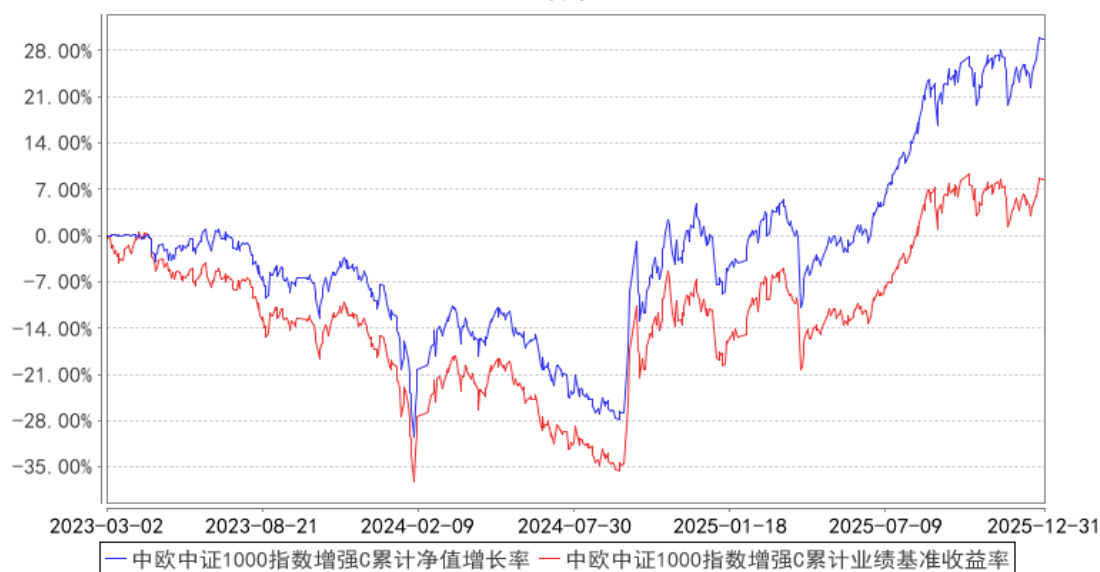
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.86%	1.10%	0.28%	1.07%	2.58%	0.03%
过去六个月	24.10%	1.06%	18.49%	1.06%	5.61%	0.00%
过去一年	33.47%	1.27%	26.12%	1.32%	7.35%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	29.68%	1.44%	8.53%	1.51%	21.15%	-0.07%

注：本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

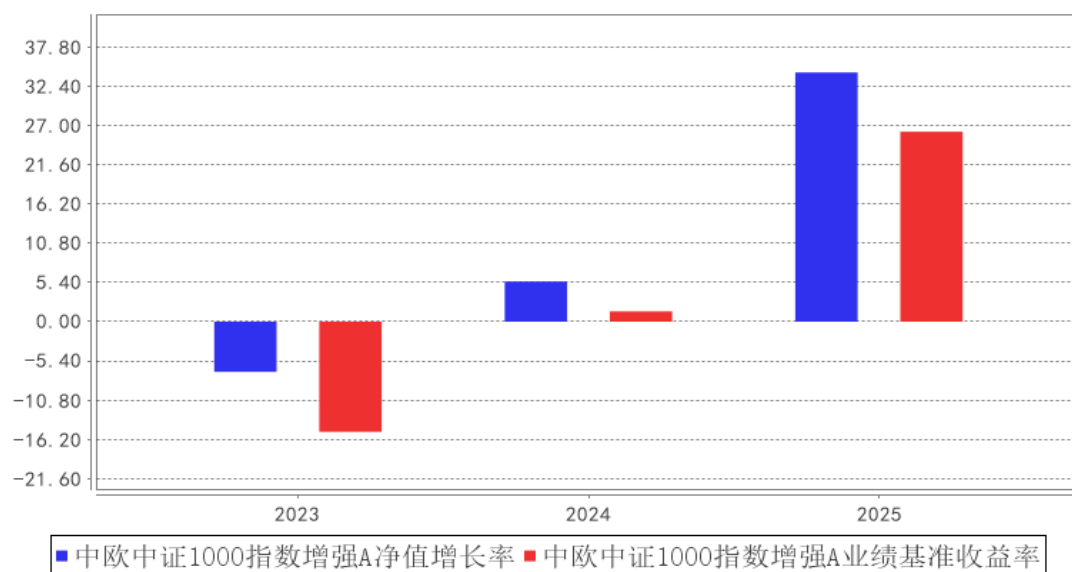


中欧中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



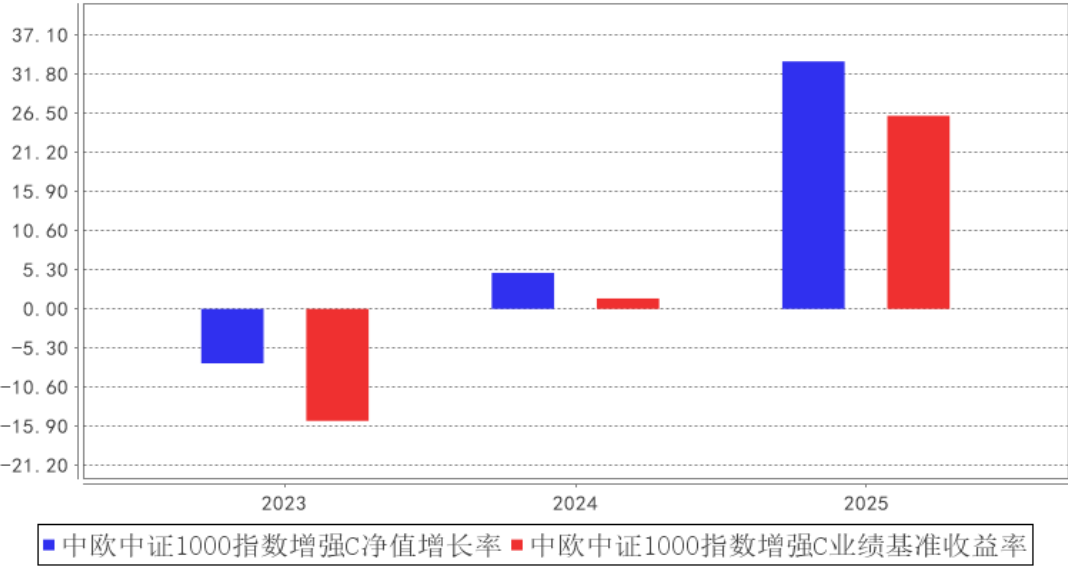
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 2 日，2023 年度数据为 2023 年 3 月 2 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

中欧中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 2 日，2023 年度数据为 2023 年 3 月 2 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 227 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理	2023-03-02	-	9 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	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。
宋婷	量化投委会委员 / 基金经理	2025-06-05	-	7 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，其中赵子衡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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

4.3.3 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 79 次，其中 77 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，2 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回望 2025 年的 A 股市场，我们经历了一个从预期修复转向基本面验证的复杂年份。年初，随着一系列逆周期调节政策的效能加速释放，市场在流动性充裕与政策底明确的双重支撑下，开启了一轮以核心资产估值修复为主线的反弹行情。然而，随着全球宏观环境的复杂化，特别是地缘政治博弈对全球供应链的持续重构，A 股市场在年中经历了显著的波动与磨底。进入下半年，随着三季报及年报预期的逐步明朗，市场重心开始向具备全球竞争力的制造业龙头倾斜。从因子表现来看，上半年，受全球降息预期反复与国内产业政策落地的双重影响，成长风格中的动量因子一度占据主导，人工智能应用端等新兴产业带动了小盘成长股的阶段性估值修复。然而三季度以来，顺周期复苏的预期逐步抬升，大类风格波动剧烈，在 10 月和 12 月初分别有两次极致的风格轮动，整体来看，盈利、波动率、流动性回撤较大。10 月初，市场风格切换到小市值低波为主的分散化行情，超额迎来了一轮反弹，而 12 月初以来，市场又延续了 7-9 月的集中行情，风险偏好波动剧烈。四季度，市场在内部政策定力与外部压力缓和的共同作用下，逐步走出观望情绪，完成从“防御避险”到“布局成长”的风格转换。

本基金是以中证 1000 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。我们会持续跟踪市场风格因子特征，控制组合风险因子暴露，力争让量化组合的超额收益更为平稳。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。

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 34.26%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%；基金 C 类份额净值增长率为 33.47%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从中长期配置视角，我们重点关注三大方向：首先是科技成长领域，科技创新是推动经济增长的关键动力，半导体、人工智能、生物科技等行业将继续受到政策和市场的双重支持，有望出现新的增长点；储能需求回升，国内新型储能装机规模持续高增长，叠加海外市场复苏，带动行业景气上行。其次，全球货币宽松背景下，商品的资源稀缺性被重新定价，我们关注相对滞涨的工业金属板块。最后，看好 2026 年 PPI 底部回升，“反内卷”政策深入推进带来的工业品价格与盈利修复的机遇，其中供给格局清晰的基础化工行业值得重点关注。

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。我们将进一步优化组合的风险预算管理，在严控行业偏离与风格暴露的基础上，通过组合优化算法实现更优的夏普比率。针对 2026 年可能出现的结构性行情，我们的策略将通过多维度因子共振筛选出具备全球竞争力的细分龙头，力求在控制回撤的前提下，为投资者创造稳健且可持续的超额回报。面对 2026 年更加复杂多变的全球金融环境，我们将坚持数据驱动与逻辑验证并重的原则，不断迭代量化模型，以专业的研究深度应对市场的广度挑战。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2025 年，监管机构颁布了多部法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2025 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制定或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、

基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2025 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2025 年，公司紧密对标新版《反洗钱法》及配套的《金融机构客户尽职调查管理办法》《受益所有人识别管理办法》等监管新规要求，紧跟“基于风险”的监管导向，全面升级反洗钱管理体系。

公司进一步优化洗钱、恐怖融资和扩散融资风险管控治理架构，从制度流程修订、风险评估深化、培训宣传强化等多维度补短板、提质效，牵头各业务部门压实反洗钱履职责任，提升全员合规履职能力。紧扣监管对系统智能化、数据精准化的要求，公司结合业务发展实际优化核心功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设，满足监管新规落地与风险防控需求。

4.7 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约定的估值方法、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。

4.8 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。

4.9 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70028871_B119 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公

	允反映了中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适

	当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	26,161,778.51	21,753,126.36
结算备付金		911,035.53	8,696,117.28
存出保证金		—	1,381,536.00
交易性金融资产	7.4.7.2	450,414,982.68	691,813,057.96
其中：股票投资		450,414,982.68	669,052,731.55
基金投资		—	—
债券投资		—	22,760,326.41

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		11,739,869.61	10,955,034.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		489,227,666.33	734,598,871.97
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,725,771.57	5,662,187.87
应付管理人报酬		449,975.83	671,274.59
应付托管费		44,997.57	67,127.45
应付销售服务费		158,510.57	136,395.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,382.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	50,000.00	60,000.00
负债合计		7,435,637.59	6,596,985.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	368,755,941.91	743,796,274.95
未分配利润	7.4.7.8	113,036,086.83	-15,794,388.29
净资产合计		481,792,028.74	728,001,886.66
负债和净资产总计		489,227,666.33	734,598,871.97

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 368,755,941.91 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.3190 元，基金份额总额 161,455,817.79 份；下属 C 类基金份额净值为人民币

