

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
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	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53

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	87
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
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	93
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	93
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	93
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	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.12 投资组合报告附注	94
§ 9 基金份额持有人信息	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	95
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	95
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	96
§ 10 开放式基金份额变动	96
§ 11 重大事件揭示	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
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	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	97
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	97
11.8 其他重大事件	102
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	103
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	103
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	104
§ 13 备查文件目录	104
13.1 备查文件目录	104
13.2 存放地点	104
13.3 查阅方式	104

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧数据挖掘混合	
基金主代码	001990	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 13 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	647,259,805.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
下属分级基金的交易代码	001990	004234
报告期末下属分级基金的份额总额	286,531,410.46 份	360,728,394.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，通过定量与定性相结合的方法精选个股，并适当运用股指期货对冲系统性风险，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	8、10、16 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	
	中欧数据 挖掘混合 A	中欧数据 挖掘混合 C	中欧数据 挖掘混合 A	中欧数据 挖掘混合 C	中欧数据 挖掘混合 A	中欧数据 挖掘混合 C
本期已实现收益	110,198,296.35	99,712,818.32	33,463,024.05	-2,041,968.48	20,524,495.12	25,497,277.04
本期利润	126,131,768.70	101,748,497.30	20,449,201.90	8,842,706.82	8,196,224.90	22,502,115.88
加权平均基金份额本期利润	0.6869	0.6466	0.1271	0.0666	-0.0444	-0.1241
本期加权平均净值利润率	34.21%	32.97%	8.68%	4.92%	-2.82%	-8.32%
本期基金份额净值增长率	41.35%	40.23%	12.09%	11.16%	-3.85%	-4.61%
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	310,490,054.43	335,597,022.62	76,302,249.60	28,780,914.33	41,553,576.21	25,635,901.52

期末可供分配基金份额利润	1.0836	0.9303	0.5125	0.4118	0.2283	0.1570
期末基金资产净值	674,272,116.90	790,145,604.18	247,870,177.99	109,179,354.94	270,360,526.82	229,410,795.25
期末基金份额净值	2.3532	2.1904	1.6648	1.5620	1.4852	1.4052
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	200.34%	161.21%	112.48%	86.27%	89.55%	67.57%

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

中欧数据挖掘混合 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	2.86%	1.00%	0.71%	1.18%	2.15%	-0.18%
过去六个月	24.83%	0.95%	24.71%	1.11%	0.12%	-0.16%
过去一年	41.35%	1.16%	28.69%	1.20%	12.66%	-0.04%
过去三年	52.35%	1.25%	26.53%	1.30%	25.82%	-0.05%
过去五年	42.73%	1.25%	17.37%	1.23%	25.36%	0.02%
自基金合同生效起至今	200.34%	1.25%	55.26%	1.12%	145.08%	0.13%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*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。

中欧数据挖掘混合 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	2.66%	1.00%	0.71%	1.18%	1.95%	-0.18%
过去六个月	24.33%	0.95%	24.71%	1.11%	-0.38%	-0.16%
过去一年	40.23%	1.16%	28.69%	1.20%	11.54%	-0.04%
过去三年	48.69%	1.25%	26.53%	1.30%	22.16%	-0.05%
过去五年	37.10%	1.25%	17.37%	1.23%	19.73%	0.02%
自基金份额起始 运作日至今	161.21%	1.28%	52.81%	1.16%	108.40 %	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*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

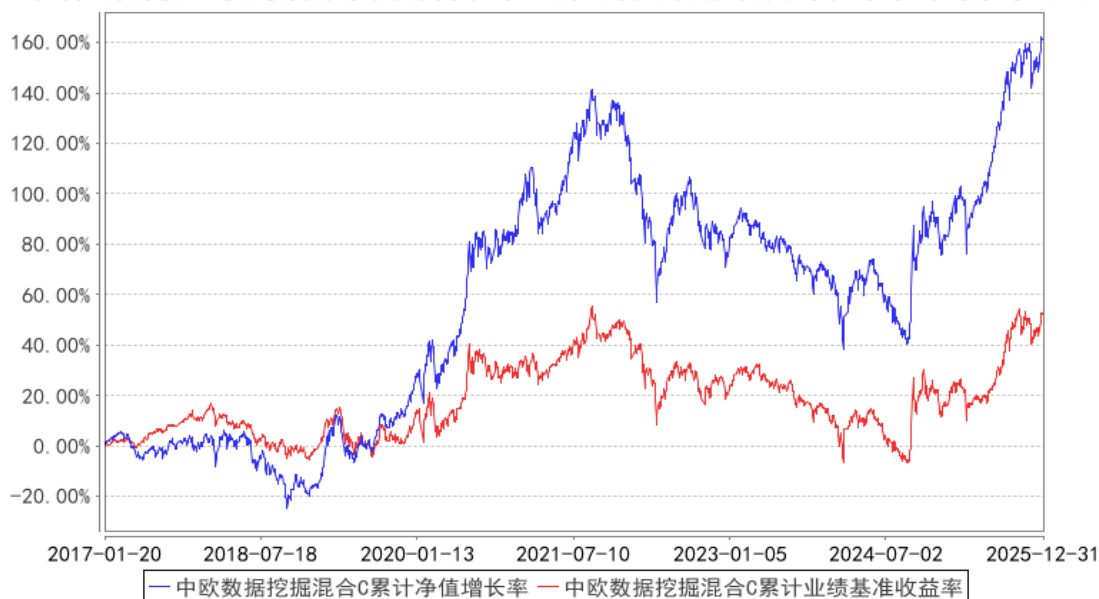


注：“2019 年 4 月 26 日组合业绩比较基准变更为中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率

*5%。

”

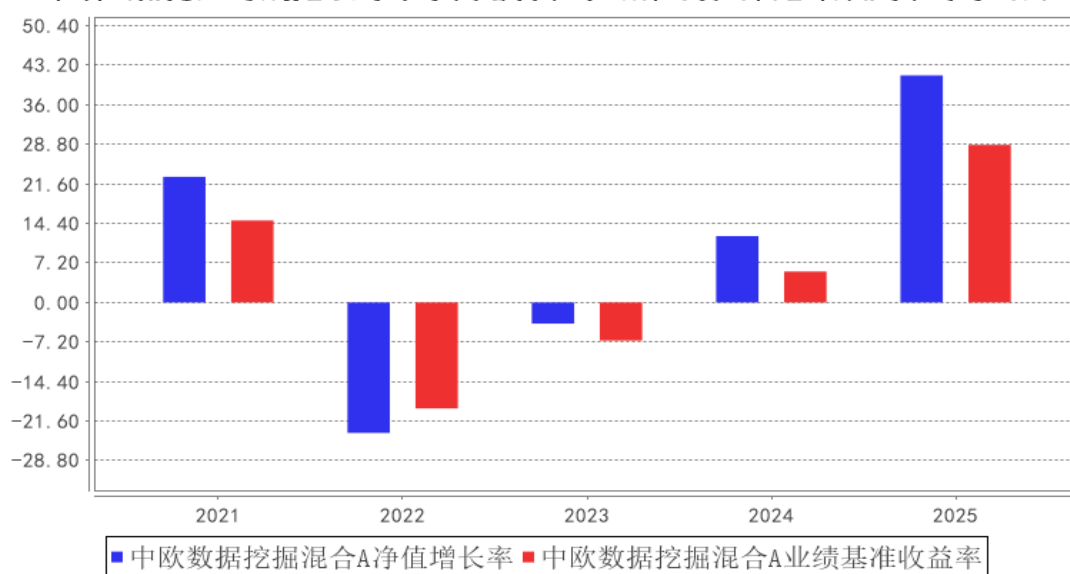
中欧数据挖掘混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

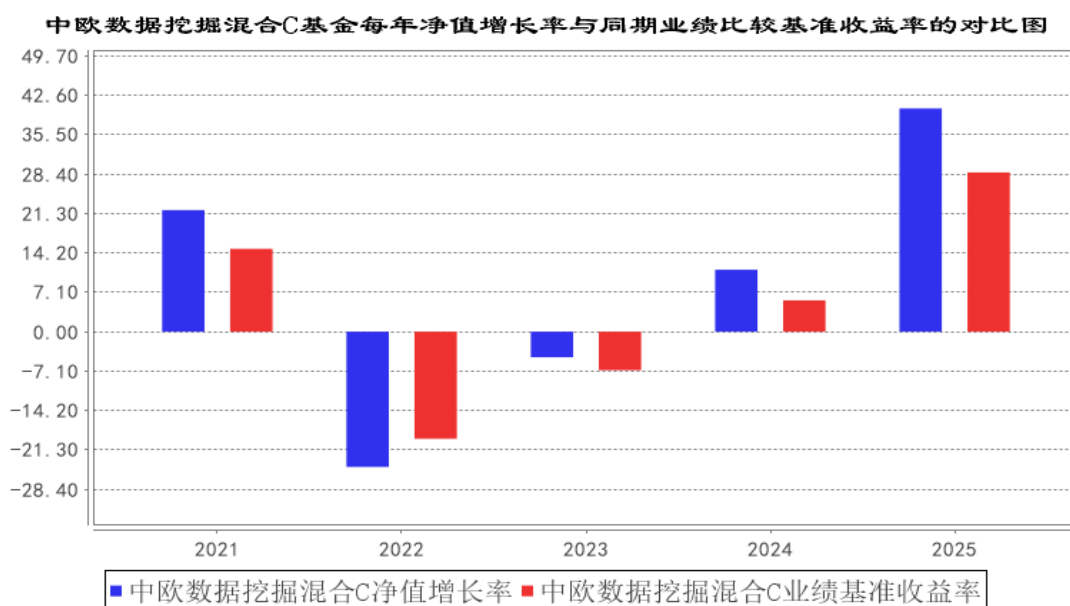


注：2019 年 4 月 26 日组合业绩比较基准变更为中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。自 2017 年 1 月 19 日起本基金增加 C 类份额，图示日期为 2017 年 1 月 20 日至 2025 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年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

中欧数据挖掘混合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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
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。
曲径	量化投决会主席 /	2016-01-13	-	18 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总

	权益专户 投决会委 员 / 量 化 投资总 监 / 基 金 经 理 / 投 资 经理				裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限 公司，历任权益投决会委员。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	8	3,658,259,096.31	2016-01-13
	私募资产管 理计划	2	1,897,837,115.02	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	5,556,096,211.33	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。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，涉及兼任的基金经理管理的多个组合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

2025 年对于 A 股市场而言，是挑战与机遇并存的一年。在全球经济复苏和国内政策调整的双重影响下，A 股市场经历波动但整体呈现稳健增长的态势。年初，受到全球疫情反复和地缘政治紧张的影响，市场情绪一度低迷，但随着国内经济逐步恢复，以及政策面的积极调整，市场逐渐回暖。特别是在科技创新、新能源、消费升级等领域，表现尤为突出。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，主要因子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。

在报告期内，本基金以中证 500 指数的行业配置为锚定，保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中盘平衡风格。基金利用基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成以中证 500 指数的风险特征为基准的投资组合，以追求达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对业绩比较基准指数的超额收益。

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 41.35%，同期业绩比较基准收益率为 28.69%；基金 C 类份额净值增长率为 40.23%，同期业绩比较基准收益率为 28.69%。

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 2026 年，作为“十五五”开局之年，A 股市场有望从估值扩张转向盈利修复驱动。全 A 非金融盈利增速回升，科技 AI 主线深化，但风格趋于均衡，成长与价值并重，结构性机会增多。我们预计市场高弹性和结构化并存，盈利改善、资本市场改革红利及全球资金配置再平衡支撑上涨，增量资金来自险资、公募、ETF 及外资回流。宏观政策积极有为，货币适度宽松、财政倾斜民生消费，助力增长动能增强，PPI 回暖、“反内卷”政策推进供需格局改善，下半年或成关键窗口，若 AI 爆款应用未现、美元走强，成长风格或调整，价值与周期接力。

2026 年 A 股市场将面临诸多机遇与挑战，我们将密切关注宏观经济走势、政策导向以及行业发展趋势，力争把握结构性投资机会的同时，也控制好组合的风险暴露，防范市场波动带来的风险。展望 2026 年，在经济温和复苏与政策托底并存的背景下，市场机会与风险并存，风格轮动可