1.2968 元，基金份额总额 207,300,124.12 份。

7.2 利润表

会计主体：中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		158,673,348.54	72,214,818.73
1. 利息收入		159,535.03	470,858.21
其中：存款利息收入	7.4.7.9	159,535.03	407,312.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	63,545.97
2. 投资收益（损失以“-”填列）		133,583,441.70	84,511,633.70
其中：股票投资收益	7.4.7.10	126,413,864.33	65,130,519.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	79,651.59	227,714.53
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	2,656,864.47	6,676,000.65
股利收益	7.4.7.14	4,433,061.31	12,477,398.58
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）	7.4.7.15	24,197,380.46	-13,217,708.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	732,991.35	450,035.14
减：二、营业总支出		7,144,523.92	13,523,911.64
1. 管理人报酬		5,026,976.29	9,279,884.53
2. 托管费		502,697.63	927,988.45
3. 销售服务费		1,394,680.14	3,041,881.45
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		22,560.62	45,644.37
其中：卖出回购金融资产支出		22,560.62	45,644.37
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		9,609.24	30,512.84
8. 其他费用	7.4.7.18	188,000.00	198,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		151,528,824.62	58,690,907.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		151,528,824.62	58,690,907.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		151,528,824.62	58,690,907.09

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	743,796,274.95	-	-15,794,388.29	728,001,886.66
二、本期期初净资产	743,796,274.95	-	-15,794,388.29	728,001,886.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-375,040,333.04	-	128,830,475.12	-246,209,857.92
（一）、综合收益总额	-	-	151,528,824.62	151,528,824.62
（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）	-375,040,333.04	-	-22,698,349.50	-397,738,682.54
其中：1. 基金申购款	1,434,860,705.25	-	197,369,201.71	1,632,229,906.96
2. 基金赎回款	-1,809,901,038.29	-	-220,067,551.21	-2,029,968,589.50
（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	368,755,941.91	-	113,036,086.83	481,792,028.74
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	1,226,553,086.31	-	-87,674,178.46	1,138,878,907.85
二、本期期初净资产	1,226,553,086.31	-	-87,674,178.46	1,138,878,907.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-482,756,811.36	-	71,879,790.17	-410,877,021.19
（一）、综合收益总额	-	-	58,690,907.09	58,690,907.09
（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）	-482,756,811.36	-	13,188,883.08	-469,567,928.28
其中：1. 基金申购款	1,353,070,246.97	-	-156,319,643.50	1,196,750,603.47
2. 基金赎回款	-1,835,827,058.33	-	169,508,526.58	-1,666,318,531.75
（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	743,796,274.95	-	-15,794,388.29	728,001,886.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]275 号文《关于准予中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,227,079,276.03 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61362990_B09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,227,306,584.43 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 227,308.40 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 754,558,392.41 份，包含认购利息折合 137,183.25 份；C 类基金的基金份额总额为 472,748,192.02 份，包含认购利息折合 90,125.15 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个

估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程

中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发

行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	20,565.79	356,686.97
等于：本金	20,000.00	355,600.15
加：应计利息	565.79	1,086.82
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	26,141,212.72	21,396,439.39
等于：本金	26,139,393.57	21,395,164.02
加：应计利息	1,819.15	1,275.37
减：坏账准备	-	-
合计	26,161,778.51	21,753,126.36

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	449,016,209.63	-	450,414,982.68	1,398,773.05
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		449,016,209.63	-	450,414,982.68	1,398,773.05
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		691,309,265.20	-	669,052,731.55	-22,256,533.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22,498,482.00	269,506.41	22,760,326.41	-7,662.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,498,482.00	269,506.41	22,760,326.41	-7,662.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		713,807,747.20	269,506.41	691,813,057.96	-22,264,195.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义	公允价值		备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,047,211.76	-	-	-
其中：股指期货投资	12,047,211.76	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,047,211.76	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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-审计费	50,000.00	60,000.00
合计	50,000.00	60,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	493,022,296.27	493,022,296.27

本期申购	237,971,994.28	237,971,994.28
本期赎回（以“-”号填列）	-569,538,472.76	-569,538,472.76
本期末	161,455,817.79	161,455,817.79

中欧中证 1000 指数增强 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,773,978.68	250,773,978.68
本期申购	1,196,888,710.97	1,196,888,710.97
本期赎回（以“-”号填列）	-1,240,362,565.53	-1,240,362,565.53
本期末	207,300,124.12	207,300,124.12

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。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,582,469.26	-50,261,124.48	-8,678,655.22
本期期初	41,582,469.26	-50,261,124.48	-8,678,655.22
本期利润	66,320,922.13	16,826,677.54	83,147,599.67
本期基金份额交易产生的变动数	-40,132,731.21	17,171,124.98	-22,961,606.23
其中：基金申购款	57,463,406.94	-19,432,390.99	38,031,015.95
基金赎回款	-97,596,138.15	36,603,515.97	-60,992,622.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,770,660.18	-16,263,321.96	51,507,338.22

中欧中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,244,081.16	-25,359,814.23	-7,115,733.07
本期期初	18,244,081.16	-25,359,814.23	-7,115,733.07
本期利润	61,010,522.03	7,370,702.92	68,381,224.95
本期基金份额交易产生的变动数	2,985,053.66	-2,721,796.93	263,256.73
其中：基金申购款	274,837,193.78	-115,499,008.02	159,338,185.76
基金赎回款	-271,852,140.12	112,777,211.09	-159,074,929.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,239,656.85	-20,710,908.24	61,528,748.61

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	40,109.23	58,411.28

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	53,933.51	142,294.68
结算备付金利息收入	62,029.09	206,606.28
其他	3,463.20	-
合计	159,535.03	407,312.24

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,785,651,089.27	6,611,139,603.85
减：卖出股票成本总额	4,654,757,530.82	6,537,485,760.48
减：交易费用	4,479,694.12	8,523,323.43
买卖股票差价收入	126,413,864.33	65,130,519.94

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	178,133.59	257,153.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-98,482.00	-29,439.12
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	79,651.59	227,714.53

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,847,640.00	17,360,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,498,482.00	17,029,426.00
减：应计利息总额	447,640.00	360,000.00
减：交易费用	-	13.12
买卖债券差价收入	-98,482.00	-29,439.12

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,656,864.47	6,676,000.65

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,433,061.31	12,477,398.58
其中：证券出借权益补偿收入	-	19,876.84
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,433,061.31	12,477,398.58

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	23,662,968.70	-13,056,864.18
股票投资	23,655,306.70	-13,073,428.18

债券投资	7,662.00	16,564.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	534,411.76	-160,844.14
权证投资	-	-
期货投资	534,411.76	-160,844.14
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	24,197,380.46	-13,217,708.32

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	728,649.36	449,664.44
基金转换费收入	4,341.99	370.70
合计	732,991.35	450,035.14

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	188,000.00	198,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人股东
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
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司
中欧私募基金管理(上海)有限公司（“中欧私募”）	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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（%）
招商证券	2,574,913,749.44	28.01	1,470,344,231.27	11.49

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日
-------	--

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券	410,066.88	27.35	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券	405,618.58	9.22	-	-

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）。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,026,976.29	9,279,884.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,639,716.21	2,599,467.78
应支付基金管理人的净管理费	3,387,260.08	6,680,416.75

注：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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	502,697.63	927,988.45

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C	合计
国都证券	0.00	155.42	155.42
招商证券	0.00	267,710.86	267,710.86
中欧财富	0.00	1,481.24	1,481.24
中欧基金	0.00	43,121.78	43,121.78
合计	0.00	312,469.30	312,469.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C	合计
国都证券	0.00	285.43	285.43
招商证券	0.00	76,525.33	76,525.33
中欧财富	0.00	1,147.62	1,147.62
中欧基金	0.00	1,275,185.43	1,275,185.43
合计	0.00	1,353,143.81	1,353,143.81

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.60%。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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各类基金份额。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	12,774,822.64	43,897.97	1,337,419.68	66,833.15

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	333	15,984.00	17,276.04	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	1,996	35,708.44	90,538.56	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通受限	42.28	56.08	118	4,989.04	6,617.44	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-

301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	12.48	25.46	2,995	37,377.60	76,252.70	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	46.68	55.66	135	6,301.80	7,514.10	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-

603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	120	5,563.20	7,087.20	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	1,830	15,463.50	44,432.40	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	17.78	25.11	2,508	44,592.24	62,975.88	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	29.06	52.62	1,862	54,109.72	97,978.44	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股流通受限	8.62	18.36	6,984	60,202.08	128,226.24	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	83.06	117.19	348	28,904.88	40,782.12	-

688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	104.66	399.31	292	30,560.72	116,598.52	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	170	14,465.30	34,562.70	-

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。

7.4.12.2 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
600058	五矿发展	2025 年 12 月 30 日	重大事项停牌	11.52	2026 年 1 月 15 日	12.67	96,400	925,225.83	1,110,528.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	26,161,778.51	-	-	-	26,161,778.51
结算备付金	911,035.53	-	-	-	911,035.53
交易性金融资产	-	-	-	450,414,982.68	450,414,982.68
应收申购款	-	-	-	11,739,869.61	11,739,869.61
资产总计	27,072,814.04	-	-	462,154,852.29	489,227,666.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,725,771.57	6,725,771.57
应付管理人报酬	-	-	-	449,975.83	449,975.83
应付托管费	-	-	-	44,997.57	44,997.57
应付销售服务费	-	-	-	158,510.57	158,510.57
应交税费	-	-	-	6,382.05	6,382.05
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	7,435,637.59	7,435,637.59
利率敏感度缺口	27,072,814.04	-	-	454,719,214.70	481,792,028.74
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,753,126.36	-	-	-	21,753,126.36
结算备付金	8,696,117.28	-	-	-	8,696,117.28
存出保证金	-	-	-	1,381,536.00	1,381,536.00
交易性金融资产	22,760,326.41	-	-	669,052,731.55	691,813,057.96
应收申购款	-	-	-	10,955,034.37	10,955,034.37
资产总计	53,209,570.05	-	-	681,389,301.92	734,598,871.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,662,187.87	5,662,187.87
应付管理人报酬	-	-	-	671,274.59	671,274.59
应付托管费	-	-	-	67,127.45	67,127.45
应付销售服务费	-	-	-	136,395.40	136,395.40

其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	6,596,985.31	6,596,985.31
利率敏感度缺口	53,209,570.05	-	-	674,792,316.61	728,001,886.66

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：3.13%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	450,414,982.68	93.49	669,052,731.55	91.90
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	450,414,982.68	93.49	669,052,731.55	91.90

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	23,825,389.89	34,760,472.05
	业绩比较基准下降 5%	-23,825,389.89	-34,760,472.05

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	448,363,265.12	668,206,857.89
第二层次	1,110,528.00	22,985,168.91
第三层次	941,189.56	621,031.16
合计	450,414,982.68	691,813,057.96

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	621,031.16	621,031.16
当期购买	0.00	446,282.56	446,282.56
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	621,031.16	621,031.16
当期利得或损失总额	0.00	494,907.00	494,907.00
其中：计入损益的利得或损失	0.00	494,907.00	494,907.00
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	941,189.56	941,189.56
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	494,907.00	494,907.00
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	503,538.93	503,538.93
当期购买	0.00	245,499.06	245,499.06
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	503,538.93	503,538.93
当期利得或损失总额	0.00	375,532.10	375,532.10
其中：计入损益的利得或损失	0.00	375,532.10	375,532.10

计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	621,031.16	621,031.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	375,532.10	375,532.10

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	941,189.56	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1800-3.0791	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	621,031.16	平均价格亚式期权模型	波动率	0.2665-5.7444	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	450,414,982.68	92.07
	其中：股票	450,414,982.68	92.07
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	27,072,814.04	5.53
8	其他各项资产	11,739,869.61	2.40
9	合计	489,227,666.33	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,081,246.00	0.43
B	采矿业	12,015,800.00	2.49
C	制造业	262,086,365.79	54.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,188,036.00	2.32
E	建筑业	4,024,506.00	0.84
F	批发和零售业	13,713,142.92	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	12,543,637.00	2.60
H	住宿和餐饮业	979,875.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,960,935.62	6.84
J	金融业	6,774,501.00	1.41
K	房地产业	3,256,410.00	0.68
L	租赁和商务服务业	4,874,425.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	7,489,705.92	1.55
N	水利、环境和公共	2,584,245.00	0.54

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,860.00	-
Q	卫生和社会工作	1,903,781.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	3,507,754.00	0.73
S	综合	1,288,252.00	0.27
	合计	383,287,478.25	79.55

8.2.2 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	810,689.00	0.17
B	采矿业	2,198,290.08	0.46
C	制造业	45,991,672.00	9.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,575,597.00	0.53
E	建筑业	1,330,560.00	0.28
F	批发和零售业	2,488,443.44	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	977,460.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,528,613.40	1.15
J	金融业	9,436.00	0.00
K	房地产业	1,361,833.00	0.28
L	租赁和商务服务业	603,779.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,576,998.51	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	726,968.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	241,307.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	705,858.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	67,127,504.43	13.93

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	600388	龙净环保	196,100	3,198,391.00	0.66
2	688327	云从科技	221,588	3,184,219.56	0.66
3	601107	四川成渝	476,500	2,897,120.00	0.60
4	300134	大富科技	230,300	2,878,750.00	0.60
5	300098	高新兴	469,300	2,862,730.00	0.59
6	002258	利尔化学	211,900	2,765,295.00	0.57
7	603505	金石资源	147,500	2,755,300.00	0.57
8	300034	钢研高纳	126,000	2,467,080.00	0.51
9	000543	皖能电力	307,100	2,441,445.00	0.51
10	002222	福晶科技	41,900	2,360,646.00	0.49
11	688107	安路科技	85,897	2,334,680.46	0.48
12	300409	道氏技术	102,100	2,296,229.00	0.48
13	603328	依顿电子	203,000	2,224,880.00	0.46
14	002967	广电计量	100,700	2,216,407.00	0.46
15	600850	电科数字	73,600	2,181,504.00	0.45
16	000923	河钢资源	102,700	2,174,159.00	0.45
17	600100	同方股份	240,800	2,147,936.00	0.45
18	603317	天味食品	171,100	2,142,172.00	0.44
19	600335	国机汽车	325,000	2,115,750.00	0.44
20	300363	博腾股份	91,000	2,114,840.00	0.44
21	002373	千方科技	169,000	1,989,130.00	0.41
22	601369	陕鼓动力	197,800	1,979,978.00	0.41
23	002516	旷达科技	291,600	1,921,644.00	0.40
24	600428	中远海特	269,400	1,912,740.00	0.40
25	301571	国科天成	33,000	1,903,440.00	0.40
26	002668	TCL 智家	183,100	1,900,578.00	0.39
27	600643	爱建集团	339,600	1,877,988.00	0.39
28	002075	沙钢股份	325,000	1,868,750.00	0.39
29	002324	普利特	116,500	1,862,835.00	0.39
30	688182	灿勤科技	62,448	1,843,464.96	0.38
31	300171	东富龙	115,700	1,816,490.00	0.38
32	603915	国茂股份	96,980	1,785,401.80	0.37
33	002204	大连重工	229,400	1,754,910.00	0.36
34	002091	江苏国泰	191,900	1,732,857.00	0.36
35	600478	科力远	249,400	1,718,366.00	0.36
36	002174	游族网络	138,500	1,695,240.00	0.35
37	600353	旭光电子	103,500	1,668,420.00	0.35
38	600331	宏达股份	129,700	1,658,863.00	0.34
39	000902	新洋丰	106,100	1,657,282.00	0.34

40	002004	华邦健康	345,900	1,653,402.00	0.34
41	000030	富奥股份	287,700	1,651,398.00	0.34
42	002484	江海股份	55,400	1,645,380.00	0.34
43	300747	锐科激光	59,600	1,610,988.00	0.33
44	002023	海特高新	118,900	1,609,906.00	0.33
45	600210	紫江企业	215,900	1,586,865.00	0.33
46	603027	千禾味业	157,700	1,550,191.00	0.32
47	300303	聚飞光电	225,700	1,543,788.00	0.32
48	600459	贵研铂业	82,700	1,539,047.00	0.32
49	000600	建投能源	178,700	1,524,311.00	0.32
50	300925	法本信息	70,700	1,501,668.00	0.31
51	002405	四维图新	166,100	1,496,561.00	0.31
52	600320	振华重工	287,900	1,482,685.00	0.31
53	688333	铂力特	13,227	1,474,942.77	0.31
54	300620	光库科技	10,000	1,470,500.00	0.31
55	002755	奥赛康	89,700	1,464,801.00	0.30
56	002701	奥瑞金	245,600	1,461,320.00	0.30
57	000767	晋控电力	519,600	1,454,880.00	0.30
58	002434	万里扬	152,200	1,450,466.00	0.30
59	300236	上海新阳	22,000	1,402,720.00	0.29
60	600859	王府井	87,064	1,352,103.92	0.28
61	002913	奥士康	31,600	1,350,584.00	0.28
62	300257	开山股份	95,900	1,347,395.00	0.28
63	688800	瑞可达	16,206	1,345,098.00	0.28
64	000811	冰轮环境	72,550	1,343,626.00	0.28
65	300083	创世纪	145,800	1,342,818.00	0.28
66	601126	四方股份	44,600	1,341,568.00	0.28
67	000603	盛达资源	42,900	1,328,184.00	0.28
68	002182	宝武镁业	86,300	1,320,390.00	0.27
69	300438	鹏辉能源	24,700	1,314,534.00	0.27
70	603063	禾望电气	39,700	1,312,879.00	0.27
71	688127	蓝特光学	34,081	1,311,777.69	0.27
72	601083	锦江航运	116,600	1,301,256.00	0.27
73	600869	远东股份	161,100	1,296,855.00	0.27
74	600490	鹏欣资源	167,500	1,294,775.00	0.27
75	000833	粤桂股份	66,200	1,288,252.00	0.27
76	300416	苏试试验	71,300	1,271,992.00	0.26
77	002487	大金重工	24,400	1,267,092.00	0.26
78	688321	微芯生物	42,935	1,254,560.70	0.26
79	000058	深赛格	132,600	1,246,440.00	0.26
80	300602	飞荣达	37,100	1,230,236.00	0.26
81	600389	江山股份	48,400	1,223,552.00	0.25
82	000680	山推股份	101,000	1,208,970.00	0.25

83	688779	五矿新能	158,788	1,189,322.12	0.25
84	600114	东睦股份	38,500	1,176,175.00	0.24
85	301219	腾远钴业	17,200	1,174,416.00	0.24
86	300762	上海瀚讯	27,900	1,162,872.00	0.24
87	603118	共进股份	101,000	1,161,500.00	0.24
88	301487	盟固利	52,404	1,149,219.72	0.24
89	603306	华懋科技	18,100	1,140,481.00	0.24
90	688209	英集芯	56,918	1,134,944.92	0.24
91	002125	湘潭电化	79,700	1,128,552.00	0.23
92	300244	迪安诊断	71,100	1,126,935.00	0.23
93	300296	利亚德	176,300	1,114,216.00	0.23
94	600058	五矿发展	96,400	1,110,528.00	0.23
95	601038	一拖股份	78,000	1,105,260.00	0.23
96	001337	四川黄金	39,200	1,092,112.00	0.23
97	600116	三峡水利	166,700	1,090,218.00	0.23
98	002051	中工国际	120,000	1,088,400.00	0.23
99	000612	焦作万方	98,600	1,086,572.00	0.23
100	688131	皓元医药	14,774	1,064,909.92	0.22
101	600057	厦门象屿	123,200	1,049,664.00	0.22
102	601208	东材科技	38,700	1,048,383.00	0.22
103	300415	伊之密	40,100	1,045,006.00	0.22
104	002859	洁美科技	37,800	1,043,280.00	0.22
105	000899	赣能股份	105,300	1,042,470.00	0.22
106	603887	城地香江	77,100	1,042,392.00	0.22
107	002626	金达威	52,800	1,040,688.00	0.22
108	301039	中集车辆	113,600	1,039,440.00	0.22
109	300779	惠城环保	7,900	1,027,869.00	0.21
110	002498	汉缆股份	267,200	1,023,376.00	0.21
111	601702	华峰铝业	49,700	1,017,359.00	0.21
112	688700	东威科技	28,698	1,012,465.44	0.21
113	603127	昭衍新药	28,900	1,011,789.00	0.21
114	688048	长光华芯	8,069	1,011,449.15	0.21
115	300319	麦捷科技	86,200	1,007,678.00	0.21
116	002233	塔牌集团	111,600	1,005,516.00	0.21
117	603556	海兴电力	27,600	1,004,640.00	0.21
118	002534	西子洁能	59,896	1,004,455.92	0.21
119	300682	朗新集团	65,000	988,650.00	0.21
120	600654	中安科	261,100	984,347.00	0.20
121	600258	首旅酒店	58,500	979,875.00	0.20
122	002612	朗姿股份	47,900	979,076.00	0.20
123	000928	中钢国际	147,200	972,992.00	0.20
124	002946	新乳业	52,400	970,972.00	0.20
125	002544	普天科技	28,100	969,169.00	0.20

126	600761	安徽合力	46,000	960,940.00	0.20
127	605020	永和股份	35,300	949,217.00	0.20
128	002545	东方铁塔	51,400	948,330.00	0.20
129	002041	登海种业	99,200	946,368.00	0.20
130	002745	木林森	97,600	934,032.00	0.19
131	301526	国际复材	132,700	928,900.00	0.19
132	002539	云图控股	78,300	925,506.00	0.19
133	001203	大中矿业	30,100	922,565.00	0.19
134	603871	嘉友国际	65,500	913,725.00	0.19
135	603103	横店影视	54,600	905,268.00	0.19
136	002960	青鸟消防	86,100	904,911.00	0.19
137	600888	新疆众和	109,500	896,805.00	0.19
138	301087	可孚医疗	20,000	893,400.00	0.19
139	688001	华兴源创	29,511	890,641.98	0.18
140	600399	抚顺特钢	150,800	880,672.00	0.18
141	603638	艾迪精密	46,100	872,673.00	0.18
142	300772	运达股份	45,781	872,585.86	0.18
143	300725	药石科技	22,600	871,456.00	0.18
144	603218	日月股份	64,900	859,925.00	0.18
145	002038	双鹭药业	116,600	859,342.00	0.18
146	300036	超图软件	47,300	858,968.00	0.18
147	002911	佛燃能源	69,700	844,764.00	0.18
148	002243	力合科创	84,700	842,765.00	0.17
149	002928	华夏航空	76,200	842,010.00	0.17
150	002097	山河智能	67,500	837,675.00	0.17
151	603588	高能环境	108,500	837,620.00	0.17
152	688519	南亚新材	10,356	837,386.16	0.17
153	300443	金雷股份	29,700	835,461.00	0.17
154	002158	汉钟精机	33,300	833,499.00	0.17
155	600596	新安股份	72,100	826,987.00	0.17
156	600961	株冶集团	51,300	825,930.00	0.17
157	601778	晶科科技	221,700	824,724.00	0.17
158	000035	中国天楹	149,200	823,584.00	0.17
159	000555	神州信息	49,700	822,535.00	0.17
160	603456	九洲药业	45,900	821,610.00	0.17
161	000567	海德股份	127,600	819,192.00	0.17
162	000065	北方国际	65,700	818,622.00	0.17
163	600933	爱柯迪	40,500	814,050.00	0.17
164	688097	博众精工	21,543	813,248.25	0.17
165	000019	深粮控股	116,800	811,760.00	0.17
166	002345	潮宏基	64,800	810,000.00	0.17
167	002302	西部建设	131,600	805,392.00	0.17
168	605099	共创草坪	22,300	795,887.00	0.17