能加快。我们借助基本面因子和量价因子的负相关性，持续挖掘数据特征规律，争取平衡高波动环境下的风险，力争让量化组合的超额收益更为平稳。

4.6 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规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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_B21 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	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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，后附的中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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，公允反映了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 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，我们独立于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金，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	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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数据挖掘多因子灵活配置混合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数据挖掘多因子灵活配置混合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，就可能导致对中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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数据挖掘多因子灵活配置混合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：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

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	118,079,991.31	49,579,707.33
结算备付金		19,285,689.46	6,605,389.90
存出保证金		1,763,701.89	3,173,809.93
交易性金融资产	7.4.7.2	1,370,622,036.17	303,804,236.53
其中：股票投资		1,330,380,830.69	302,079,653.60
基金投资		-	-
债券投资		40,241,205.48	1,724,582.93
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		16,333,319.68	342,640.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,526,084,738.51	363,505,784.19
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		36,008,354.87	-
应付清算款		21,338,161.61	4,573,499.06
应付赎回款		499,304.47	119,771.26
应付管理人报酬		1,245,080.87	366,822.15
应付托管费		207,513.49	61,137.03
应付销售服务费		435,022.94	75,566.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,933,579.18	1,259,454.99
负债合计		61,667,017.43	6,456,251.26
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	647,259,805.04	218,779,679.50
未分配利润	7.4.7.8	817,157,916.04	138,269,853.43
净资产合计		1,464,417,721.08	357,049,532.93
负债和净资产总计		1,526,084,738.51	363,505,784.19

注： 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 647,259,805.04 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 2.3532 元，基金份额总额 286,531,410.46 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 2.1904 元，基金份额总额 360,728,394.58 份。

7.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

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		239,941,569.86	36,783,146.64
1. 利息收入		278,029.53	207,998.58
其中：存款利息收入	7.4.7.9	278,029.53	207,742.46
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		-	256.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		220,927,513.38	38,572,026.25
其中：股票投资收益	7.4.7.10	205,770,145.73	29,312,928.31

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	107,715.29	8,581.97
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	5,464,271.62	-246,020.88
股利收益	7.4.7.14	9,585,380.74	9,496,536.85
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	17,969,151.33	-2,129,146.85
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	766,875.62	132,268.66
减：二、营业总支出		12,061,303.86	7,491,237.92
1. 管理人报酬		8,031,653.78	5,011,575.64
2. 托管费		1,338,609.00	835,262.53
3. 销售服务费		2,427,567.74	1,454,255.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		46,641.75	-
其中：卖出回购金融资 产支出		46,641.75	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		27,125.65	364.51
8. 其他费用	7.4.7.18	189,705.94	189,780.05
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		227,880,266.00	29,291,908.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		227,880,266.00	29,291,908.72
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		227,880,266.00	29,291,908.72

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

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	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93
二、本期期初净资产	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	428,480,125.54	-	678,888,062.61	1,107,368,188.15
(一)、综合收益总额	-	-	227,880,266.00	227,880,266.00
(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)	428,480,125.54	-	451,007,796.61	879,487,922.15
其中：1. 基金申购款	711,591,576.89	-	734,160,494.78	1,445,752,071.67
2. 基金赎回款	- 283,111,451.35	-	- 283,152,698.17	-566,264,149.52
(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	647,259,805.04	-	817,157,916.04	1,464,417,721.08
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	345,291,217.76	-	154,480,104.31	499,771,322.07
二、本期期初净资产	345,291,217.76	-	154,480,104.31	499,771,322.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 126,511,538.26	-	-16,210,250.88	-142,721,789.14
(一)、综合收益总额	-	-	29,291,908.72	29,291,908.72
(二)、本期基金	-	-	-45,502,159.60	-172,013,697.86

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	126,511,538.26			
其中：1. 基金申购款	125,919,098.42	-	68,287,000.77	194,206,099.19
2. 基金赎回款	- 252,430,636.68	-	- 113,789,160.37	-366,219,797.05
(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	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金（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[2015]2423 号文《关于准予中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 506,108,438.33 元。经向中国证监会备案，《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 506,409,681.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 301,243.65 基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2017 年 1 月 19 日起，本基金增设 C 类份额。

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) 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，A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；投资人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择分红方式；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日同一类别的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金同一类别的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。

7.4.5 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。

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	118,079,991.31	49,579,707.33
等于：本金	118,068,547.46	49,574,735.59
加：应计利息	11,443.85	4,971.74
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	118,079,991.31	49,579,707.33

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		1,323,017,503.29	-	1,330,380,830.69	7,363,327.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	39,997,720.00	233,205.48	40,241,205.48	10,280.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	39,997,720.00	233,205.48	40,241,205.48	10,280.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,363,015,223.29	233,205.48	1,370,622,036.17	7,373,607.40
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		311,163,047.53	-	302,079,653.60	-9,083,393.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,717,000.00	10,132.93	1,724,582.93	-2,550.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,717,000.00	10,132.93	1,724,582.93	-2,550.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		312,880,047.53	10,132.93	303,804,236.53	-9,085,943.93

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	12,318,120.00	-	-	-
其中： 股指期货 投资	12,318,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,318,120.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 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	25,832,720.00	-	-	-
其中： 股指期货	25,832,720.00	-	-	-

货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,832,720.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2603	IC2603	4.00	5,893,280.00	82,880.00
IC2606	IC2606	5.00	7,182,400.00	674,680.00
合计				757,560.00
减：可抵销期货暂收款				757,560.00
净额				0.00

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示

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	304.06	141.89
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,883,251.60	1,209,313.10
其中：交易所市场	1,883,251.60	1,209,313.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
应付转出费	23.52	-

合计	1,933,579.18	1,259,454.99
----	--------------	--------------

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧数据挖掘混合 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	148,884,540.64	148,884,540.64
本期申购	255,481,568.19	255,481,568.19
本期赎回（以“-”号填列）	-117,834,698.37	-117,834,698.37
本期末	286,531,410.46	286,531,410.46

中欧数据挖掘混合 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	69,895,138.86	69,895,138.86
本期申购	456,110,008.70	456,110,008.70
本期赎回（以“-”号填列）	-165,276,752.98	-165,276,752.98
本期末	360,728,394.58	360,728,394.58

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧数据挖掘混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	76,302,249.60	22,683,387.75	98,985,637.35
本期期初	76,302,249.60	22,683,387.75	98,985,637.35
本期利润	110,198,296.35	15,933,472.35	126,131,768.70
本期基金份额交易产生的变动数	123,989,508.48	38,633,791.91	162,623,300.39
其中：基金申购款	213,918,089.25	71,523,344.84	285,441,434.09
基金赎回款	-89,928,580.77	-32,889,552.93	-122,818,133.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	310,490,054.43	77,250,652.01	387,740,706.44

中欧数据挖掘混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,780,914.33	10,503,301.75	39,284,216.08
本期期初	28,780,914.33	10,503,301.75	39,284,216.08
本期利润	99,712,818.32	2,035,678.98	101,748,497.30
本期基金份额交易产生的变动数	207,103,289.97	81,281,206.25	288,384,496.22
其中：基金申购款	322,937,010.10	125,782,050.59	448,719,060.69
基金赎回款	-115,833,720.13	-44,500,844.34	-160,334,564.47

本期已分配利润	-	-	-
本期末	335,597,022.62	93,820,186.98	429,417,209.60

7.4.7.9 存款利息收入

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
活期存款利息收入	210,432.66	124,326.23
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	61,386.79	80,997.27
其他	6,210.08	2,418.96
合计	278,029.53	207,742.46

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	6,015,195,251.30	5,207,658,505.52
减：卖出股票成本总额	5,800,006,132.14	5,170,059,178.92
减：交易费用	9,418,973.43	8,286,398.29
买卖股票差价收入	205,770,145.73	29,312,928.31

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	124,715.29	8,581.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-17,000.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申	-	-

购差价收入		
合计	107,715.29	8,581.97

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	1,737,740.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,717,000.00	-
减：应计利息总额	37,740.00	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-17,000.00	-

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	5,464,271.62	-246,020.88

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	9,585,380.74	9,496,536.85
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	9,585,380.74	9,496,536.85
----	--------------	--------------

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	16,459,551.33	-1,444,666.85
股票投资	16,446,721.33	-1,442,116.85
债券投资	12,830.00	-2,550.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	1,509,600.00	-684,480.00
权证投资	-	-
期货投资	1,509,600.00	-684,480.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	17,969,151.33	-2,129,146.85

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	695,894.85	132,136.57
基金转换费收入	70,980.77	132.09
合计	766,875.62	132,268.66

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	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,616.00	1,310.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
开户费	-	400.00
存托服务费	89.94	70.05

合计	189,705.94	189,780.05
----	------------	------------

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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（%）
国都证券	182,480,277.77	1.42	364,478,480.53	3.56

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 （%）
国都证券	79,560.26	1.42	-	-
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 （%）
国都证券	198,977.37	3.96	-	-

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	8,031,653.78	5,011,575.64
其中：应支付销售机构的客户维 护费	1,982,400.76	890,042.39
应支付基金管理人的净管理费	6,049,253.02	4,121,533.25

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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	1,338,609.00	835,262.53

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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		
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	合计
工商银行	0.00	12,247.09	12,247.09
中欧财富	0.00	38,476.73	38,476.73
中欧基金	0.00	166,095.08	166,095.08
合计	0.00	216,818.90	216,818.90
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		
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	合计
工商银行	0.00	156.60	156.60
中欧财富	0.00	37,540.97	37,540.97
中欧基金	0.00	961,716.23	961,716.23
合计	0.00	999,413.80	999,413.80

注：本基金 A 基金份额不收取销售服务费，本基金 C 基金份额的年销售服务费费率为 0.80%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日

内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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

份额单位：份

中欧数据挖掘混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	1,473,058.01	0.51%	1,450,628.30	0.97%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明

书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 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
中国工商银行股份有限公司	118,079,991.31	210,432.66	49,579,707.33	124,326.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-

001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
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	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
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	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
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	-

301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股流通受限	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	5,685	70,948.80	144,740.10	-
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	146	6,815.28	8,126.36	-
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	139	6,444.04	8,209.34	-
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	2,022	17,085.90	49,094.16	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股流通受限	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688765	禾元生物	2025年10月16日	6个月	新股流通受限	29.06	52.62	3,529	102,552.74	185,695.98	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	新股流通受限	8.62	18.36	13,202	113,801.24	242,388.72	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月	新股流通受限	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-

688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	114.28	416.18	886	101,252.08	368,735.48	-
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	617	64,575.22	246,374.27	-
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	259	22,038.31	52,657.29	-

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	10,900	106,653.40	125,568.00	-

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 36,008,354.87 元，于 2026 年 1 月 5 日和 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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，将风险控制可在承受的范围之内。

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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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	118,079,991.31	-	-	-	118,079,991.31
结算备付金	19,285,689.46	-	-	-	19,285,689.46
存出保证金	194,620.29	-	-	1,569,081.60	1,763,701.89
交易性金融资产	40,241,205.48	-	-	1,330,380,830.69	1,370,622,036.17
应收申购款	-	-	-	16,333,319.68	16,333,319.68
资产总计	177,801,506.54	-	-	1,348,283,231.97	1,526,084,738.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	499,304.47	499,304.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,245,080.87	1,245,080.87
应付托管费	-	-	-	207,513.49	207,513.49
应付清算款	-	-	-	21,338,161.61	21,338,161.61
卖出回购金融资产款	36,008,354.87	-	-	-	36,008,354.87
应付销售服务费	-	-	-	435,022.94	435,022.94
其他负债	-	-	-	1,933,579.18	1,933,579.18
负债总计	36,008,354.87	-	-	25,658,662.56	61,667,017.43
利率敏感度缺口	141,793,151.67	-	-	1,322,624,569.41	1,464,417,721.08
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	49,579,707.33	-	-	-	49,579,707.33
结算备付金	6,605,389.90	-	-	-	6,605,389.90
存出保证金	164,128.33	-	-	3,009,681.60	3,173,809.93
交易性金融资产	1,724,582.93	-	-	302,079,653.60	303,804,236.53
应收申购款	-	-	-	342,640.50	342,640.50

资产总计	58,073,808.49	-	-	305,431,975.70	363,505,784.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	119,771.26	119,771.26
应付管理人报酬	-	-	-	366,822.15	366,822.15
应付托管费	-	-	-	61,137.03	61,137.03
应付清算款	-	-	-	4,573,499.06	4,573,499.06
应付销售服务费	-	-	-	75,566.77	75,566.77
其他负债	-	-	-	1,259,454.99	1,259,454.99
负债总计	-	-	-	6,456,251.26	6,456,251.26
利率敏感度缺口	58,073,808.49	-	-	298,975,724.44	357,049,532.93