169	601089	福元医药	33,100	794,400.00	0.16
170	600572	康恩贝	177,900	793,434.00	0.16
171	300232	洲明科技	111,900	793,371.00	0.16
172	688003	天准科技	13,457	792,617.30	0.16
173	603876	鼎胜新材	52,800	792,528.00	0.16
174	300341	麦克奥迪	48,500	792,490.00	0.16
175	688005	容百科技	22,377	792,145.80	0.16
176	300068	南都电源	50,900	790,986.00	0.16
177	688158	优刻得	28,158	790,958.22	0.16
178	002100	天康生物	107,300	790,801.00	0.16
179	600315	上海家化	35,000	788,200.00	0.16
180	002643	万润股份	52,400	785,476.00	0.16
181	600125	铁龙物流	121,400	781,816.00	0.16
182	002651	利君股份	66,500	777,385.00	0.16
183	688141	杰华特	17,755	771,099.65	0.16
184	688549	中巨芯	84,018	766,244.16	0.16
185	002011	盾安环境	60,300	764,604.00	0.16
186	603043	广州酒家	43,200	761,616.00	0.16
187	002354	天娱数科	119,200	759,304.00	0.16
188	002020	京新药业	40,000	759,200.00	0.16
189	688382	益方生物	27,783	756,808.92	0.16
190	002468	申通快递	56,100	752,862.00	0.16
191	002497	雅化集团	30,300	749,925.00	0.16
192	300323	华灿光电	93,700	747,726.00	0.16
193	000672	上峰水泥	57,300	744,327.00	0.15
194	688150	莱特光电	27,501	743,352.03	0.15
195	603026	石大胜华	9,900	740,619.00	0.15
196	600507	方大特钢	125,100	736,839.00	0.15
197	600787	中储股份	131,100	736,782.00	0.15
198	600186	莲花控股	123,200	736,736.00	0.15
199	688584	上海合晶	33,502	735,033.88	0.15
200	300428	立中集团	31,200	728,520.00	0.15
201	002245	蔚蓝锂芯	40,700	724,460.00	0.15
202	600649	城投控股	161,100	716,895.00	0.15
203	000059	华锦股份	132,100	706,735.00	0.15
204	002270	华明装备	28,200	706,128.00	0.15
205	688331	荣昌生物	9,074	705,866.46	0.15
206	601677	明泰铝业	47,600	704,004.00	0.15
207	603267	鸿远电子	12,900	702,147.00	0.15
208	605118	力鼎光电	23,300	701,563.00	0.15
209	601900	南方传媒	51,800	694,638.00	0.14
210	600993	马应龙	24,800	694,400.00	0.14
211	300077	国民技术	34,300	693,546.00	0.14

212	688362	甬矽电子	21,315	690,819.15	0.14
213	600075	新疆天业	139,500	690,525.00	0.14
214	603279	景津装备	40,800	688,296.00	0.14
215	002389	航天彩虹	28,600	685,828.00	0.14
216	300850	新强联	16,500	682,605.00	0.14
217	601890	亚星锚链	66,200	681,198.00	0.14
218	300119	瑞普生物	36,200	679,474.00	0.14
219	605116	奥锐特	27,100	678,855.00	0.14
220	603733	仙鹤股份	27,800	671,926.00	0.14
221	601020	华钰矿业	25,000	671,500.00	0.14
222	300151	昌红科技	44,200	666,536.00	0.14
223	300045	华力创通	23,000	664,930.00	0.14
224	300352	北信源	108,200	663,266.00	0.14
225	001287	中电港	29,200	661,672.00	0.14
226	688432	有研硅	53,296	661,403.36	0.14
227	300568	星源材质	42,900	654,225.00	0.14
228	603730	岱美股份	74,600	653,496.00	0.14
229	300008	天海防务	82,800	653,292.00	0.14
230	002588	史丹利	65,400	652,692.00	0.14
231	688300	联瑞新材	10,467	649,896.03	0.13
232	688062	迈威生物	16,760	644,757.20	0.13
233	601777	千里科技	60,300	640,989.00	0.13
234	002046	国机精工	14,700	634,746.00	0.13
235	002096	易普力	47,500	632,700.00	0.13
236	600328	中盐化工	75,700	623,768.00	0.13
237	600267	海正药业	63,000	623,070.00	0.13
238	000422	湖北宜化	43,800	622,398.00	0.13
239	601003	柳钢股份	123,500	621,205.00	0.13
240	002458	益生股份	74,100	620,958.00	0.13
241	300348	长亮科技	40,100	620,748.00	0.13
242	688343	云天励飞	8,133	618,758.64	0.13
243	601619	嘉泽新能	139,000	617,160.00	0.13
244	000686	东北证券	65,800	613,256.00	0.13
245	688037	芯源微	4,129	613,197.79	0.13
246	600409	三友化工	98,700	610,953.00	0.13
247	300811	铂科新材	8,500	606,135.00	0.13
248	001236	弘业期货	57,000	604,200.00	0.13
249	002698	博实股份	35,800	601,798.00	0.12
250	001301	尚太科技	7,000	600,670.00	0.12
251	600094	大名城	142,900	594,464.00	0.12
252	002036	联创电子	53,900	593,978.00	0.12
253	600773	西藏城投	47,900	593,481.00	0.12
254	601187	厦门银行	80,800	593,072.00	0.12

255	600963	岳阳林纸	126,600	591,222.00	0.12
256	603690	至纯科技	18,700	588,115.00	0.12
257	002320	海峡股份	48,300	587,811.00	0.12
258	002791	坚朗五金	27,700	587,517.00	0.12
259	003012	东鹏控股	89,000	582,950.00	0.12
260	601869	长飞光纤	5,000	581,800.00	0.12
261	300133	华策影视	69,800	580,736.00	0.12
262	300131	英唐智控	39,400	577,604.00	0.12
263	603355	莱克电气	18,100	574,313.00	0.12
264	600456	宝钛股份	14,500	572,025.00	0.12
265	688208	道通科技	15,525	571,320.00	0.12
266	300199	翰宇药业	31,900	571,010.00	0.12
267	300049	福瑞医科	8,100	570,321.00	0.12
268	002489	浙江永强	148,800	569,904.00	0.12
269	600827	百联股份	62,600	562,774.00	0.12
270	002073	软控股份	68,200	555,830.00	0.12
271	601068	中铝国际	104,800	554,392.00	0.12
272	002706	良信股份	51,400	554,092.00	0.12
273	605507	国邦医药	22,200	550,560.00	0.11
274	301127	武汉天源	35,700	542,283.00	0.11
275	301626	苏州天脉	2,900	540,270.00	0.11
276	002531	天顺风能	78,400	537,824.00	0.11
277	603663	三祥新材	15,200	537,320.00	0.11
278	600686	金龙汽车	30,100	533,974.00	0.11
279	000029	深深房 A	24,200	532,884.00	0.11
280	600750	江中药业	22,900	530,593.00	0.11
281	000049	德赛电池	19,600	526,848.00	0.11
282	601609	金田股份	48,500	523,800.00	0.11
283	601963	重庆银行	48,100	520,923.00	0.11
284	300080	易成新能	106,300	516,618.00	0.11
285	300687	赛意信息	22,400	514,528.00	0.11
286	300087	荃银高科	44,000	513,920.00	0.11
287	688639	华恒生物	15,767	513,688.86	0.11
288	002897	意华股份	9,500	513,665.00	0.11
289	000778	新兴铸管	122,700	512,886.00	0.11
290	002747	埃斯顿	21,600	511,920.00	0.11
291	301215	中汽股份	74,400	509,640.00	0.11
292	301071	力量钻石	14,100	505,344.00	0.10
293	002895	川恒股份	13,700	502,242.00	0.10
294	301381	赛维时代	24,300	500,337.00	0.10
295	601801	皖新传媒	75,000	493,500.00	0.10
296	301268	铭利达	26,800	488,564.00	0.10
297	000829	天音控股	44,300	483,313.00	0.10

298	600216	浙江医药	34,800	482,328.00	0.10
299	300065	海兰信	26,500	481,505.00	0.10
300	688372	伟测科技	4,400	479,996.00	0.10
301	002292	奥飞娱乐	54,100	478,785.00	0.10
302	688409	富创精密	7,098	478,405.20	0.10
303	600246	万通发展	38,200	469,860.00	0.10
304	603057	紫燕食品	23,100	469,854.00	0.10
305	600063	皖维高新	79,500	468,255.00	0.10
306	300047	天源迪科	37,300	468,115.00	0.10
307	600179	安通控股	84,200	464,784.00	0.10
308	300184	力源信息	46,300	462,537.00	0.10
309	300130	新国都	16,600	460,318.00	0.10
310	688153	唯捷创芯	12,214	459,734.96	0.10
311	688443	智翔金泰	16,830	458,449.20	0.10
312	605599	菜百股份	28,000	458,360.00	0.10
313	600556	天下秀	75,200	456,464.00	0.09
314	601101	昊华能源	63,500	454,660.00	0.09
315	300548	长芯博创	3,200	454,400.00	0.09
316	600577	精达股份	36,500	453,695.00	0.09
317	600338	西藏珠峰	30,000	451,200.00	0.09
318	603530	神马电力	10,900	447,772.00	0.09
319	002060	广东建工	123,900	446,040.00	0.09
320	688270	臻镭科技	3,641	444,456.87	0.09
321	300702	天宇股份	18,700	441,320.00	0.09
322	002557	洽洽食品	20,400	441,048.00	0.09
323	600416	湘电股份	27,800	438,684.00	0.09
324	002378	章源钨业	30,800	436,744.00	0.09
325	002536	飞龙股份	14,700	436,590.00	0.09
326	002237	恒邦股份	32,436	435,291.12	0.09
327	002511	中顺洁柔	50,400	431,424.00	0.09
328	002212	天融信	47,500	430,825.00	0.09
329	600201	生物股份	28,400	427,988.00	0.09
330	688205	德科立	3,106	427,012.88	0.09
331	603219	富佳股份	25,300	426,052.00	0.09
332	002396	星网锐捷	13,900	421,170.00	0.09
333	600508	上海能源	35,500	417,835.00	0.09
334	603496	恒为科技	15,300	417,384.00	0.09
335	300624	万兴科技	5,900	416,835.00	0.09
336	002428	云南锗业	13,000	412,750.00	0.09
337	301522	上大股份	10,500	411,285.00	0.09
338	300401	花园生物	27,200	411,264.00	0.09
339	002048	宁波华翔	12,800	402,688.00	0.08
340	301293	三博脑科	6,800	401,064.00	0.08

341	603308	应流股份	9,600	400,800.00	0.08
342	688548	广钢气体	27,234	395,982.36	0.08
343	600710	苏美达	36,500	394,565.00	0.08
344	603013	亚普股份	15,900	392,253.00	0.08
345	301363	美好医疗	16,300	392,015.00	0.08
346	601069	西部黄金	14,600	389,528.00	0.08
347	600403	大有能源	55,600	388,088.00	0.08
348	002216	三全食品	34,100	384,989.00	0.08
349	002993	奥海科技	8,800	384,648.00	0.08
350	688390	固德威	6,191	384,646.83	0.08
351	301316	慧博云通	8,600	384,248.00	0.08
352	000682	东方电子	32,300	383,078.00	0.08
353	002882	金龙羽	12,700	383,032.00	0.08
354	002368	太极股份	15,600	382,044.00	0.08
355	300580	贝斯特	14,500	381,205.00	0.08
356	002079	苏州固锝	39,900	381,045.00	0.08
357	301267	华夏眼科	20,900	375,782.00	0.08
358	300576	容大感光	9,700	373,935.00	0.08
359	000761	本钢板材	111,600	373,860.00	0.08
360	600645	中源协和	14,800	372,960.00	0.08
361	603305	旭升集团	22,900	370,522.00	0.08
362	301376	致欧科技	20,400	368,628.00	0.08
363	002541	鸿路钢构	22,400	368,256.00	0.08
364	301238	瑞泰新材	17,800	363,120.00	0.08
365	600746	江苏索普	52,500	361,200.00	0.07
366	002317	众生药业	19,000	360,620.00	0.07
367	002941	新疆交建	22,600	358,210.00	0.07
368	600120	浙江东方	57,800	356,626.00	0.07
369	002839	张家港行	77,700	355,089.00	0.07
370	301205	联特科技	2,100	353,871.00	0.07
371	002399	海普瑞	29,800	351,342.00	0.07
372	688068	热景生物	2,162	350,244.00	0.07
373	603055	台华新材	37,000	349,280.00	0.07
374	600259	中稀有色	6,200	348,812.00	0.07
375	000813	德展健康	90,800	348,672.00	0.07
376	300451	创业慧康	71,800	347,512.00	0.07
377	000935	四川双马	13,900	345,276.00	0.07
378	688352	颀中科技	27,260	343,748.60	0.07
379	603866	桃李面包	65,100	342,426.00	0.07
380	301339	通行宝	23,300	338,782.00	0.07
381	300693	盛弘股份	8,800	336,864.00	0.07
382	600113	浙江东日	5,300	334,801.00	0.07
383	300755	华致酒行	19,000	334,780.00	0.07

384	002697	红旗连锁	56,200	333,828.00	0.07
385	600158	中体产业	38,200	333,486.00	0.07
386	600458	时代新材	25,100	333,077.00	0.07
387	688147	微导纳米	5,296	332,535.84	0.07
388	002815	崇达技术	24,300	331,938.00	0.07
389	300183	东软载波	22,100	327,743.00	0.07
390	600475	华光环能	17,700	321,609.00	0.07
391	300821	东岳硅材	26,600	310,156.00	0.06
392	688262	国芯科技	10,124	307,263.40	0.06
393	301511	德福科技	8,500	304,215.00	0.06
394	000597	东北制药	58,100	303,282.00	0.06
395	002081	金螳螂	88,000	300,960.00	0.06
396	002006	精工科技	12,965	300,269.40	0.06
397	300674	宇信科技	12,300	298,398.00	0.06
398	605555	德昌股份	16,300	298,290.00	0.06
399	000970	中科三环	21,900	296,964.00	0.06
400	300775	三角防务	9,700	294,880.00	0.06
401	603256	宏和科技	8,000	294,480.00	0.06
402	301217	铜冠铜箔	8,500	291,380.00	0.06
403	300253	卫宁健康	32,800	289,296.00	0.06
404	300079	数码视讯	53,400	287,826.00	0.06
405	688116	天奈科技	6,050	285,257.50	0.06
406	600996	贵广网络	28,100	282,124.00	0.06
407	301109	军信股份	18,700	280,500.00	0.06
408	601326	秦港股份	80,000	279,200.00	0.06
409	603919	金徽酒	13,500	275,670.00	0.06
410	603025	大豪科技	15,300	274,788.00	0.06
411	601678	滨化股份	64,500	273,480.00	0.06
412	002892	科力尔	20,300	272,426.00	0.06
413	002043	兔宝宝	18,800	270,908.00	0.06
414	300360	炬华科技	15,400	267,806.00	0.06
415	300101	振芯科技	9,400	267,242.00	0.06
416	688091	上海谊众	5,675	266,725.00	0.06
417	601022	宁波远洋	28,900	265,013.00	0.06
418	002010	传化智联	45,600	264,936.00	0.05
419	603997	继峰股份	19,000	264,100.00	0.05
420	688403	汇成股份	16,115	263,963.70	0.05
421	601375	中原证券	61,200	263,160.00	0.05
422	600751	海航科技	68,700	263,121.00	0.05
423	002110	三钢闽光	58,500	256,815.00	0.05
424	688029	南微医学	3,141	256,179.96	0.05
425	603169	兰石重装	24,000	255,840.00	0.05
426	002507	涪陵榨菜	19,800	255,618.00	0.05

427	603613	国联股份	9,100	254,800.00	0.05
428	000837	秦川机床	19,600	252,448.00	0.05
429	002518	科士达	5,200	252,304.00	0.05
430	002183	怡亚通	52,900	251,804.00	0.05
431	603693	江苏新能	21,200	251,432.00	0.05
432	601528	瑞丰银行	44,100	251,370.00	0.05
433	603809	豪能股份	17,500	251,125.00	0.05
434	301500	飞南资源	16,000	251,040.00	0.05
435	300327	中颖电子	8,900	249,467.00	0.05
436	688380	中微半导	7,704	247,683.60	0.05
437	002254	泰和新材	24,700	247,494.00	0.05
438	603283	赛腾股份	5,700	246,924.00	0.05
439	688348	昱能科技	4,897	246,759.83	0.05
440	688088	虹软科技	4,971	246,064.50	0.05
441	688206	概伦电子	7,055	245,725.65	0.05
442	000758	中色股份	36,600	243,024.00	0.05
443	000885	城发环境	17,700	242,844.00	0.05
444	300663	科蓝软件	13,700	241,668.00	0.05
445	600640	国脉文化	19,100	239,896.00	0.05
446	300573	兴齐眼药	3,400	238,986.00	0.05
447	300613	富瀚微	5,100	234,906.00	0.05
448	002906	华阳集团	7,600	232,408.00	0.05
449	300634	彩讯股份	9,200	232,116.00	0.05
450	600757	长江传媒	26,000	230,880.00	0.05
451	600446	金证股份	14,500	230,840.00	0.05
452	688200	华峰测控	1,205	229,191.00	0.05
453	002550	千红制药	28,900	227,154.00	0.05
454	600623	华谊集团	28,900	222,819.00	0.05
455	000828	东莞控股	20,400	219,504.00	0.05
456	600266	城建发展	42,000	212,940.00	0.04
457	002891	中宠股份	4,100	212,216.00	0.04
458	300188	国投智能	14,400	210,384.00	0.04
459	301153	中科江南	8,500	210,120.00	0.04
460	603236	移远通信	2,200	209,902.00	0.04
461	688177	百奥泰	8,898	205,899.72	0.04
462	603005	晶方科技	7,400	204,684.00	0.04
463	002675	东诚药业	14,800	203,352.00	0.04
464	002985	北摩高科	6,400	203,072.00	0.04
465	000719	中原传媒	17,100	201,096.00	0.04
466	603619	中曼石油	8,700	200,535.00	0.04
467	600744	华银电力	34,100	200,508.00	0.04
468	002127	南极电商	59,400	200,178.00	0.04
469	300777	中简科技	4,900	199,920.00	0.04

470	688516	奥特维	4,351	196,926.26	0.04
471	600867	通化东宝	23,800	194,446.00	0.04
472	002901	大博医疗	4,100	194,217.00	0.04
473	600618	氯碱化工	16,200	192,456.00	0.04
474	002416	爱施德	14,900	187,442.00	0.04
475	300229	拓尔思	9,400	187,060.00	0.04
476	600782	新钢股份	48,200	187,016.00	0.04
477	002572	索菲亚	13,600	185,096.00	0.04
478	301000	肇民科技	4,700	185,039.00	0.04
479	300953	震裕科技	1,100	184,822.00	0.04
480	002654	万润科技	13,100	184,317.00	0.04
481	688559	海目星	3,800	182,628.00	0.04
482	002003	伟星股份	17,200	182,320.00	0.04
483	002215	诺普信	16,800	177,912.00	0.04
484	603093	南华期货	9,100	177,359.00	0.04
485	000581	威孚高科	8,600	177,332.00	0.04
486	603612	索通发展	7,400	173,900.00	0.04
487	300618	寒锐钴业	3,800	171,798.00	0.04
488	600586	金晶科技	30,500	171,715.00	0.04
489	301035	润丰股份	2,500	170,025.00	0.04
490	300166	东方国信	16,600	169,652.00	0.04
491	002947	恒铭达	3,200	166,464.00	0.03
492	002408	齐翔腾达	34,100	166,408.00	0.03
493	002737	葵花药业	11,200	165,424.00	0.03
494	688630	芯碁微装	1,228	165,202.84	0.03
495	300910	瑞丰新材	2,900	163,995.00	0.03
496	002948	青岛银行	36,100	161,728.00	0.03
497	688007	光峰科技	8,689	161,354.73	0.03
498	600252	中恒集团	57,800	158,372.00	0.03
499	600269	赣粤高速	29,800	154,662.00	0.03
500	600595	中孚实业	19,300	151,505.00	0.03
501	002681	奋达科技	22,600	150,290.00	0.03
502	603083	剑桥科技	1,100	147,818.00	0.03
503	002617	露笑科技	18,200	147,420.00	0.03
504	688766	普冉股份	1,156	147,054.76	0.03
505	603300	海南华铁	18,600	146,010.00	0.03
506	603108	润达医疗	9,600	143,520.00	0.03
507	002101	广东鸿图	11,600	142,912.00	0.03
508	000791	甘肃能源	22,100	142,545.00	0.03
509	600480	凌云股份	11,400	140,106.00	0.03
510	002239	奥特佳	46,700	139,166.00	0.03
511	600361	创新新材	32,800	139,072.00	0.03
512	301177	迪阿股份	4,800	138,576.00	0.03