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 2.75%（2024 年 12 月 31 日：0.48%），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	1,330,380,830.69	90.85	302,079,653.60	84.60

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,330,380,830.69	90.85	302,079,653.60	84.60

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%	59,711,355.74	17,336,943.77
	业绩比较基准下降 5%	-59,711,355.74	-17,336,943.77

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	1,328,388,227.06	300,955,303.73
第二层次	40,366,773.48	2,262,719.43
第三层次	1,867,035.63	586,213.37

合计	1,370,622,036.17	303,804,236.53
----	------------------	----------------

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	586,213.37	586,213.37
当期购买	0.00	799,847.04	799,847.04
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	586,213.37	586,213.37
当期利得或损失总额	0.00	1,067,188.59	1,067,188.59
其中：计入损益的利得或损失	0.00	1,067,188.59	1,067,188.59
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	1,867,035.63	1,867,035.63
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	1,067,188.59	1,067,188.59
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	1,063,105.02	1,063,105.02
当期购买	0.00	233,562.08	233,562.08

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	1,063,105.02	1,063,105.02
当期利得或损失总额	0.00	352,651.29	352,651.29
其中：计入损益的利得或损失	0.00	352,651.29	352,651.29
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	586,213.37	586,213.37
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	352,651.29	352,651.29

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	1,867,035.63	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	586,213.37	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	1,330,380,830.69	87.18
	其中：股票	1,330,380,830.69	87.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,241,205.48	2.64
	其中：债券	40,241,205.48	2.64
	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	137,365,680.77	9.00
8	其他各项资产	18,097,021.57	1.19
9	合计	1,526,084,738.51	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	6,813,909.00	0.47
B	采矿业	34,014,524.84	2.32
C	制造业	854,173,700.52	58.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,001,505.04	4.51
E	建筑业	21,645,990.69	1.48
F	批发和零售业	42,537,088.44	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	40,940,934.00	2.80
H	住宿和餐饮业	4,214,448.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,268,710.15	5.41
J	金融业	91,646,518.48	6.26

K	房地产业	22,449,774.40	1.53
L	租赁和商务服务业	16,521,419.88	1.13
M	科学研究和技术服务业	23,705,658.34	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	13,272,066.55	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,076,079.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,992,734.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	8,641,541.36	0.59
S	综合	1,464,228.00	0.10
	合计	1,330,380,830.69	90.85

8.2.2 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

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	601901	方正证券	1,253,900	9,780,420.00	0.67
2	600742	富维股份	954,900	9,549,000.00	0.65
3	600497	驰宏锌锗	1,306,000	9,546,860.00	0.65
4	600909	华安证券	1,343,000	9,105,540.00	0.62
5	601108	财通证券	1,021,600	8,908,352.00	0.61
6	000060	中金岭南	1,458,400	8,531,640.00	0.58
7	601555	东吴证券	825,890	7,482,563.40	0.51
8	601107	四川成渝	1,200,500	7,299,040.00	0.50
9	002624	完美世界	441,300	7,232,907.00	0.49
10	600098	广州发展	1,101,900	7,206,426.00	0.49
11	601117	中国化学	937,000	7,055,610.00	0.48
12	688512	慧智微	620,867	6,928,875.72	0.47
13	002299	圣农发展	409,500	6,773,130.00	0.46
14	600970	中材国际	644,500	6,696,355.00	0.46
15	002367	康力电梯	822,800	6,631,768.00	0.45
16	600795	国电电力	1,290,601	6,504,629.04	0.44
17	002436	兴森科技	304,800	6,452,616.00	0.44
18	600549	厦门钨业	151,900	6,237,014.00	0.43
19	600999	招商证券	360,500	5,998,720.00	0.41
20	688207	格灵深瞳	373,500	5,677,200.00	0.39
21	000683	博源化工	756,000	5,624,640.00	0.38
22	600739	辽宁成大	492,500	5,506,150.00	0.38
23	000598	兴蓉环境	764,800	5,483,616.00	0.37
24	600011	华能国际	721,600	5,383,136.00	0.37
25	600210	紫江企业	725,100	5,329,485.00	0.36

26	600428	中远海特	741,930	5,267,703.00	0.36
27	300134	大富科技	419,200	5,240,000.00	0.36
28	603500	祥和实业	435,900	5,222,082.00	0.36
29	000543	皖能电力	647,100	5,144,445.00	0.35
30	002984	森麒麟	242,200	5,127,374.00	0.35
31	300003	乐普医疗	324,300	5,127,183.00	0.35
32	600195	中牧股份	650,319	5,118,010.53	0.35
33	000415	渤海租赁	1,262,300	5,112,315.00	0.35
34	300098	高新兴	837,500	5,108,750.00	0.35
35	688327	云从科技	354,175	5,089,494.75	0.35
36	600027	华电国际	1,017,400	5,046,304.00	0.34
37	600061	国投资本	657,860	5,032,629.00	0.34
38	300079	数码视讯	926,900	4,995,991.00	0.34
39	002091	江苏国泰	551,700	4,981,851.00	0.34
40	601968	宝钢包装	926,700	4,948,578.00	0.34
41	300032	金龙机电	919,400	4,937,178.00	0.34
42	000582	北部湾港	522,900	4,904,802.00	0.33
43	002803	吉宏股份	299,500	4,899,820.00	0.33
44	601168	西部矿业	175,600	4,853,584.00	0.33
45	688410	山外山	319,308	4,780,040.76	0.33
46	600814	杭州解百	584,300	4,732,830.00	0.32
47	002414	高德红外	322,396	4,729,549.32	0.32
48	603969	银龙股份	461,400	4,664,754.00	0.32
49	600388	龙净环保	283,300	4,620,623.00	0.32
50	688321	微芯生物	157,200	4,593,384.00	0.31
51	688222	成都先导	194,350	4,557,507.50	0.31
52	600649	城投控股	1,001,708	4,457,600.60	0.30
53	600522	中天科技	242,600	4,395,912.00	0.30
54	300395	菲利华	43,100	4,322,930.00	0.30
55	002281	光迅科技	61,400	4,294,930.00	0.29
56	002590	万安科技	285,900	4,288,500.00	0.29
57	600487	亨通光电	172,700	4,270,871.00	0.29
58	688772	珠海冠宇	197,313	4,248,148.89	0.29
59	603596	伯特利	81,700	4,188,759.00	0.29
60	002340	格林美	493,300	4,123,988.00	0.28
61	603566	普莱柯	328,000	4,077,040.00	0.28
62	600166	福田汽车	1,394,300	4,071,356.00	0.28
63	600266	城建发展	799,800	4,054,986.00	0.28
64	688678	福立旺	166,900	4,035,642.00	0.28
65	300409	道氏技术	179,400	4,034,706.00	0.28
66	600300	维维股份	1,132,800	3,976,128.00	0.27
67	688373	盟科药业	657,800	3,973,112.00	0.27
68	688280	精进电动	448,380	3,900,906.00	0.27

69	603697	有友食品	318,000	3,895,500.00	0.27
70	600378	昊华科技	121,200	3,873,552.00	0.26
71	688182	灿勤科技	130,584	3,854,839.68	0.26
72	000923	河钢资源	180,400	3,819,068.00	0.26
73	600057	厦门象屿	446,804	3,806,770.08	0.26
74	600288	大恒科技	252,700	3,785,446.00	0.26
75	300144	宋城演艺	457,900	3,750,201.00	0.26
76	000531	穗恒运 A	584,200	3,744,722.00	0.26
77	300363	博腾股份	160,300	3,725,372.00	0.25
78	300604	长川科技	36,600	3,707,946.00	0.25
79	002558	巨人网络	85,000	3,679,650.00	0.25
80	300602	飞荣达	110,900	3,677,444.00	0.25
81	601128	常熟银行	518,853	3,652,725.12	0.25
82	000828	东莞控股	337,900	3,635,804.00	0.25
83	600030	中信证券	126,600	3,634,686.00	0.25
84	000726	鲁 泰 A	501,200	3,568,544.00	0.24
85	301110	青木科技	53,900	3,567,102.00	0.24
86	600312	平高电气	202,300	3,509,905.00	0.24
87	301230	泓博医药	117,400	3,506,738.00	0.24
88	688079	美迪凯	308,672	3,494,167.04	0.24
89	601058	赛轮轮胎	215,900	3,493,262.00	0.24
90	300168	万达信息	536,000	3,462,560.00	0.24
91	600761	安徽合力	163,600	3,417,604.00	0.23
92	300365	恒华科技	538,900	3,405,848.00	0.23
93	603328	依顿电子	308,700	3,383,352.00	0.23
94	002609	捷顺科技	363,700	3,378,773.00	0.23
95	002419	天虹股份	607,800	3,361,134.00	0.23
96	002626	金达威	168,200	3,315,222.00	0.23
97	688556	高测股份	283,300	3,235,286.00	0.22
98	301607	富特科技	80,520	3,229,657.20	0.22
99	600598	北大荒	215,200	3,217,240.00	0.22
100	002966	苏州银行	387,600	3,213,204.00	0.22
101	600546	山煤国际	317,800	3,206,602.00	0.22
102	601339	百隆东方	553,300	3,203,607.00	0.22
103	300286	安科瑞	138,600	3,198,888.00	0.22
104	600499	科达制造	230,500	3,197,035.00	0.22
105	300207	欣旺达	122,100	3,192,915.00	0.22
106	002736	国信证券	243,300	3,192,096.00	0.22
107	600469	风神股份	455,400	3,160,476.00	0.22
108	300502	新易盛	7,300	3,145,424.00	0.21
109	301603	乔锋智能	41,200	3,118,840.00	0.21
110	600352	浙江龙盛	290,900	3,100,994.00	0.21
111	002454	松芝股份	351,800	3,064,178.00	0.21

112	600262	北方股份	117,600	3,061,128.00	0.21
113	603766	隆鑫通用	189,400	3,051,234.00	0.21
114	600983	惠而浦	316,700	3,027,652.00	0.21
115	603505	金石资源	161,600	3,018,688.00	0.21
116	688700	东威科技	84,100	2,967,048.00	0.20
117	000899	赣能股份	298,100	2,951,190.00	0.20
118	002284	亚太股份	197,500	2,948,675.00	0.20
119	601963	重庆银行	270,600	2,930,598.00	0.20
120	688653	康希通信	239,925	2,915,088.75	0.20
121	002545	东方铁塔	157,100	2,898,495.00	0.20
122	603345	安井食品	36,400	2,885,792.00	0.20
123	000902	新洋丰	184,300	2,878,766.00	0.20
124	000887	中鼎股份	123,900	2,875,719.00	0.20
125	002532	天山铝业	175,200	2,834,736.00	0.19
126	002312	川发龙蟒	258,400	2,824,312.00	0.19
127	002258	利尔化学	215,300	2,809,665.00	0.19
128	300136	信维通信	45,100	2,796,200.00	0.19
129	601601	中国太保	66,500	2,787,015.00	0.19
130	601702	华峰铝业	135,600	2,775,732.00	0.19
131	002517	恺英网络	126,000	2,755,620.00	0.19
132	002222	福晶科技	48,600	2,738,124.00	0.19
133	688097	博众精工	72,368	2,731,892.00	0.19
134	300129	泰胜风能	258,600	2,704,956.00	0.18
135	603816	顾家家居	87,500	2,689,750.00	0.18
136	688127	蓝特光学	69,436	2,672,591.64	0.18
137	002787	华源控股	214,400	2,669,280.00	0.18
138	600282	南钢股份	506,700	2,665,242.00	0.18
139	002206	海利得	453,000	2,650,050.00	0.18
140	688153	唯捷创芯	69,943	2,632,654.52	0.18
141	600064	南京高科	300,200	2,605,736.00	0.18
142	300438	鹏辉能源	48,900	2,602,458.00	0.18
143	300041	回天新材	234,600	2,599,368.00	0.18
144	300206	理邦仪器	202,600	2,591,254.00	0.18
145	600415	小商品城	159,700	2,547,215.00	0.17
146	600850	电科数字	85,900	2,546,076.00	0.17
147	002245	蔚蓝锂芯	142,600	2,538,280.00	0.17
148	300285	国瓷材料	92,100	2,524,461.00	0.17
149	603889	新澳股份	317,200	2,521,740.00	0.17
150	002354	天娱数科	395,300	2,518,061.00	0.17
151	603306	华懋科技	39,900	2,514,099.00	0.17
152	300017	网宿科技	243,900	2,499,975.00	0.17
153	300303	聚飞光电	363,100	2,483,604.00	0.17
154	600039	四川路桥	247,900	2,466,605.00	0.17