513	605376	博迁新材	2,100	137,340.00	0.03
514	600502	安徽建工	29,200	136,948.00	0.03
515	600771	广誉远	7,600	136,648.00	0.03
516	601636	旗滨集团	23,000	136,390.00	0.03
517	688658	悦康药业	5,965	134,868.65	0.03
518	002093	国脉科技	11,400	131,100.00	0.03
519	300655	晶瑞电材	8,100	130,653.00	0.03
520	688776	国光电气	1,289	129,853.86	0.03
521	000762	西藏矿业	4,900	128,723.00	0.03
522	688498	源杰科技	200	128,398.00	0.03
523	603229	奥翔药业	12,900	127,968.00	0.03
524	002053	云南能投	11,100	127,872.00	0.03
525	688696	极米科技	1,114	124,188.72	0.03
526	601718	际华集团	36,500	122,275.00	0.03
527	600531	豫光金铅	10,400	122,200.00	0.03
528	301565	中仑新材	5,000	120,700.00	0.03
529	002068	黑猫股份	13,600	119,952.00	0.02
530	600729	重庆百货	4,500	117,000.00	0.02
531	601519	大智慧	9,000	115,830.00	0.02
532	601137	博威合金	5,400	115,398.00	0.02
533	605009	豪悦护理	3,700	114,330.00	0.02
534	301031	中熔电气	1,000	112,190.00	0.02
535	002170	芭田股份	9,100	110,838.00	0.02
536	600662	外服控股	21,200	106,424.00	0.02
537	688016	心脉医疗	1,154	105,775.64	0.02
538	300226	上海钢联	4,200	105,504.00	0.02
539	300315	掌趣科技	21,200	104,728.00	0.02
540	300685	艾德生物	5,100	104,346.00	0.02
541	002176	江特电机	10,700	104,218.00	0.02
542	300170	汉得信息	5,200	98,384.00	0.02
543	600740	山西焦化	26,100	98,136.00	0.02
544	300406	九强生物	7,500	98,025.00	0.02
545	600285	羚锐制药	4,600	95,266.00	0.02
546	301004	嘉益股份	1,800	93,690.00	0.02
547	002077	大港股份	6,300	93,681.00	0.02
548	600012	皖通高速	6,300	93,366.00	0.02
549	688313	仕佳光子	1,050	93,219.00	0.02
550	000498	山东路桥	15,400	92,862.00	0.02
551	600129	太极集团	5,100	92,055.00	0.02
552	688612	威迈斯	2,791	92,019.27	0.02
553	300378	鼎捷数智	2,000	90,520.00	0.02
554	000012	南玻 A	20,200	89,486.00	0.02
555	001914	招商积余	8,300	88,644.00	0.02

556	300861	美畅股份	5,900	88,087.00	0.02
557	002635	安洁科技	6,200	85,932.00	0.02
558	603599	广信股份	7,300	83,804.00	0.02
559	301606	绿联科技	1,400	82,236.00	0.02
560	001339	智微智能	1,600	81,776.00	0.02
561	600728	佳都科技	12,200	81,496.00	0.02
562	600133	东湖高新	8,600	78,088.00	0.02
563	002965	祥鑫科技	1,900	77,292.00	0.02
564	300031	宝通科技	3,400	77,282.00	0.02
565	002777	久远银海	4,300	77,142.00	0.02
566	002275	桂林三金	5,300	74,730.00	0.02
567	000930	中粮科技	12,900	74,433.00	0.02
568	002761	浙江建投	8,600	73,702.00	0.02
569	002925	盈趣科技	4,300	72,842.00	0.02
570	688433	华曙高科	1,070	70,801.90	0.01
571	003039	顺控发展	4,300	68,499.00	0.01
572	002488	金固股份	7,600	66,804.00	0.01
573	300870	欧陆通	300	66,300.00	0.01
574	688439	振华风光	1,017	65,698.20	0.01
575	300181	佐力药业	4,000	64,640.00	0.01
576	300672	国科微	600	64,572.00	0.01
577	002690	美亚光电	3,000	61,710.00	0.01
578	002242	九阳股份	5,900	61,596.00	0.01
579	002847	盐津铺子	900	61,479.00	0.01
580	600557	康缘药业	4,200	59,262.00	0.01
581	300855	图南股份	1,800	58,140.00	0.01
582	300768	迪普科技	3,100	57,443.00	0.01
583	601595	上海电影	2,000	57,260.00	0.01
584	300224	正海磁材	3,700	57,202.00	0.01
585	600928	西安银行	15,400	56,980.00	0.01
586	300926	博俊科技	1,700	55,726.00	0.01
587	000589	贵州轮胎	9,700	50,246.00	0.01
588	600575	淮河能源	14,700	49,980.00	0.01
589	002978	安宁股份	1,500	49,575.00	0.01
590	601311	骆驼股份	5,300	48,601.00	0.01
591	603039	泛微网络	900	48,186.00	0.01
592	600639	浦东金桥	4,600	47,242.00	0.01
593	688106	金宏气体	2,407	47,153.13	0.01
594	002563	森马服饰	8,600	46,612.00	0.01
595	600664	哈药股份	13,100	45,195.00	0.01
596	300593	新雷能	1,500	44,640.00	0.01
597	605198	安德利	1,100	41,382.00	0.01
598	000880	潍柴重机	1,500	40,980.00	0.01

599	000028	国药一致	1,600	39,296.00	0.01
600	603360	百傲化学	1,200	38,664.00	0.01
601	301508	中机认检	1,200	37,512.00	0.01
602	002045	国光电器	2,500	35,425.00	0.01
603	301589	诺瓦星云	200	32,910.00	0.01
604	300357	我武生物	1,100	31,185.00	0.01
605	603713	密尔克卫	500	27,885.00	0.01
606	300284	苏交科	3,300	26,004.00	0.01
607	002987	京北方	1,200	25,836.00	0.01
608	300726	宏达电子	500	25,455.00	0.01
609	688586	江航装备	1,923	25,075.92	0.01
610	000156	华数传媒	3,300	24,981.00	0.01
611	600223	福瑞达	3,300	24,288.00	0.01
612	002364	中恒电气	900	23,796.00	0.00
613	002649	博彦科技	1,800	23,742.00	0.00
614	300809	华辰装备	600	22,842.00	0.00
615	000636	风华高科	1,100	17,908.00	0.00
616	600651	飞乐音响	2,200	16,038.00	0.00
617	600059	古越龙山	1,700	15,742.00	0.00
618	002705	新宝股份	1,100	15,686.00	0.00
619	002015	协鑫能科	1,500	14,925.00	0.00
620	300492	华图山鼎	200	14,860.00	0.00
621	688717	艾罗能源	200	12,320.00	0.00
622	601858	中国科传	600	10,890.00	0.00
623	600882	妙可蓝多	400	10,056.00	0.00
624	300678	中科信息	300	9,228.00	0.00
625	300666	江丰电子	100	9,200.00	0.00
626	002151	北斗星通	200	9,086.00	0.00
627	300638	广和通	300	8,892.00	0.00
628	300773	拉卡拉	300	8,544.00	0.00
629	300468	四方精创	200	7,766.00	0.00
630	601860	紫金银行	2,800	7,728.00	0.00
631	300075	数字政通	500	7,670.00	0.00
632	002221	东华能源	900	7,290.00	0.00
633	300337	银邦股份	400	6,204.00	0.00
634	300456	赛微电子	100	5,596.00	0.00
635	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00

8.3.2 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	300223	北京君正	10,000	1,060,400.00	0.22
2	600983	惠而浦	105,700	1,010,492.00	0.21
3	603132	金徽股份	63,700	934,479.00	0.19

4	002281	光迅科技	12,100	846,395.00	0.18
5	688512	慧智微	75,000	837,000.00	0.17
6	600288	大恒科技	54,400	814,912.00	0.17
7	300531	优博讯	42,000	757,680.00	0.16
8	301603	乔锋智能	9,900	749,430.00	0.16
9	600522	中天科技	40,800	739,296.00	0.15
10	600487	亨通光电	29,800	736,954.00	0.15
11	300435	中泰股份	32,700	726,594.00	0.15
12	688280	精进电动	82,450	717,315.00	0.15
13	300302	同有科技	39,000	707,460.00	0.15
14	002436	兴森科技	32,700	692,259.00	0.14
15	002474	榕基软件	69,400	684,284.00	0.14
16	600814	杭州解百	83,500	676,350.00	0.14
17	000531	穗恒运 A	102,000	653,820.00	0.14
18	300249	依米康	44,500	651,035.00	0.14
19	300285	国瓷材料	22,800	624,948.00	0.13
20	300129	泰胜风能	59,700	624,462.00	0.13
21	603697	有友食品	50,300	616,175.00	0.13
22	300677	英科医疗	14,900	579,610.00	0.12
23	300394	天孚通信	2,800	568,484.00	0.12
24	002157	正邦科技	174,900	566,676.00	0.12
25	002902	铭普光磁	24,100	546,829.00	0.11
26	300684	中石科技	10,400	511,888.00	0.11
27	688678	福立旺	20,600	498,108.00	0.10
28	301365	矩阵股份	20,600	491,104.00	0.10
29	001389	广合科技	6,000	489,780.00	0.10
30	002667	威领股份	37,200	486,948.00	0.10
31	600110	诺德股份	67,800	480,702.00	0.10
32	000566	海南海药	67,100	479,765.00	0.10
33	300604	长川科技	4,700	476,157.00	0.10
34	300502	新易盛	1,100	473,968.00	0.10
35	002787	华源控股	38,000	473,100.00	0.10
36	603163	圣晖集成	6,800	466,480.00	0.10
37	002984	森麒麟	22,000	465,740.00	0.10
38	600391	航发科技	12,500	463,750.00	0.10
39	600378	昊华科技	14,000	447,440.00	0.09
40	688661	和林微纳	8,238	426,398.88	0.09
41	000683	博源化工	56,600	421,104.00	0.09
42	002590	万安科技	27,900	418,500.00	0.09
43	603177	德创环保	37,200	414,036.00	0.09
44	605196	华通线缆	11,900	413,406.00	0.09
45	001258	立新能源	58,100	413,091.00	0.09
46	600602	云赛智联	22,100	413,049.00	0.09

47	002057	中钢天源	38,300	390,277.00	0.08
48	002133	广宇集团	114,700	388,833.00	0.08
49	300465	高伟达	18,900	380,457.00	0.08
50	600829	人民同泰	34,600	374,026.00	0.08
51	300018	中元股份	34,000	374,000.00	0.08
52	002624	完美世界	22,700	372,053.00	0.08
53	600549	厦门钨业	9,000	369,540.00	0.08
54	002153	石基信息	34,100	369,303.00	0.08
55	300487	蓝晓科技	5,900	364,325.00	0.08
56	603937	丽岛新材	29,300	351,307.00	0.07
57	002309	中利集团	102,800	348,492.00	0.07
58	300489	光智科技	6,700	340,360.00	0.07
59	688222	成都先导	14,413	337,984.85	0.07
60	600279	重庆港	61,400	335,244.00	0.07
61	002419	天虹股份	59,200	327,376.00	0.07
62	300074	华平股份	70,600	325,466.00	0.07
63	600970	中材国际	31,200	324,168.00	0.07
64	300358	楚天科技	33,100	324,049.00	0.07
65	000977	浪潮信息	4,800	319,680.00	0.07
66	300086	康芝药业	26,300	316,389.00	0.07
67	600676	交运股份	53,600	315,168.00	0.07
68	000657	中钨高新	11,300	313,123.00	0.06
69	002160	常铝股份	59,000	306,800.00	0.06
70	002225	濮耐股份	53,300	303,810.00	0.06
71	000823	超声电子	22,400	303,744.00	0.06
72	301086	鸿富瀚	2,700	302,103.00	0.06
73	603185	弘元绿能	9,900	301,950.00	0.06
74	002811	郑中设计	20,300	301,252.00	0.06
75	600326	西藏天路	27,000	297,810.00	0.06
76	603979	金诚信	3,900	296,985.00	0.06
77	002591	恒大高新	36,200	293,944.00	0.06
78	300149	睿智医药	30,600	292,536.00	0.06
79	002645	华宏科技	19,600	286,944.00	0.06
80	603596	伯特利	5,500	281,985.00	0.06
81	002246	北化股份	15,400	277,508.00	0.06
82	002602	世纪华通	16,200	276,372.00	0.06
83	300042	朗科科技	10,700	274,990.00	0.06
84	002300	太阳电缆	29,600	272,320.00	0.06
85	002632	道明光学	21,800	271,410.00	0.06
86	600725	云维股份	64,900	271,282.00	0.06
87	002459	晶澳科技	23,600	270,220.00	0.06
88	601933	永辉超市	56,600	265,454.00	0.06
89	002209	达意隆	16,400	264,368.00	0.05

90	600312	平高电气	15,100	261,985.00	0.05
91	002486	嘉麟杰	83,900	260,929.00	0.05
92	688322	奥比中光	2,899	259,953.33	0.05
93	002512	达华智能	41,700	259,791.00	0.05
94	002725	跃岭股份	15,200	256,880.00	0.05
95	002016	世荣兆业	44,400	256,632.00	0.05
96	688486	龙迅股份	3,450	256,369.50	0.05
97	301152	天力锂能	8,300	253,648.00	0.05
98	000534	万泽股份	11,500	253,000.00	0.05
99	300545	联得装备	8,200	251,658.00	0.05
100	603301	振德医疗	3,500	246,750.00	0.05
101	000993	闽东电力	20,500	245,590.00	0.05
102	000017	深中华 A	31,000	243,970.00	0.05
103	002491	通鼎互联	40,600	243,600.00	0.05
104	300267	尔康制药	70,800	241,428.00	0.05
105	600748	上实发展	44,200	239,564.00	0.05
106	001228	永泰运	9,100	238,784.00	0.05
107	605358	立昂微	6,800	236,776.00	0.05
108	300806	斯迪克	7,700	236,698.00	0.05
109	002905	金逸影视	20,800	235,040.00	0.05
110	002975	博杰股份	3,000	231,000.00	0.05
111	600962	国投中鲁	10,500	230,265.00	0.05
112	605577	龙版传媒	17,400	227,418.00	0.05
113	300920	润阳科技	4,900	225,743.00	0.05
114	301285	鸿日达	3,300	223,674.00	0.05
115	605277	新亚电子	10,100	222,200.00	0.05
116	000582	北部湾港	23,500	220,430.00	0.05
117	002044	美年健康	41,700	220,176.00	0.05
118	688488	艾迪药业	13,327	217,629.91	0.05
119	600078	澄星股份	22,500	215,775.00	0.04
120	688385	复旦微电	2,892	213,140.40	0.04
121	002846	英联股份	13,200	213,048.00	0.04
122	300191	潜能恒信	11,500	212,520.00	0.04
123	002748	世龙实业	16,400	211,724.00	0.04
124	301321	翰博高新	11,100	211,455.00	0.04
125	002858	力盛体育	13,900	208,500.00	0.04
126	001896	豫能控股	40,000	208,000.00	0.04
127	003030	祖名股份	10,200	205,938.00	0.04
128	688277	天智航	13,400	203,546.00	0.04
129	688387	信科移动	15,633	201,665.70	0.04
130	300959	线上线下	2,100	198,870.00	0.04
131	300551	古鳌科技	11,700	194,688.00	0.04
132	000421	南京公用	27,800	192,098.00	0.04

133	002830	名雕股份	9,800	191,100.00	0.04
134	300805	电声股份	18,100	190,955.00	0.04
135	002828	贝肯能源	17,900	190,814.00	0.04
136	603506	南都物业	14,600	190,676.00	0.04
137	300072	海新能科	40,400	185,840.00	0.04
138	600742	富维股份	18,500	185,000.00	0.04
139	600988	赤峰黄金	5,900	184,316.00	0.04
140	688392	骄成超声	1,624	182,212.80	0.04
141	603499	翔港科技	8,900	181,916.00	0.04
142	002273	水晶光电	7,200	180,864.00	0.04
143	002970	锐明技术	3,700	179,450.00	0.04
144	000852	石化机械	24,600	178,842.00	0.04
145	002522	浙江众成	30,900	174,276.00	0.04
146	002188	中天服务	28,400	172,672.00	0.04
147	688733	壹石通	5,945	172,286.10	0.04
148	002782	可立克	9,400	170,704.00	0.04
149	002942	新农股份	8,800	169,136.00	0.04
150	000415	渤海租赁	41,600	168,480.00	0.03
151	301607	富特科技	4,200	168,462.00	0.03
152	001267	汇绿生态	7,600	166,440.00	0.03
153	603172	万丰股份	9,300	165,540.00	0.03
154	000599	青岛双星	24,500	162,190.00	0.03
155	603396	金辰股份	4,800	161,040.00	0.03
156	688266	泽璟制药	1,736	160,927.20	0.03
157	000528	柳 工	13,400	159,058.00	0.03
158	300447	全信股份	8,700	157,296.00	0.03
159	002284	亚太股份	10,500	156,765.00	0.03
160	688701	卓锦股份	19,220	156,643.00	0.03
161	300696	爱乐达	4,800	153,168.00	0.03
162	600382	广东明珠	21,400	152,582.00	0.03
163	002255	海陆重工	12,000	151,440.00	0.03
164	002370	亚太药业	20,700	151,317.00	0.03
165	000798	中水渔业	14,100	149,178.00	0.03
166	002963	豪尔赛	9,900	147,312.00	0.03
167	001216	华瓷股份	8,600	147,146.00	0.03
168	600397	江钨装备	19,100	145,160.00	0.03
169	300671	富满微	4,400	140,316.00	0.03
170	603616	韩建河山	26,900	139,611.00	0.03
171	300567	精测电子	1,500	136,800.00	0.03
172	001376	百通能源	8,100	136,404.00	0.03
173	603977	国泰集团	9,500	132,050.00	0.03
174	688783	西安奕材	6,984	128,226.24	0.03
175	601226	华电科工	16,200	127,008.00	0.03

176	688651	盛邦安全	2,885	126,997.70	0.03
177	002760	凤形股份	5,800	125,918.00	0.03
178	002790	瑞尔特	14,900	125,011.00	0.03
179	603378	亚士创能	18,300	124,623.00	0.03
180	688236	春立医疗	5,406	123,689.28	0.03
181	002631	德尔未来	20,600	123,188.00	0.03
182	002333	罗普斯金	21,500	120,830.00	0.03
183	002198	嘉应制药	16,600	116,698.00	0.02
184	688802	沐曦股份	292	116,598.52	0.02
185	002348	高乐股份	20,000	115,000.00	0.02
186	002121	科陆电子	14,900	114,730.00	0.02
187	603061	金海通	800	112,320.00	0.02
188	300619	金银河	2,500	109,750.00	0.02
189	603818	曲美家居	30,000	108,300.00	0.02
190	600148	长春一东	5,300	103,721.00	0.02
191	600152	维科技术	14,100	102,930.00	0.02
192	605399	晨光新材	7,600	102,752.00	0.02
193	002931	锋龙股份	3,200	101,440.00	0.02
194	003007	直真科技	2,700	100,683.00	0.02
195	300395	菲利华	1,000	100,300.00	0.02
196	002483	润邦股份	13,900	99,246.00	0.02
197	002208	合肥城建	8,000	99,040.00	0.02
198	688765	禾元生物	1,862	97,978.44	0.02
199	000670	盈方微	13,100	96,678.00	0.02
200	300912	凯龙高科	5,800	95,700.00	0.02
201	002772	众兴菌业	6,500	94,835.00	0.02
202	300377	赢时胜	4,200	94,710.00	0.02
203	001280	中国铀业	2,052	93,950.08	0.02
204	300616	尚品宅配	6,700	93,331.00	0.02
205	000626	远大控股	11,700	92,781.00	0.02
206	603022	新通联	8,400	86,268.00	0.02
207	001322	箭牌家居	9,600	85,152.00	0.02
208	000952	广济药业	12,100	85,063.00	0.02
209	300299	富春股份	11,900	84,490.00	0.02
210	600067	冠城新材	19,900	82,585.00	0.02
211	603121	华培动力	3,900	82,524.00	0.02
212	300158	振东制药	14,000	81,340.00	0.02
213	300709	精研科技	1,700	80,172.00	0.02
214	002596	海南瑞泽	14,500	78,155.00	0.02
215	300466	赛摩智能	7,700	77,385.00	0.02
216	301656	联合动力	2,995	76,252.70	0.02
217	002793	罗欣药业	15,800	75,840.00	0.02
218	301100	风光股份	3,500	74,585.00	0.02

219	300735	光弘科技	3,000	74,580.00	0.02
220	300118	东方日升	5,000	73,300.00	0.02
221	002758	浙农股份	7,200	72,504.00	0.02
222	603969	银龙股份	7,100	71,781.00	0.01
223	000520	凤凰航运	14,800	71,632.00	0.01
224	601968	宝钢包装	12,900	68,886.00	0.01
225	300818	耐普矿机	1,800	68,166.00	0.01
226	603680	今创集团	4,400	67,804.00	0.01
227	000967	盈峰环境	9,200	67,528.00	0.01
228	600300	维维股份	19,200	67,392.00	0.01
229	000506	招金黄金	5,100	66,606.00	0.01
230	003031	中瓷电子	900	65,844.00	0.01
231	300973	立高食品	1,500	64,500.00	0.01
232	688759	必贝特	2,508	62,975.88	0.01
233	300909	汇创达	1,300	62,530.00	0.01
234	603810	丰山集团	3,900	62,283.00	0.01
235	000777	中核科技	2,400	62,040.00	0.01
236	300623	捷捷微电	2,200	59,774.00	0.01
237	300375	鹏翎股份	11,200	58,912.00	0.01
238	301150	中一科技	1,400	58,786.00	0.01
239	600758	辽宁能源	15,600	56,784.00	0.01
240	301163	宏德股份	2,100	56,259.00	0.01
241	300699	光威复材	1,400	55,244.00	0.01
242	605138	盛泰集团	7,900	54,984.00	0.01
243	603187	海容冷链	3,500	54,915.00	0.01
244	300270	中威电子	5,000	54,800.00	0.01
245	301107	瑜欣电子	1,900	53,656.00	0.01
246	600241	时代万恒	6,400	53,440.00	0.01
247	000959	首钢股份	10,900	53,410.00	0.01
248	605268	王力安防	4,900	52,283.00	0.01
249	600778	友好集团	7,700	51,359.00	0.01
250	002356	赫美集团	12,900	51,084.00	0.01
251	603188	亚邦股份	10,500	48,195.00	0.01
252	002950	奥美医疗	4,400	48,048.00	0.01
253	301183	东田微	300	46,527.00	0.01
254	688383	新益昌	593	46,414.11	0.01
255	601399	国机重装	9,600	45,888.00	0.01
256	301081	严牌股份	4,500	45,585.00	0.01
257	002114	罗平锌电	5,400	45,468.00	0.01
258	600558	大西洋	7,400	45,140.00	0.01
259	688729	屹唐股份	1,830	44,432.40	0.01
260	002671	龙泉股份	8,100	42,444.00	0.01
261	300043	星辉娱乐	7,500	42,375.00	0.01