155	300435	中泰股份	110,500	2,455,310.00	0.17
156	600901	江苏金租	397,333	2,431,677.96	0.17
157	300496	中科创达	35,800	2,416,500.00	0.17
158	000959	首钢股份	488,900	2,395,610.00	0.16
159	600662	外服控股	469,040	2,354,580.80	0.16
160	000657	中钨高新	84,700	2,347,037.00	0.16
161	301219	腾远钴业	34,100	2,328,348.00	0.16
162	603568	伟明环保	89,300	2,266,434.00	0.15
163	300416	苏试试验	126,800	2,262,112.00	0.15
164	002947	恒铭达	43,100	2,242,062.00	0.15
165	000738	航发控制	105,000	2,237,550.00	0.15
166	600435	北方导航	145,000	2,235,900.00	0.15
167	000528	柳 工	187,995	2,231,500.65	0.15
168	300567	精测电子	24,400	2,225,280.00	0.15
169	002156	通富微电	58,700	2,212,990.00	0.15
170	300257	开山股份	157,200	2,208,660.00	0.15
171	601156	东航物流	118,300	2,177,903.00	0.15
172	603172	万丰股份	122,000	2,171,600.00	0.15
173	600298	安琪酵母	49,500	2,165,130.00	0.15
174	300394	天孚通信	10,600	2,152,118.00	0.15
175	603588	高能环境	277,700	2,143,844.00	0.15
176	300620	光库科技	14,300	2,102,815.00	0.14
177	600754	锦江酒店	82,600	2,087,302.00	0.14
178	000591	太阳能	457,700	2,032,188.00	0.14
179	002508	老板电器	104,800	2,027,880.00	0.14
180	300532	今天国际	171,600	2,021,448.00	0.14
181	003031	中瓷电子	27,600	2,019,216.00	0.14
182	601918	新集能源	302,200	1,997,542.00	0.14
183	002204	大连重工	259,400	1,984,410.00	0.14
184	002483	润邦股份	275,000	1,963,500.00	0.13
185	300925	法本信息	92,100	1,956,204.00	0.13
186	600391	航发科技	52,700	1,955,170.00	0.13
187	002967	广电计量	88,800	1,954,488.00	0.13
188	300149	睿智医药	204,100	1,951,196.00	0.13
189	000823	超声电子	143,700	1,948,572.00	0.13
190	300042	朗科科技	75,800	1,948,060.00	0.13
191	605589	圣泉集团	68,300	1,932,890.00	0.13
192	301526	国际复材	275,200	1,926,400.00	0.13
193	002225	濮耐股份	337,900	1,926,030.00	0.13
194	600873	梅花生物	189,900	1,923,687.00	0.13
195	002645	华宏科技	130,200	1,906,128.00	0.13
196	603187	海容冷链	121,400	1,904,766.00	0.13
197	002157	正邦科技	585,800	1,897,992.00	0.13

198	300018	中元股份	172,100	1,893,100.00	0.13
199	002016	世荣兆业	327,300	1,891,794.00	0.13
200	600335	国机汽车	290,400	1,890,504.00	0.13
201	300223	北京君正	17,800	1,887,512.00	0.13
202	002039	黔源电力	103,700	1,884,229.00	0.13
203	002273	水晶光电	73,400	1,843,808.00	0.13
204	002793	罗欣药业	383,300	1,839,840.00	0.13
205	300221	银禧科技	178,100	1,837,992.00	0.13
206	300236	上海新阳	28,500	1,817,160.00	0.12
207	000878	云南铜业	88,000	1,804,880.00	0.12
208	600389	江山股份	71,383	1,804,562.24	0.12
209	601198	东兴证券	129,300	1,794,684.00	0.12
210	300140	节能环保	263,900	1,786,603.00	0.12
211	600115	中国东航	295,800	1,774,800.00	0.12
212	002755	奥赛康	107,800	1,760,374.00	0.12
213	002858	力盛体育	117,300	1,759,500.00	0.12
214	601717	中创智领	71,000	1,743,050.00	0.12
215	603569	长久物流	226,600	1,733,490.00	0.12
216	300739	明阳电路	94,300	1,733,234.00	0.12
217	300531	优博讯	96,000	1,731,840.00	0.12
218	002203	海亮股份	136,600	1,729,356.00	0.12
219	603799	华友钴业	25,300	1,726,978.00	0.12
220	002448	中原内配	133,000	1,719,690.00	0.12
221	000733	振华科技	32,700	1,713,807.00	0.12
222	601991	大唐发电	488,800	1,705,912.00	0.12
223	000975	山金国际	70,000	1,703,100.00	0.12
224	600933	爱柯迪	84,600	1,700,460.00	0.12
225	300861	美畅股份	112,400	1,678,132.00	0.11
226	300747	锐科激光	61,900	1,673,157.00	0.11
227	002913	奥士康	39,100	1,671,134.00	0.11
228	600066	宇通客车	51,100	1,670,970.00	0.11
229	688319	欧林生物	65,500	1,661,080.00	0.11
230	600830	香溢融通	173,400	1,659,438.00	0.11
231	000933	神火股份	60,300	1,656,441.00	0.11
232	600496	精工钢构	398,700	1,654,605.00	0.11
233	688385	复旦微电	22,446	1,654,270.20	0.11
234	603915	国茂股份	89,200	1,642,172.00	0.11
235	600628	新世界	206,900	1,626,234.00	0.11
236	002533	金杯电工	130,100	1,623,648.00	0.11
237	300088	长信科技	266,500	1,614,990.00	0.11
238	600787	中储股份	285,700	1,605,634.00	0.11
239	000990	诚志股份	202,400	1,603,008.00	0.11
240	603022	新通联	155,900	1,601,093.00	0.11

241	300073	当升科技	27,700	1,601,060.00	0.11
242	600219	南山铝业	297,300	1,599,474.00	0.11
243	688800	瑞可达	19,196	1,593,268.00	0.11
244	000893	亚钾国际	33,200	1,592,604.00	0.11
245	002246	北化股份	88,300	1,591,166.00	0.11
246	000338	潍柴动力	92,400	1,589,280.00	0.11
247	601066	中信建投	59,100	1,582,107.00	0.11
248	002133	广宇集团	466,200	1,580,418.00	0.11
249	002811	郑中设计	106,400	1,578,976.00	0.11
250	605020	永和股份	58,700	1,578,443.00	0.11
251	603027	千禾味业	160,200	1,574,766.00	0.11
252	000967	盈峰环境	214,500	1,574,430.00	0.11
253	002484	江海股份	53,000	1,574,100.00	0.11
254	002668	TCL 智家	151,300	1,570,494.00	0.11
255	002701	奥瑞金	263,800	1,569,610.00	0.11
256	601208	东材科技	57,900	1,568,511.00	0.11
257	002926	华西证券	168,600	1,564,608.00	0.11
258	300138	晨光生物	125,500	1,557,455.00	0.11
259	000030	富奥股份	270,800	1,554,392.00	0.11
260	301193	家联科技	72,000	1,553,040.00	0.11
261	002111	威海广泰	147,300	1,549,596.00	0.11
262	002004	华邦健康	322,000	1,539,160.00	0.11
263	300487	蓝晓科技	24,900	1,537,575.00	0.10
264	300146	汤臣倍健	128,000	1,537,280.00	0.10
265	300570	太辰光	13,300	1,536,815.00	0.10
266	601318	中国平安	22,400	1,532,160.00	0.10
267	000601	韶能股份	324,800	1,526,560.00	0.10
268	600279	重庆港	278,700	1,521,702.00	0.10
269	300505	川金诺	67,900	1,520,281.00	0.10
270	002452	长高电新	184,000	1,514,320.00	0.10
271	300450	先导智能	30,200	1,509,396.00	0.10
272	002182	宝武镁业	98,500	1,507,050.00	0.10
273	000050	深天马 A	166,800	1,506,204.00	0.10
274	003030	祖名股份	74,600	1,506,174.00	0.10
275	300684	中石科技	30,500	1,501,210.00	0.10
276	600704	物产中大	268,200	1,493,874.00	0.10
277	002487	大金重工	28,700	1,490,391.00	0.10
278	002055	ST 得润	220,400	1,485,496.00	0.10
279	000426	兴业银锡	41,700	1,484,520.00	0.10
280	600988	赤峰黄金	47,500	1,483,900.00	0.10
281	688220	翱捷科技	17,900	1,478,719.00	0.10
282	301106	骏成科技	49,600	1,476,592.00	0.10
283	000600	建投能源	172,500	1,471,425.00	0.10

284	688689	银河微电	51,412	1,459,072.56	0.10
285	002830	名雕股份	73,400	1,431,300.00	0.10
286	300919	中伟股份	30,500	1,413,065.00	0.10
287	300824	北鼎股份	124,750	1,410,922.50	0.10
288	600100	同方股份	157,700	1,406,684.00	0.10
289	000039	中集集团	138,700	1,399,483.00	0.10
290	603218	日月股份	105,600	1,399,200.00	0.10
291	600863	内蒙华电	311,400	1,395,072.00	0.10
292	002223	鱼跃医疗	36,500	1,394,665.00	0.10
293	300231	银信科技	131,000	1,379,430.00	0.09
294	000404	长虹华意	203,600	1,378,372.00	0.09
295	300735	光弘科技	55,400	1,377,244.00	0.09
296	603979	金诚信	18,000	1,370,700.00	0.09
297	002389	航天彩虹	56,900	1,364,462.00	0.09
298	600558	大西洋	223,300	1,362,130.00	0.09
299	301626	苏州天脉	7,300	1,359,990.00	0.09
300	300171	东富龙	86,500	1,358,050.00	0.09
301	601083	锦江航运	121,300	1,353,708.00	0.09
302	600998	九州通	263,300	1,348,096.00	0.09
303	002627	三峡旅游	181,500	1,346,730.00	0.09
304	002738	中矿资源	17,100	1,343,205.00	0.09
305	601801	皖新传媒	202,792	1,334,371.36	0.09
306	600459	贵研铂业	71,300	1,326,893.00	0.09
307	000783	长江证券	162,200	1,321,930.00	0.09
308	001301	尚太科技	15,400	1,321,474.00	0.09
309	000421	南京公用	190,100	1,313,591.00	0.09
310	000811	冰轮环境	70,800	1,311,216.00	0.09
311	688609	九联科技	128,216	1,309,085.36	0.09
312	002357	富临运业	121,900	1,306,768.00	0.09
313	300644	南京聚隆	35,100	1,295,541.00	0.09
314	301026	浩通科技	45,700	1,295,138.00	0.09
315	600673	东阳光	57,500	1,289,725.00	0.09
316	603379	三美股份	21,200	1,287,264.00	0.09
317	603111	康尼机电	187,600	1,285,060.00	0.09
318	300806	斯迪克	41,700	1,281,858.00	0.09
319	300249	依米康	87,600	1,281,588.00	0.09
320	001389	广合科技	15,600	1,273,428.00	0.09
321	603063	禾望电气	38,400	1,269,888.00	0.09
322	600817	宇通重工	111,599	1,268,880.63	0.09
323	600578	京能电力	247,700	1,263,270.00	0.09
324	300072	海新能科	274,600	1,263,160.00	0.09
325	000729	燕京啤酒	112,200	1,260,006.00	0.09
326	600517	国网英大	209,400	1,258,494.00	0.09

327	300691	联合光电	72,800	1,257,256.00	0.09
328	603129	春风动力	4,500	1,254,060.00	0.09
329	600060	海信视像	51,600	1,252,848.00	0.09
330	688202	美迪西	22,200	1,252,080.00	0.09
331	002057	中钢天源	122,600	1,249,294.00	0.09
332	300857	协创数据	7,400	1,248,232.00	0.09
333	688639	华恒生物	38,166	1,243,448.28	0.08
334	300765	新诺威	34,400	1,240,808.00	0.08
335	688661	和林微纳	23,963	1,240,324.88	0.08
336	000680	山推股份	103,600	1,240,092.00	0.08
337	002758	浙农股份	122,200	1,230,554.00	0.08
338	603338	浙江鼎力	21,600	1,223,424.00	0.08
339	002902	铭普光磁	53,900	1,222,991.00	0.08
340	000928	中钢国际	184,500	1,219,545.00	0.08
341	002353	杰瑞股份	17,200	1,218,276.00	0.08
342	001228	永泰运	46,000	1,207,040.00	0.08
343	601126	四方股份	40,100	1,206,208.00	0.08
344	688352	顾中科技	95,600	1,205,516.00	0.08
345	688526	科前生物	78,845	1,203,174.70	0.08
346	002468	申通快递	89,600	1,202,432.00	0.08
347	603298	杭叉集团	45,000	1,195,650.00	0.08
348	300034	钢研高纳	60,900	1,192,422.00	0.08
349	600848	上海临港	101,500	1,187,550.00	0.08
350	300119	瑞普生物	63,200	1,186,264.00	0.08
351	002824	和胜股份	61,000	1,183,400.00	0.08
352	600419	天润乳业	119,500	1,183,050.00	0.08
353	688001	华兴源创	39,150	1,181,547.00	0.08
354	688779	五矿新能	156,875	1,174,993.75	0.08
355	603797	联泰环保	249,500	1,165,165.00	0.08
356	002023	海特高新	85,900	1,163,086.00	0.08
357	002152	广电运通	84,200	1,162,802.00	0.08
358	600686	金龙汽车	65,100	1,154,874.00	0.08
359	600888	新疆众和	140,700	1,152,333.00	0.08
360	002318	久立特材	39,700	1,149,315.00	0.08
361	600866	星湖科技	165,000	1,146,750.00	0.08
362	300375	鹏翎股份	218,000	1,146,680.00	0.08
363	300447	全信股份	63,400	1,146,272.00	0.08
364	002160	常铝股份	218,135	1,134,302.00	0.08
365	301236	软通动力	23,900	1,133,577.00	0.08
366	300232	洲明科技	159,800	1,132,982.00	0.08
367	002632	道明光学	90,900	1,131,705.00	0.08
368	002970	锐明技术	23,300	1,130,050.00	0.08
369	603506	南都物业	86,300	1,127,078.00	0.08

370	600096	云天化	33,500	1,119,235.00	0.08
371	300779	惠城环保	8,600	1,118,946.00	0.08
372	301365	矩阵股份	46,900	1,118,096.00	0.08
373	300643	万通智控	57,300	1,113,912.00	0.08
374	002188	中天服务	183,000	1,112,640.00	0.08
375	002521	齐峰新材	133,600	1,111,552.00	0.08
376	301086	鸿富瀚	9,900	1,107,711.00	0.08
377	002725	跃岭股份	65,400	1,105,260.00	0.08
378	300677	英科医疗	28,200	1,096,980.00	0.07
379	600643	爱建集团	198,300	1,096,599.00	0.07
380	601899	紫金矿业	31,800	1,096,146.00	0.07
381	002434	万里扬	114,700	1,093,091.00	0.07
382	002486	嘉麟杰	351,200	1,092,232.00	0.07
383	688150	莱特光电	40,374	1,091,309.22	0.07
384	301285	鸿日达	16,100	1,091,258.00	0.07
385	688488	艾迪药业	66,600	1,087,578.00	0.07
386	002491	通鼎互联	179,600	1,077,600.00	0.07
387	000555	神州信息	65,100	1,077,405.00	0.07
388	688561	奇安信	30,200	1,074,516.00	0.07
389	603808	歌力思	125,900	1,072,668.00	0.07
390	688048	长光华芯	8,528	1,068,984.80	0.07
391	601061	中信金属	73,700	1,061,280.00	0.07
392	603136	天目湖	89,900	1,059,022.00	0.07
393	600382	广东明珠	148,400	1,058,092.00	0.07
394	002671	龙泉股份	201,900	1,057,956.00	0.07
395	603681	永冠新材	55,700	1,057,186.00	0.07
396	002595	豪迈科技	12,500	1,056,375.00	0.07
397	688120	华海清科	7,022	1,053,861.76	0.07
398	603132	金徽股份	71,800	1,053,306.00	0.07
399	300012	华测检测	77,400	1,048,770.00	0.07
400	300302	同有科技	57,500	1,043,050.00	0.07
401	603937	丽岛新材	86,800	1,040,732.00	0.07
402	300263	隆华科技	117,200	1,036,048.00	0.07
403	300428	立中集团	44,000	1,027,400.00	0.07
404	300083	创世纪	111,500	1,026,915.00	0.07
405	301107	瑜欣电子	36,040	1,017,769.60	0.07
406	600155	华创云信	153,000	1,012,860.00	0.07
407	603341	龙旗科技	23,900	1,010,014.00	0.07
408	688005	容百科技	28,491	1,008,581.40	0.07
409	001260	坤泰股份	50,000	1,006,000.00	0.07
410	002745	木林森	104,800	1,002,936.00	0.07
411	002643	万润股份	66,800	1,001,332.00	0.07
412	600230	沧州大化	65,200	994,952.00	0.07

413	002556	辉隆股份	163,900	989,956.00	0.07
414	600392	盛和资源	45,600	981,768.00	0.07
415	001216	华瓷股份	57,100	976,981.00	0.07
416	601319	中国人保	109,100	976,445.00	0.07
417	600258	首旅酒店	58,200	974,850.00	0.07
418	002470	金正大	547,400	974,372.00	0.07
419	002159	三特索道	62,900	964,257.00	0.07
420	002593	日上集团	162,600	960,966.00	0.07
421	002394	联发股份	60,400	957,944.00	0.07
422	300244	迪安诊断	60,200	954,170.00	0.07
423	002782	可立克	52,400	951,584.00	0.06
424	002056	横店东磁	48,400	943,800.00	0.06
425	002125	湘潭电化	66,600	943,056.00	0.06
426	301163	宏德股份	35,200	943,008.00	0.06
427	603657	春光科技	31,500	938,700.00	0.06
428	300191	潜能恒信	50,000	924,000.00	0.06
429	600189	泉阳泉	133,400	921,794.00	0.06
430	000100	TCL 科技	202,200	917,988.00	0.06
431	603929	亚翔集成	9,600	916,800.00	0.06
432	300818	耐普矿机	24,200	916,454.00	0.06
433	002255	海陆重工	72,600	916,212.00	0.06
434	300627	华测导航	26,200	914,642.00	0.06
435	600067	冠城新材	220,200	913,830.00	0.06
436	601665	齐鲁银行	158,900	912,086.00	0.06
437	300036	超图软件	50,200	911,632.00	0.06
438	300386	飞天诚信	50,300	908,418.00	0.06
439	601399	国机重装	189,900	907,722.00	0.06
440	001359	平安电工	12,784	907,664.00	0.06
441	300400	劲拓股份	45,700	904,860.00	0.06
442	605268	王力安防	84,800	904,816.00	0.06
443	002293	罗莱生活	88,100	904,787.00	0.06
444	002442	龙星科技	145,300	902,313.00	0.06
445	002008	大族激光	21,900	902,061.00	0.06
446	300296	利亚德	142,400	899,968.00	0.06
447	603269	海鸥股份	68,700	899,283.00	0.06
448	002836	新宏泽	59,800	895,804.00	0.06
449	301205	联特科技	5,300	893,103.00	0.06
450	688209	英集芯	44,726	891,836.44	0.06
451	002588	史丹利	89,200	890,216.00	0.06
452	688107	安路科技	32,750	890,145.00	0.06
453	300389	艾比森	54,800	889,404.00	0.06
454	002603	以岭药业	52,100	889,347.00	0.06
455	002444	巨星科技	26,100	887,922.00	0.06

456	300616	尚品宅配	63,500	884,555.00	0.06
457	600966	博汇纸业	129,500	884,485.00	0.06
458	600176	中国巨石	51,300	877,230.00	0.06
459	603499	翔港科技	42,800	874,832.00	0.06
460	300596	利安隆	20,400	861,084.00	0.06
461	600962	国投中鲁	39,100	857,463.00	0.06
462	600455	博通股份	32,900	854,413.00	0.06
463	300054	鼎龙股份	22,700	853,520.00	0.06
464	601336	新华保险	12,200	850,340.00	0.06
465	002303	美盈森	210,500	848,315.00	0.06
466	300319	麦捷科技	71,700	838,173.00	0.06
467	002324	普利特	52,400	837,876.00	0.06
468	002968	新大正	68,780	836,364.80	0.06
469	300973	立高食品	19,400	834,200.00	0.06
470	603701	德宏股份	41,200	830,592.00	0.06
471	002939	长城证券	81,400	830,280.00	0.06
472	002423	中粮资本	70,900	829,530.00	0.06
473	603309	维力医疗	61,030	829,397.70	0.06
474	000977	浪潮信息	12,400	825,840.00	0.06
475	600642	申能股份	105,800	823,124.00	0.06
476	300196	长海股份	56,500	822,640.00	0.06
477	000957	中通客车	72,000	822,240.00	0.06
478	002960	青鸟消防	78,000	819,780.00	0.06
479	301326	捷邦科技	7,500	818,700.00	0.06
480	002244	滨江集团	81,400	818,070.00	0.06
481	002075	沙钢股份	141,600	814,200.00	0.06
482	000987	越秀资本	99,600	810,744.00	0.06
483	002373	千方科技	68,800	809,776.00	0.06
484	600356	恒丰纸业	91,100	799,858.00	0.05
485	603150	万朗磁塑	21,000	797,580.00	0.05
486	002828	贝肯能源	74,800	797,368.00	0.05
487	300682	朗新集团	52,300	795,483.00	0.05
488	301286	侨源股份	18,800	795,052.00	0.05
489	002849	威星智能	50,000	795,000.00	0.05
490	603313	梦百合	88,960	791,744.00	0.05
491	600785	新华百货	58,400	791,320.00	0.05
492	688550	瑞联新材	17,400	788,394.00	0.05
493	301081	严牌股份	77,400	784,062.00	0.05
494	000059	华锦股份	146,500	783,775.00	0.05
495	300304	云意电气	67,200	782,208.00	0.05
496	601577	长沙银行	80,500	780,850.00	0.05
497	002376	新北洋	100,953	779,357.16	0.05
498	688387	信科移动	60,341	778,398.90	0.05

499	002488	金固股份	88,300	776,157.00	0.05
500	688618	三旺通信	28,939	771,513.74	0.05
501	300791	仙乐健康	29,800	770,628.00	0.05
502	601211	国泰海通	37,500	770,625.00	0.05
503	003003	天元股份	57,800	764,116.00	0.05
504	300619	金银河	17,400	763,860.00	0.05
505	002080	中材科技	21,000	763,140.00	0.05
506	688525	佰维存储	6,623	760,254.17	0.05
507	301170	锡南科技	27,200	760,240.00	0.05
508	000155	川能动力	65,000	757,250.00	0.05
509	603920	世运电路	15,600	755,196.00	0.05
510	688565	力源科技	67,188	751,833.72	0.05
511	603166	福达股份	47,800	750,460.00	0.05
512	002993	奥海科技	17,100	747,441.00	0.05
513	300590	移为通信	58,600	743,048.00	0.05
514	688636	智明达	17,338	742,759.92	0.05
515	600884	杉杉股份	54,900	741,699.00	0.05
516	002998	优彩资源	97,800	738,390.00	0.05
517	002748	世龙实业	57,100	737,161.00	0.05
518	002372	伟星新材	70,400	734,272.00	0.05
519	301509	金凯生科	21,700	733,026.00	0.05
520	605056	咸亨国际	44,400	732,600.00	0.05
521	603317	天味食品	58,500	732,420.00	0.05
522	300308	中际旭创	1,200	732,000.00	0.05
523	002429	兆驰股份	98,500	730,870.00	0.05
524	001218	丽臣实业	32,000	728,960.00	0.05
525	600583	海油工程	132,700	728,523.00	0.05
526	002027	分众传媒	98,800	728,156.00	0.05
527	600101	明星电力	78,300	724,275.00	0.05
528	300037	新宙邦	13,800	723,120.00	0.05
529	603177	德创环保	64,400	716,772.00	0.05
530	002772	众兴菌业	49,000	714,910.00	0.05
531	002790	瑞尔特	85,200	714,828.00	0.05
532	301321	翰博高新	37,300	710,565.00	0.05
533	301191	菲菱科思	6,600	709,632.00	0.05
534	688208	道通科技	19,197	706,449.60	0.05
535	002534	西子洁能	42,062	705,379.74	0.05
536	000767	晋控电力	250,600	701,680.00	0.05
536	601226	华电科工	89,500	701,680.00	0.05
537	002161	远望谷	95,700	699,567.00	0.05
538	600026	中远海能	59,700	697,296.00	0.05
539	301338	凯格精机	7,900	696,069.00	0.05
540	000993	闽东电力	58,100	696,038.00	0.05