262	000020	深华发 A	3,000	41,610.00	0.01
263	601011	宝泰隆	12,200	41,480.00	0.01
264	688790	昂瑞微	348	40,782.12	0.01
265	688120	华海清科	271	40,671.68	0.01
266	603701	德宏股份	2,000	40,320.00	0.01
267	002728	特一药业	3,600	39,060.00	0.01
268	300328	宜安科技	2,200	37,554.00	0.01
269	688599	天合光能	2,210	36,575.50	0.01
270	688135	利扬芯片	1,300	36,088.00	0.01
271	300765	新诺威	1,000	36,070.00	0.01
272	002412	汉森制药	5,600	35,896.00	0.01
273	000886	海南高速	5,100	34,986.00	0.01
274	000892	欢瑞世纪	5,000	34,900.00	0.01
275	688809	强一股份	170	34,562.70	0.01
276	002394	联发股份	2,100	33,306.00	0.01
277	002517	恺英网络	1,500	32,805.00	0.01
278	603155	新亚强	1,900	32,547.00	0.01
279	301191	菲菱科思	300	32,256.00	0.01
280	002589	瑞康医药	10,000	32,200.00	0.01
281	603002	宏昌电子	4,300	31,777.00	0.01
282	688148	芳源股份	3,600	31,572.00	0.01
283	001209	洪兴股份	1,500	31,290.00	0.01
284	000639	西王食品	9,400	31,114.00	0.01
285	002340	格林美	3,700	30,932.00	0.01
286	002444	巨星科技	900	30,618.00	0.01
287	300339	润和软件	600	29,700.00	0.01
288	301235	华康洁净	800	29,496.00	0.01
289	688496	清越科技	4,793	28,470.42	0.01
290	001359	平安电工	400	28,400.00	0.01
291	300340	科恒股份	2,200	27,104.00	0.01
292	300283	温州宏丰	3,500	26,355.00	0.01
293	300331	苏大维格	800	25,888.00	0.01
294	603568	伟明环保	1,000	25,380.00	0.01
295	600497	驰宏锌锗	3,400	24,854.00	0.01
296	300290	荣科科技	900	24,777.00	0.01
297	002552	宝鼎科技	1,500	24,765.00	0.01
298	600419	天润乳业	2,500	24,750.00	0.01
299	603800	洪田股份	500	24,385.00	0.01
300	600156	华升股份	2,500	20,650.00	0.00
301	002418	康盛股份	4,200	20,034.00	0.00
302	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
303	600212	绿能慧充	2,400	19,320.00	0.00
304	002627	三峡旅游	2,600	19,292.00	0.00

305	003003	天元股份	1,400	18,508.00	0.00
306	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
307	300436	广生堂	200	17,830.00	0.00
308	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
309	002638	勤上股份	5,600	17,304.00	0.00
310	001233	海安集团	333	17,276.04	0.00
311	300766	每日互动	500	16,385.00	0.00
312	601515	衢州东峰	3,800	16,340.00	0.00
313	300966	共同药业	800	15,752.00	0.00
314	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
315	300935	盈建科	480	14,563.20	0.00
316	002622	皓宸医疗	4,900	14,553.00	0.00
317	000011	深物业 A	1,600	14,416.00	0.00
318	600724	宁波富达	2,400	13,824.00	0.00
319	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
320	002753	永东股份	1,800	12,834.00	0.00
321	301667	纳百川	201	12,630.07	0.00
322	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
323	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
324	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
325	300948	冠中生态	500	10,845.00	0.00
326	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
327	688786	悦安新材	345	9,732.45	0.00
328	300092	科新机电	600	9,474.00	0.00
329	002137	实益达	1,100	9,438.00	0.00
330	601688	华泰证券	400	9,436.00	0.00
331	301168	通灵股份	200	9,340.00	0.00
332	002709	天赐材料	200	9,266.00	0.00
333	000968	蓝焰控股	1,400	9,254.00	0.00
334	300499	高澜股份	300	9,204.00	0.00
335	605299	舒华体育	800	9,192.00	0.00
336	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
337	002851	麦格米特	100	9,007.00	0.00
338	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
339	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
340	688410	山外山	539	8,068.83	0.00
341	603590	康辰药业	200	7,950.00	0.00
342	300100	双林股份	200	7,924.00	0.00
343	301066	万事利	400	7,876.00	0.00
344	301011	华立科技	300	7,707.00	0.00
345	603032	德新科技	400	7,664.00	0.00
346	300852	四会富仕	200	7,636.00	0.00
347	603380	易德龙	200	7,600.00	0.00

348	300497	富祥药业	500	7,555.00	0.00
349	603092	德力佳	135	7,514.10	0.00
350	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
351	688530	欧莱新材	439	7,217.16	0.00
352	301113	雅艺科技	300	7,176.00	0.00
353	603418	友升股份	120	7,087.20	0.00
354	688378	奥来德	256	6,988.80	0.00
355	688189	南新制药	861	6,862.17	0.00
356	603153	上海建科	400	6,800.00	0.00
357	301320	豪江智能	400	6,788.00	0.00
358	300513	恒实科技	700	6,643.00	0.00
359	603276	恒兴新材	400	6,640.00	0.00
360	001285	瑞立科密	118	6,617.44	0.00
361	301239	普瑞眼科	200	6,578.00	0.00
362	300478	杭州高新	200	6,460.00	0.00
363	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
364	002778	中晟高科	300	6,342.00	0.00
365	600099	林海股份	600	6,270.00	0.00
366	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
367	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
368	001206	依依股份	200	5,942.00	0.00
369	300073	当升科技	100	5,780.00	0.00
370	603067	振华股份	200	5,762.00	0.00
371	002825	纳尔股份	500	5,745.00	0.00
372	002775	文科股份	1,300	5,564.00	0.00
373	002712	思美传媒	1,000	5,560.00	0.00
374	301125	腾亚精工	300	5,514.00	0.00
375	600128	苏豪弘业	500	5,495.00	0.00
376	300836	佰奥智能	100	5,490.00	0.00
377	002805	丰元股份	300	5,319.00	0.00
378	688026	洁特生物	325	5,235.75	0.00
379	301367	瑞迈特	60	5,142.60	0.00
380	301372	科净源	200	5,072.00	0.00
381	603248	锡华科技	292	4,941.04	0.00
382	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
383	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
384	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
385	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
386	688550	瑞联新材	29	1,313.99	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300226	上海钢联	13,479,612.00	1.85
2	300602	飞荣达	12,223,108.77	1.68
3	688018	乐鑫科技	12,053,484.00	1.66
4	603197	保隆科技	10,913,721.25	1.50
5	688766	普冉股份	10,389,809.48	1.43
6	688362	甬矽电子	10,197,040.80	1.40
7	688270	臻镭科技	10,188,102.75	1.40
8	002245	蔚蓝锂芯	10,101,375.00	1.39
9	002815	崇达技术	9,744,932.00	1.34
10	300666	江丰电子	9,737,589.00	1.34
11	300827	上能电气	9,550,173.00	1.31
12	000881	中广核技	9,469,151.00	1.30
13	600114	东睦股份	9,362,006.00	1.29
14	688127	蓝特光学	9,219,506.21	1.27
15	600330	天通股份	9,187,657.00	1.26
16	301171	易点天下	9,172,374.00	1.26
17	300134	大富科技	9,032,057.00	1.24
18	600850	电科数字	9,026,960.87	1.24
19	300850	新强联	8,945,989.03	1.23
20	688208	道通科技	8,797,272.24	1.21

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300226	上海钢联	17,215,869.00	2.36
2	600301	华锡有色	13,124,458.20	1.80
3	688018	乐鑫科技	12,448,210.30	1.71
4	300602	飞荣达	12,375,281.00	1.70
5	600986	浙文互联	12,074,073.00	1.66
6	600961	株冶集团	12,028,917.28	1.65
7	600330	天通股份	11,921,577.00	1.64
8	688798	艾为电子	11,471,851.89	1.58
9	601869	长飞光纤	11,340,660.80	1.56
10	002815	崇达技术	11,264,342.10	1.55
11	300666	江丰电子	11,261,299.82	1.55
12	688270	臻镭科技	11,202,898.47	1.54
13	688123	聚辰股份	11,162,747.29	1.53
14	300244	迪安诊断	10,915,438.00	1.50
15	000881	中广核技	10,878,798.00	1.49
16	002249	大洋电机	10,795,533.00	1.48
17	000603	盛达资源	10,771,587.00	1.48
18	603118	共进股份	10,668,670.00	1.47
19	301377	鼎泰高科	10,510,845.00	1.44

20	301171	易点天下	10,425,525.00	1.43
----	--------	------	---------------	------

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。

8.4.3 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	4,412,464,475.25
卖出股票收入（成交）总额	4,785,651,089.27

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	11,739,869.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,739,869.61

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 1000 指数增强 A	3,523	45,829.07	39,684,045.95	24.58%	121,771,771.84	75.42%
中欧中证	4,333	47,842.17	20,836,555.10	10.05%	186,463,569.02	89.95%

1000 指数增强 C						
合计	7,856	46,939.40	60,520,601.05	16.41%	308,235,340.86	83.59%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧中证 1000 指数增强 A	143,576.36	0.09%
	中欧中证 1000 指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	143,576.36	0.04%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧中证 1000 指数增强 A	0
	中欧中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 1000 指数增强 A	0
	中欧中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 1000 指数增强 A	中欧中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 （2023 年 3 月 2 日） 基金份额总额	754,558,392.41	472,748,192.02
本报告期期初基金份额总额	493,022,296.27	250,773,978.68
本报告期基金总申购份额	237,971,994.28	1,196,888,710.97
减：本报告期基金总赎回份额	569,538,472.76	1,240,362,565.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	161,455,817.79	207,300,124.12

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2025 年 2 月 20 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去蒋伟担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2025 年 5 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘王銮担任托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 50,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 06 月 10 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券基金经营机构信息技术管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管局现场检查结束后，公司即成立整改小组，制定整改措施包括制度修订、人员培训宣导和强化内部检查等。针对涉及的

	问题，公司已按要求及时完成整改，并将整改报告报至上海监管局。
其他	无

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人基金托管业务部门未受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管业务高级管理人员未受调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
财通证券	3	3,377,775,649.63	36.74	551,865.10	36.81	-
招商证券	3	2,574,913,749.44	28.01	410,066.88	27.35	-
东莞证券	2	2,530,164,005.66	27.52	407,949.38	27.21	-
国泰海通	1	711,300,751.45	7.74	129,263.44	8.62	-

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

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

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)				的比例 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	95,524,000.00	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。

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
3	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别份额转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-03-12
6	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
8	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
9	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
11	中欧中证 1000 指数增强型证券投资	中国证监会指定媒介	2025-06-03

	基金基金产品资料概要更新		
12	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-03
13	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2025-06-06
14	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09
15	中欧中证 1000 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	2025-06-09
16	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2025-06-09
17	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 7 月）	中国证监会指定媒介	2025-07-08
18	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
19	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
20	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“华虹公司”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-08-20
21	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
22	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
23	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-10-18
24	中欧中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-10-28
25	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-10-28

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日至 2025	202,114,289.98	0.00	202,114,289.98	0.00	0.00 %

		年 03 月 18 日					
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 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 3 月 31 日