541	688179	阿拉丁	55,700	695,693.00	0.05
542	603031	安孚科技	15,700	695,510.00	0.05
543	300956	英力股份	41,500	690,560.00	0.05
544	600353	旭光电子	42,800	689,936.00	0.05
545	001203	大中矿业	22,500	689,625.00	0.05
546	301381	赛维时代	33,300	685,647.00	0.05
547	600710	苏美达	62,900	679,949.00	0.05
548	002555	三七互娱	28,800	679,680.00	0.05
549	300509	新美星	52,900	679,236.00	0.05
550	301152	天力锂能	22,200	678,432.00	0.05
551	688148	芳源股份	77,190	676,956.30	0.05
552	300959	线上线下	7,100	672,370.00	0.05
553	601688	华泰证券	28,500	672,315.00	0.05
554	603699	纽威股份	12,900	670,413.00	0.05
555	688709	成都华微	14,576	670,350.24	0.05
556	688311	盟升电子	14,642	667,675.20	0.05
557	002237	恒邦股份	49,600	665,632.00	0.05
558	300145	南方泵业	139,400	657,968.00	0.04
559	600968	海油发展	169,100	649,344.00	0.04
560	300835	龙磁科技	9,900	649,242.00	0.04
561	300787	海能实业	54,980	646,015.00	0.04
562	300283	温州宏丰	85,500	643,815.00	0.04
563	605305	中际联合	15,393	641,272.38	0.04
564	301571	国科天成	11,100	640,248.00	0.04
565	300358	楚天科技	65,300	639,287.00	0.04
566	688322	奥比中光	7,106	637,195.02	0.04
567	000791	甘肃能源	98,500	635,325.00	0.04
568	300545	联得装备	20,700	635,283.00	0.04
569	603061	金海通	4,500	631,800.00	0.04
570	688277	天智航	41,550	631,144.50	0.04
571	603977	国泰集团	45,300	629,670.00	0.04
572	300382	斯莱克	40,400	628,624.00	0.04
573	603380	易德龙	16,500	627,000.00	0.04
574	601069	西部黄金	23,500	626,980.00	0.04
575	000623	吉林敖东	31,800	621,054.00	0.04
576	603126	中材节能	92,100	618,912.00	0.04
577	002044	美年健康	115,300	608,784.00	0.04
578	603456	九洲药业	33,900	606,810.00	0.04
579	300340	科恒股份	49,200	606,144.00	0.04
580	600801	华新建材	24,700	606,138.00	0.04
581	300390	天华新能	11,000	600,710.00	0.04
582	300418	昆仑万维	14,400	600,480.00	0.04
583	000792	盐湖股份	21,300	599,808.00	0.04

584	002474	榕基软件	60,600	597,516.00	0.04
585	605277	新亚电子	27,100	596,200.00	0.04
586	601615	明阳智能	41,100	595,128.00	0.04
587	301358	湖南裕能	9,200	594,872.00	0.04
588	301161	唯万密封	15,700	594,402.00	0.04
589	000852	石化机械	81,700	593,959.00	0.04
590	002461	珠江啤酒	63,800	592,702.00	0.04
591	600961	株冶集团	36,800	592,480.00	0.04
592	600179	安通控股	106,700	588,984.00	0.04
593	002837	英维克	5,500	587,895.00	0.04
594	000655	金岭矿业	61,800	587,100.00	0.04
595	603185	弘元绿能	19,232	586,576.00	0.04
596	300489	光智科技	11,500	584,200.00	0.04
597	688219	会通股份	46,993	583,653.06	0.04
598	300132	青松股份	67,000	583,570.00	0.04
599	688651	盛邦安全	13,147	578,730.94	0.04
600	600125	铁龙物流	89,600	577,024.00	0.04
601	600212	绿能慧充	71,600	576,380.00	0.04
602	600778	友好集团	86,200	574,954.00	0.04
603	601958	金钼股份	36,900	574,902.00	0.04
604	002014	永新股份	48,200	574,544.00	0.04
605	603109	神驰机电	22,200	572,538.00	0.04
606	688347	华虹公司	5,300	571,711.00	0.04
607	300299	富春股份	79,900	567,290.00	0.04
608	300346	南大光电	13,200	566,280.00	0.04
609	600160	巨化股份	14,700	564,774.00	0.04
610	002846	英联股份	34,800	561,672.00	0.04
611	002155	湖南黄金	26,600	560,994.00	0.04
612	603182	嘉华股份	35,200	556,864.00	0.04
613	600859	王府井	35,800	555,974.00	0.04
614	002430	杭氧股份	18,600	555,582.00	0.04
615	002975	博杰股份	7,200	554,400.00	0.04
616	301468	博盈特焊	10,600	554,168.00	0.04
617	603810	丰山集团	34,700	554,159.00	0.04
618	300920	润阳科技	12,000	552,840.00	0.04
619	600829	人民同泰	51,100	552,391.00	0.04
620	002314	南山控股	192,800	549,480.00	0.04
621	300040	九洲集团	91,100	548,422.00	0.04
622	600114	东睦股份	17,900	546,845.00	0.04
623	000755	山西高速	108,800	546,176.00	0.04
624	002602	世纪华通	31,800	542,508.00	0.04
625	688396	华润微	10,240	541,286.40	0.04
626	002392	北京利尔	72,100	539,308.00	0.04

627	002011	盾安环境	42,500	538,900.00	0.04
628	688599	天合光能	32,500	537,875.00	0.04
629	002695	煌上煌	45,600	535,344.00	0.04
630	301235	华康洁净	14,487	534,135.69	0.04
631	605016	百龙创园	24,700	533,520.00	0.04
632	002300	太阳电缆	57,900	532,680.00	0.04
633	002612	朗姿股份	26,000	531,440.00	0.04
634	600869	远东股份	65,800	529,690.00	0.04
635	603289	泰瑞机器	52,200	528,264.00	0.04
636	600236	桂冠电力	67,400	527,742.00	0.04
637	002398	垒知集团	93,700	526,594.00	0.04
638	600725	云维股份	125,500	524,590.00	0.04
639	605018	长华集团	45,300	524,574.00	0.04
640	601872	招商轮船	58,400	524,432.00	0.04
641	688003	天准科技	8,896	523,974.40	0.04
642	600478	科力远	76,000	523,640.00	0.04
643	002063	远光软件	86,100	522,627.00	0.04
644	300850	新强联	12,500	517,125.00	0.04
645	301059	金三江	40,900	515,340.00	0.04
646	300219	鸿利智汇	71,100	512,631.00	0.04
647	000011	深物业 A	56,800	511,768.00	0.03
648	600500	中化国际	130,300	510,776.00	0.03
649	000951	中国重汽	30,200	510,380.00	0.03
650	301459	丰茂股份	11,500	510,370.00	0.03
651	002577	雷柏科技	28,600	509,366.00	0.03
652	600012	皖通高速	34,300	508,326.00	0.03
653	603127	昭衍新药	14,500	507,645.00	0.03
654	688176	亚虹医药	44,100	507,591.00	0.03
655	002153	石基信息	46,800	506,844.00	0.03
656	688819	天能股份	15,233	506,040.26	0.03
657	688548	广钢气体	34,759	505,395.86	0.03
658	688595	芯海科技	15,300	501,840.00	0.03
659	601007	金陵饭店	64,000	499,840.00	0.03
660	600982	宁波能源	114,900	498,666.00	0.03
661	002348	高乐股份	86,500	497,375.00	0.03
662	603659	璞泰来	18,100	494,854.00	0.03
663	300408	三环集团	10,700	489,525.00	0.03
664	300942	易瑞生物	51,900	488,379.00	0.03
665	688267	中触媒	17,255	486,073.35	0.03
666	000690	宝新能源	114,700	480,593.00	0.03
667	603887	城地香江	35,500	479,960.00	0.03
668	603238	诺邦股份	27,200	479,264.00	0.03
669	688062	迈威生物	12,400	477,028.00	0.03

670	300898	熊猫乳品	17,700	476,661.00	0.03
671	002412	汉森制药	74,200	475,622.00	0.03
672	688584	上海合晶	21,658	475,176.52	0.03
673	300131	英唐智控	32,300	473,518.00	0.03
674	001696	宗申动力	21,700	470,673.00	0.03
675	688312	燕麦科技	14,169	470,127.42	0.03
676	000960	锡业股份	16,800	468,384.00	0.03
677	600784	鲁银投资	67,000	467,660.00	0.03
678	688108	赛诺医疗	24,200	465,608.00	0.03
679	002516	旷达科技	70,400	463,936.00	0.03
680	603008	喜临门	22,600	462,848.00	0.03
681	603739	蔚蓝生物	32,700	462,705.00	0.03
682	603725	天安新材	49,700	459,725.00	0.03
683	300726	宏达电子	9,000	458,190.00	0.03
684	300700	岱勒新材	37,100	458,185.00	0.03
685	002912	中新赛克	15,200	458,128.00	0.03
686	688009	中国通号	83,614	457,368.58	0.03
687	603787	新日股份	32,500	456,950.00	0.03
688	300347	泰格医药	8,000	453,600.00	0.03
689	300696	爱乐达	14,200	453,122.00	0.03
690	001319	铭科精技	16,400	450,508.00	0.03
691	002402	和而泰	11,500	449,880.00	0.03
692	000798	中水渔业	42,500	449,650.00	0.03
693	300952	恒辉安防	11,000	449,570.00	0.03
694	001896	豫能控股	86,300	448,760.00	0.03
695	600177	雅戈尔	59,000	448,400.00	0.03
696	002334	英威腾	49,600	447,392.00	0.03
697	605060	联德股份	12,100	447,216.00	0.03
698	002356	赫美集团	112,900	447,084.00	0.03
699	002561	徐家汇	50,800	446,024.00	0.03
700	603115	海星股份	23,700	443,427.00	0.03
701	301511	德福科技	12,300	440,217.00	0.03
702	688309	恒誉环保	18,224	439,745.12	0.03
703	603871	嘉友国际	31,400	438,030.00	0.03
704	002942	新农股份	22,700	436,294.00	0.03
705	002185	华天科技	39,700	435,509.00	0.03
706	603045	福达合金	22,100	434,265.00	0.03
707	002117	东港股份	31,400	433,634.00	0.03
708	688135	利扬芯片	15,600	433,056.00	0.03
709	300143	盈康生命	43,500	429,780.00	0.03
710	688728	格科微	28,700	428,778.00	0.03
711	603035	常熟汽饰	27,700	428,519.00	0.03
712	601857	中国石油	41,100	427,851.00	0.03

713	605138	盛泰集团	61,300	426,648.00	0.03
714	600595	中孚实业	54,200	425,470.00	0.03
715	300709	精研科技	9,000	424,440.00	0.03
716	600716	凤凰股份	109,600	424,152.00	0.03
717	300048	合康新能	70,900	421,855.00	0.03
718	688597	煜邦电力	51,130	419,777.30	0.03
719	603818	曲美家居	116,100	419,121.00	0.03
720	000728	国元证券	49,900	416,665.00	0.03
721	601019	山东出版	48,100	415,584.00	0.03
722	600676	交运股份	70,600	415,128.00	0.03
723	300101	振芯科技	14,600	415,078.00	0.03
724	301108	洁雅股份	12,400	412,424.00	0.03
725	600897	厦门空港	23,900	411,080.00	0.03
726	601778	晶科科技	110,100	409,572.00	0.03
727	601869	长飞光纤	3,500	407,260.00	0.03
728	688429	时创能源	31,100	407,099.00	0.03
729	000020	深华发 A	29,200	405,004.00	0.03
730	002625	光启技术	8,300	404,708.00	0.03
731	002731	萃华珠宝	32,200	404,432.00	0.03
732	002895	川恒股份	11,000	403,260.00	0.03
733	002345	潮宏基	32,200	402,500.00	0.03
734	600188	兖矿能源	30,600	402,390.00	0.03
735	301283	聚胶股份	8,400	401,352.00	0.03
736	000017	深中华 A	50,600	398,222.00	0.03
737	688362	甬矽电子	12,246	396,892.86	0.03
738	688255	凯尔达	10,825	396,519.75	0.03
739	002137	实益达	46,200	396,396.00	0.03
740	300577	开润股份	18,500	395,345.00	0.03
741	300601	康泰生物	26,700	394,359.00	0.03
742	301611	珂玛科技	4,600	394,358.00	0.03
743	603466	风语筑	42,000	393,120.00	0.03
744	600299	安迪苏	43,700	391,989.00	0.03
745	002271	东方雨虹	28,800	391,392.00	0.03
746	002309	中利集团	114,900	389,511.00	0.03
747	000529	广弘控股	64,800	389,448.00	0.03
748	301183	东田微	2,500	387,725.00	0.03
749	603365	XD 水星家	18,400	387,136.00	0.03
750	688021	奥福科技	21,048	386,230.80	0.03
751	002963	豪尔赛	25,800	383,904.00	0.03
752	300745	欣锐科技	14,900	383,824.00	0.03
753	000886	海南高速	55,300	379,358.00	0.03
754	000800	一汽解放	55,900	379,002.00	0.03
755	600380	健康元	32,700	377,685.00	0.03

756	001202	炬申股份	23,700	375,882.00	0.03
757	688558	国盛智科	12,978	375,453.54	0.03
758	000065	北方国际	30,100	375,046.00	0.03
759	688392	骄成超声	3,340	374,748.00	0.03
760	000778	新兴铸管	88,800	371,184.00	0.03
761	002270	华明装备	14,800	370,592.00	0.03
762	603037	凯众股份	25,600	370,176.00	0.03
763	600724	宁波富达	64,200	369,792.00	0.03
764	688795	摩尔线程	886	368,735.48	0.03
765	600638	新黄浦	56,900	368,143.00	0.03
766	002922	伊戈尔	12,000	367,440.00	0.03
767	300984	金沃股份	4,300	364,984.00	0.02
768	688598	金博股份	12,400	364,064.00	0.02
769	688026	洁特生物	22,593	363,973.23	0.02
770	600331	宏达股份	28,400	363,236.00	0.02
771	301073	君亭酒店	13,900	362,234.00	0.02
772	601298	青岛港	43,200	360,288.00	0.02
773	300241	瑞丰光电	64,200	358,878.00	0.02
774	301125	腾亚精工	19,400	356,572.00	0.02
775	688002	睿创微纳	3,533	356,126.40	0.02
776	688283	坤恒顺维	8,816	355,284.80	0.02
777	300837	浙矿股份	10,400	353,808.00	0.02
778	603733	仙鹤股份	14,600	352,882.00	0.02
779	688419	耐科装备	12,607	352,869.93	0.02
780	301061	匠心家居	3,700	350,760.00	0.02
781	600927	永安期货	21,600	347,112.00	0.02
782	600602	云赛智联	18,500	345,765.00	0.02
783	603396	金辰股份	10,300	345,565.00	0.02
784	603095	越剑智能	19,360	345,382.40	0.02
785	002760	凤形股份	15,900	345,189.00	0.02
786	000612	焦作万方	31,300	344,926.00	0.02
787	002202	金风科技	16,700	340,680.00	0.02
788	002658	雪迪龙	37,700	340,431.00	0.02
789	002209	达意隆	21,100	340,132.00	0.02
790	301132	满坤科技	10,200	339,660.00	0.02
791	688612	威迈斯	10,269	338,568.93	0.02
792	603217	元利科技	13,100	335,622.00	0.02
793	300227	光韵达	36,300	334,323.00	0.02
794	301419	阿莱德	9,700	328,636.00	0.02
795	300939	秋田微	9,400	324,112.00	0.02
796	600596	新安股份	28,200	323,454.00	0.02
797	600663	陆家嘴	40,800	322,728.00	0.02
798	688303	大全能源	12,000	321,840.00	0.02

799	603162	海通发展	26,700	321,468.00	0.02
800	601696	中银证券	21,400	320,786.00	0.02
801	688519	南亚新材	3,938	318,426.68	0.02
802	600367	红星发展	18,200	317,954.00	0.02
803	001376	百通能源	18,800	316,592.00	0.02
804	603611	诺力股份	12,900	315,405.00	0.02
805	603680	今创集团	20,400	314,364.00	0.02
806	603661	恒林股份	9,800	313,698.00	0.02
807	000603	盛达资源	10,100	312,696.00	0.02
808	601608	中信重工	47,300	311,707.00	0.02
809	688193	仁度生物	6,414	310,245.18	0.02
810	301548	崇德科技	5,600	309,736.00	0.02
811	600802	福建水泥	46,600	305,696.00	0.02
812	603170	宝立食品	21,400	305,592.00	0.02
813	002552	宝鼎科技	18,500	305,435.00	0.02
814	301499	维科精密	10,300	303,129.00	0.02
815	300671	富满微	9,500	302,955.00	0.02
816	300315	掌趣科技	61,300	302,822.00	0.02
817	600770	综艺股份	58,400	301,928.00	0.02
818	000576	甘化科工	28,600	301,158.00	0.02
819	300550	和仁科技	20,700	300,357.00	0.02
820	300805	电声股份	28,200	297,510.00	0.02
821	605180	华生科技	20,390	296,674.50	0.02
822	688334	西高院	15,315	296,498.40	0.02
823	300932	三友联众	24,500	293,755.00	0.02
824	301487	盟固利	13,300	291,669.00	0.02
825	688205	德科立	2,120	291,457.60	0.02
826	603276	恒兴新材	17,500	290,500.00	0.02
827	605108	同庆楼	15,100	290,222.00	0.02
828	600581	八一钢铁	86,600	289,244.00	0.02
829	301336	趣睡科技	5,600	289,240.00	0.02
830	300043	星辉娱乐	51,100	288,715.00	0.02
831	601933	永辉超市	60,900	285,621.00	0.02
832	603585	苏利股份	15,100	284,786.00	0.02
833	300407	凯发电气	25,100	284,132.00	0.02
834	605058	澳弘电子	9,300	283,836.00	0.02
835	603105	芯能科技	30,700	282,133.00	0.02
836	003011	海象新材	12,800	282,112.00	0.02
837	002286	保龄宝	31,300	279,822.00	0.02
838	688701	卓锦股份	34,325	279,748.75	0.02
839	300139	晓程科技	9,200	279,312.00	0.02
840	000777	中核科技	10,800	279,180.00	0.02
841	605155	西大门	16,200	278,640.00	0.02

842	603282	亚光股份	14,000	277,760.00	0.02
843	603408	建霖家居	20,500	277,570.00	0.02
844	002746	仙坛股份	45,500	276,185.00	0.02
845	001322	箭牌家居	31,000	274,970.00	0.02
846	601369	陕鼓动力	27,300	273,273.00	0.02
847	002582	好想你	24,700	272,935.00	0.02
848	688510	航亚科技	10,132	272,550.80	0.02
849	002667	威领股份	20,800	272,272.00	0.02
850	688629	华丰科技	2,721	272,263.26	0.02
851	000166	申万宏源	51,500	271,405.00	0.02
852	603758	秦安股份	15,600	271,284.00	0.02
853	601619	嘉泽新能	60,800	269,952.00	0.02
854	603026	石大胜华	3,600	269,316.00	0.02
855	301119	正强股份	5,100	268,719.00	0.02
856	001209	洪兴股份	12,800	267,008.00	0.02
857	002706	良信股份	24,600	265,188.00	0.02
858	301039	中集车辆	28,800	263,520.00	0.02
859	002587	奥拓电子	38,900	262,964.00	0.02
860	002020	京新药业	13,800	261,924.00	0.02
861	002333	罗普斯金	46,000	258,520.00	0.02
862	603985	恒润股份	16,900	257,556.00	0.02
863	002522	浙江众成	45,500	256,620.00	0.02
864	603228	景旺电子	3,500	255,815.00	0.02
865	001360	南矿集团	11,800	254,290.00	0.02
866	300126	锐奇股份	29,700	254,232.00	0.02
867	301122	采纳股份	9,600	250,176.00	0.02
868	301123	奕东电子	3,400	250,104.00	0.02
869	301167	建研设计	15,200	247,000.00	0.02
870	688802	沐曦股份	617	246,374.27	0.02
871	603926	铁流股份	14,400	245,808.00	0.02
872	301126	达嘉维康	20,000	245,800.00	0.02
873	600320	振华重工	47,700	245,655.00	0.02
874	300673	佩蒂股份	13,700	245,641.00	0.02
875	600748	上实发展	45,300	245,526.00	0.02
876	688138	清溢光电	8,624	242,851.84	0.02
877	002355	兴民智通	40,000	242,400.00	0.02
878	688783	西安奕材	13,202	242,388.72	0.02
879	688173	希荻微	16,457	241,917.90	0.02
880	300972	万辰集团	1,200	241,284.00	0.02
881	603052	可川科技	7,600	239,780.00	0.02
882	688141	杰华特	5,516	239,559.88	0.02
883	688496	清越科技	40,267	239,185.98	0.02
884	603029	天鹅股份	13,100	238,944.00	0.02

885	000400	许继电气	9,200	236,532.00	0.02
886	603489	八方股份	7,700	235,466.00	0.02
887	002297	博云新材	19,600	234,612.00	0.02
888	301032	新柴股份	19,400	233,382.00	0.02
889	603385	惠达卫浴	34,000	232,560.00	0.02
890	688336	三生国健	3,900	232,323.00	0.02
891	600029	南方航空	29,000	232,290.00	0.02
892	688428	诺诚健华	11,316	232,204.32	0.02
893	002905	金逸影视	20,300	229,390.00	0.02
894	002511	中顺洁柔	26,500	226,840.00	0.02
895	300511	雪榕生物	36,200	225,888.00	0.02
896	601111	中国国航	24,000	224,880.00	0.02
897	300725	药石科技	5,800	223,648.00	0.02
898	002841	视源股份	5,600	221,928.00	0.02
899	002046	国机精工	5,100	220,218.00	0.02
900	000682	东方电子	18,500	219,410.00	0.01
901	600152	维科技术	29,600	216,080.00	0.01
902	688236	春立医疗	9,440	215,987.20	0.01
903	601900	南方传媒	16,000	214,560.00	0.01
904	601628	中国人寿	4,700	213,850.00	0.01
905	300105	龙源技术	29,400	210,504.00	0.01
906	000920	沃顿科技	16,900	210,405.00	0.01
907	600273	嘉化能源	24,000	209,760.00	0.01
908	603897	长城科技	7,700	209,440.00	0.01
909	600078	澄星股份	21,800	209,062.00	0.01
910	603058	永吉股份	22,300	208,951.00	0.01
911	002911	佛燃能源	17,200	208,464.00	0.01
912	002873	新天药业	21,000	208,320.00	0.01
913	002707	众信旅游	28,700	206,353.00	0.01
914	600853	龙建股份	47,500	205,675.00	0.01
915	605118	力鼎光电	6,800	204,748.00	0.01
916	002842	翔鹭钨业	14,000	202,440.00	0.01
917	605196	华通线缆	5,800	201,492.00	0.01
918	002041	登海种业	21,000	200,340.00	0.01
919	300279	和晶科技	27,700	199,994.00	0.01
920	300371	汇中股份	15,900	199,863.00	0.01
921	300915	海融科技	8,400	199,500.00	0.01
922	603199	九华旅游	5,400	198,504.00	0.01
923	603231	索宝蛋白	10,800	197,856.00	0.01
924	002659	凯文教育	33,500	196,310.00	0.01
925	688049	炬芯科技	3,683	193,725.80	0.01
926	300593	新雷能	6,500	193,440.00	0.01
927	000911	广农糖业	26,400	192,984.00	0.01

928	300935	盈建科	6,300	191,142.00	0.01
929	600737	中粮糖业	11,100	191,031.00	0.01
930	300852	四会富仕	5,000	190,900.00	0.01
931	300473	德尔股份	6,400	190,592.00	0.01
932	603091	众鑫股份	2,400	190,104.00	0.01
933	600697	欧亚集团	14,400	189,936.00	0.01
934	002918	蒙娜丽莎	13,300	189,259.00	0.01
935	300945	曼卡龙	11,700	189,072.00	0.01
936	688238	和元生物	28,233	188,031.78	0.01
937	600052	东望时代	39,500	186,045.00	0.01
938	688765	禾元生物	3,529	185,695.98	0.01
939	002443	金洲管道	22,700	185,232.00	0.01
940	601163	三角轮胎	12,900	184,341.00	0.01
941	688258	卓易信息	2,400	183,768.00	0.01
942	001210	金房能源	10,700	183,291.00	0.01
943	300698	万马科技	4,300	181,159.00	0.01
944	603188	亚邦股份	39,100	179,469.00	0.01
945	688055	龙腾光电	49,672	178,819.20	0.01
946	605299	舒华体育	15,400	176,946.00	0.01
947	002753	永东股份	24,700	176,111.00	0.01
948	688521	芯原股份	1,284	175,869.48	0.01
949	301379	天山电子	6,800	175,780.00	0.01
950	001230	劲旅环境	8,000	174,320.00	0.01
951	600120	浙江东方	28,200	173,994.00	0.01
952	600743	华远控股	86,900	173,800.00	0.01
953	300259	新天科技	38,900	172,716.00	0.01
954	603948	建业股份	6,300	171,990.00	0.01
955	603121	华培动力	8,100	171,396.00	0.01
956	002589	瑞康医药	53,200	171,304.00	0.01
957	002946	新乳业	9,200	170,476.00	0.01
958	605258	协和电子	5,400	168,858.00	0.01
959	603788	宁波高发	10,300	168,302.00	0.01
960	002085	万丰奥威	10,500	168,105.00	0.01
961	601999	出版传媒	24,400	167,628.00	0.01
962	300058	蓝色光标	14,500	167,040.00	0.01
963	000605	渤海股份	24,800	166,408.00	0.01
964	688600	皖仪科技	6,639	166,306.95	0.01
965	688070	纵横股份	3,000	166,200.00	0.01
966	300549	优德精密	8,800	165,968.00	0.01
967	600292	远达环保	12,700	165,735.00	0.01
968	603161	科华控股	12,000	164,760.00	0.01
969	000895	双汇发展	6,200	164,114.00	0.01
970	600613	神奇制药	27,000	163,890.00	0.01

971	600345	长江通信	4,700	162,902.00	0.01
972	300553	集智股份	4,000	161,560.00	0.01
973	600768	宁波富邦	11,500	161,000.00	0.01
974	603660	苏州科达	14,500	159,935.00	0.01
975	600876	凯盛新能	16,200	159,732.00	0.01
976	002527	新时达	9,000	159,660.00	0.01
977	600241	时代万恒	19,100	159,485.00	0.01
978	300749	顶固集创	13,200	159,324.00	0.01
979	000935	四川双马	6,400	158,976.00	0.01
980	603966	法兰泰克	13,300	158,270.00	0.01
981	002386	天原股份	29,100	158,013.00	0.01
982	600339	中油工程	47,100	157,785.00	0.01
983	000567	海德股份	24,500	157,290.00	0.01
984	688147	微导纳米	2,491	156,409.89	0.01
985	688301	奕瑞科技	1,540	155,709.40	0.01
986	001872	招商港口	8,000	154,640.00	0.01
987	600084	中信尼雅	29,400	154,350.00	0.01
988	688733	壹石通	5,236	151,739.28	0.01
989	000009	中国宝安	15,400	151,690.00	0.01
990	601229	上海银行	14,900	150,490.00	0.01
991	002948	青岛银行	33,300	149,184.00	0.01
992	301130	西点药业	5,200	148,408.00	0.01
993	000833	粤桂股份	7,600	147,896.00	0.01
994	301087	可孚医疗	3,300	147,411.00	0.01
995	300790	宇瞳光学	4,900	146,559.00	0.01
996	688708	佳驰科技	2,350	146,287.50	0.01
997	600323	瀚蓝环境	5,100	145,860.00	0.01
998	688298	东方生物	6,200	145,266.00	0.01
999	301656	联合动力	5,685	144,740.10	0.01
1,000	600738	丽尚国潮	27,800	143,448.00	0.01
1,001	688162	巨一科技	4,644	143,035.20	0.01
1,002	601328	交通银行	19,700	142,825.00	0.01
1,003	600191	华资实业	11,100	142,635.00	0.01
1,004	301360	荣旗科技	2,000	141,800.00	0.01
1,005	688571	杭华股份	19,016	141,669.20	0.01
1,006	002380	科远智慧	5,100	138,720.00	0.01
1,007	000639	西王食品	41,600	137,696.00	0.01
1,008	603777	来伊份	10,000	137,300.00	0.01
1,009	603103	横店影视	8,200	135,956.00	0.01
1,010	688257	新锐股份	3,966	135,954.48	0.01
1,011	301251	威尔高	2,600	135,928.00	0.01
1,012	300009	安科生物	14,200	135,894.00	0.01
1,013	600110	诺德股份	19,100	135,419.00	0.01

1,014	600369	西南证券	30,200	135,296.00	0.01
1,015	688432	有研硅	10,796	133,978.36	0.01
1,016	603233	大参林	7,600	133,912.00	0.01
1,017	300190	维尔利	31,100	133,419.00	0.01
1,018	002198	嘉应制药	18,900	132,867.00	0.01
1,019	688046	药康生物	8,533	131,066.88	0.01
1,020	600782	新钢股份	33,700	130,756.00	0.01
1,021	300323	华灿光电	16,200	129,276.00	0.01
1,022	301035	润丰股份	1,900	129,219.00	0.01
1,023	688531	日联科技	1,954	129,022.62	0.01
1,024	603048	浙江黎明	6,100	128,954.00	0.01
1,025	688690	纳微科技	4,965	128,146.65	0.01
1,026	301305	朗坤科技	5,700	128,079.00	0.01
1,027	601330	绿色动力	19,000	127,870.00	0.01
1,028	301353	普莱得	4,800	127,680.00	0.01
1,029	300053	航宇微	6,700	127,434.00	0.01
1,030	003027	同兴科技	5,700	127,110.00	0.01
1,031	605162	新中港	14,800	126,392.00	0.01
1,032	301587	中瑞股份	5,400	126,360.00	0.01
1,033	688183	生益电子	1,318	126,119.42	0.01
1,034	002638	勤上股份	40,800	126,072.00	0.01
1,035	600058	五矿发展	10,900	125,568.00	0.01
1,036	002539	云图控股	10,600	125,292.00	0.01
1,037	301295	美硕科技	4,200	125,160.00	0.01
1,038	002928	华夏航空	11,300	124,865.00	0.01
1,039	603101	汇嘉时代	12,800	123,648.00	0.01
1,040	601077	渝农商行	19,100	123,386.00	0.01
1,041	300118	东方日升	8,400	123,144.00	0.01
1,042	603527	众源新材	11,100	123,099.00	0.01
1,043	002331	皖通科技	13,800	123,096.00	0.01
1,044	603909	建发合诚	10,900	123,061.00	0.01
1,045	600808	马钢股份	29,100	122,802.00	0.01
1,046	301215	中汽股份	17,900	122,615.00	0.01
1,047	605338	巴比食品	3,900	122,148.00	0.01
1,048	605567	春雪食品	11,100	122,100.00	0.01
1,049	002233	塔牌集团	13,500	121,635.00	0.01
1,050	603558	健盛集团	10,800	121,284.00	0.01
1,051	002950	奥美医疗	11,100	121,212.00	0.01
1,052	000034	神州数码	3,100	120,621.00	0.01
1,053	000566	海南海药	16,600	118,690.00	0.01
1,054	601375	中原证券	27,500	118,250.00	0.01
1,055	688390	固德威	1,900	118,047.00	0.01
1,056	688718	唯赛勃	8,934	116,856.72	0.01

1,057	603676	卫信康	11,100	116,772.00	0.01
1,058	603326	我乐家居	13,100	116,590.00	0.01
1,059	002042	华孚时尚	27,400	116,450.00	0.01
1,060	300772	运达股份	6,100	116,266.00	0.01
1,061	300454	深信服	1,000	115,160.00	0.01
1,062	002773	康弘药业	3,800	113,886.00	0.01
1,063	300594	朗进科技	5,800	113,738.00	0.01
1,064	600063	皖维高新	19,200	113,088.00	0.01
1,065	600867	通化东宝	13,599	111,103.83	0.01
1,066	300994	久祺股份	7,000	110,530.00	0.01
1,067	300645	正元智慧	5,900	110,507.00	0.01
1,068	600235	民丰特纸	16,200	110,160.00	0.01
1,069	300176	鸿特科技	16,400	109,388.00	0.01
1,070	600908	无锡银行	18,300	108,519.00	0.01
1,071	600688	上海石化	39,000	108,420.00	0.01
1,072	603097	江苏华辰	3,800	107,920.00	0.01
1,073	605388	均瑶健康	14,400	107,136.00	0.01
1,074	002943	宇晶股份	2,700	106,920.00	0.01
1,075	601233	桐昆股份	6,200	106,702.00	0.01
1,076	301539	宏鑫科技	5,100	106,590.00	0.01
1,077	000544	中原环保	12,800	106,496.00	0.01
1,078	603203	快克智能	2,900	106,169.00	0.01
1,079	002823	凯中精密	6,600	105,996.00	0.01
1,080	601865	福莱特	6,700	104,989.00	0.01
1,081	603815	交建股份	14,000	104,160.00	0.01
1,082	001280	中国铀业	2,288	103,954.84	0.01
1,083	000534	万泽股份	4,700	103,400.00	0.01
1,084	001313	粤海饲料	14,100	103,212.00	0.01
1,085	688187	时代电气	2,000	102,580.00	0.01
1,086	600097	开创国际	9,000	102,240.00	0.01
1,087	300569	天能重工	17,700	101,598.00	0.01
1,088	002208	合肥城建	8,200	101,516.00	0.01
1,089	688093	世华科技	2,747	101,226.95	0.01
1,090	688350	富淼科技	3,898	100,295.54	0.01
1,091	002370	亚太药业	13,700	100,147.00	0.01
1,092	003008	开普检测	4,500	96,975.00	0.01
1,093	000419	通程控股	15,100	96,489.00	0.01
1,094	301217	铜冠铜箔	2,800	95,984.00	0.01
1,095	301113	雅艺科技	4,000	95,680.00	0.01
1,096	300916	朗特智能	2,900	95,062.00	0.01
1,097	600926	杭州银行	6,200	94,736.00	0.01
1,098	300258	精锻科技	6,500	93,080.00	0.01
1,099	600183	生益科技	1,300	92,833.00	0.01

1, 100	300811	铂科新材	1, 300	92, 703. 00	0. 01
1, 101	002320	海峡股份	7, 600	92, 492. 00	0. 01
1, 102	300265	通光线缆	6, 900	92, 460. 00	0. 01
1, 103	688360	德马科技	4, 345	92, 374. 70	0. 01
1, 104	600429	三元股份	17, 800	92, 204. 00	0. 01
1, 105	301418	协昌科技	2, 500	91, 250. 00	0. 01
1, 106	300940	南极光	3, 200	91, 072. 00	0. 01
1, 107	600316	洪都航空	2, 600	90, 766. 00	0. 01
1, 108	603321	梅轮电梯	11, 200	90, 048. 00	0. 01
1, 109	601216	君正集团	18, 528	89, 304. 96	0. 01
1, 110	688472	阿特斯	5, 970	89, 012. 70	0. 01
1, 111	603663	三祥新材	2, 500	88, 375. 00	0. 01
1, 112	300759	康龙化成	3, 100	88, 133. 00	0. 01
1, 113	002097	山河智能	7, 100	88, 111. 00	0. 01
1, 114	300154	瑞凌股份	8, 700	85, 695. 00	0. 01
1, 115	688063	派能科技	1, 500	85, 230. 00	0. 01
1, 116	000885	城发环境	6, 200	85, 064. 00	0. 01
1, 117	600601	方正科技	7, 200	84, 384. 00	0. 01
1, 118	600516	方大炭素	14, 700	83, 643. 00	0. 01
1, 119	002775	文科股份	19, 500	83, 460. 00	0. 01
1, 120	000757	浩物股份	17, 100	83, 277. 00	0. 01
1, 121	688371	菲沃泰	4, 500	83, 115. 00	0. 01
1, 122	301100	风光股份	3, 900	83, 109. 00	0. 01
1, 123	300151	昌红科技	5, 500	82, 940. 00	0. 01
1, 124	300433	蓝思科技	2, 700	81, 729. 00	0. 01
1, 125	000498	山东路桥	13, 500	81, 405. 00	0. 01
1, 126	300838	浙江力诺	5, 300	80, 825. 00	0. 01
1, 127	600463	空港股份	7, 100	80, 372. 00	0. 01
1, 128	300328	宜安科技	4, 700	80, 229. 00	0. 01
1, 129	603628	清源股份	5, 900	79, 650. 00	0. 01
1, 130	688300	联瑞新材	1, 278	79, 351. 02	0. 01
1, 131	600820	隧道股份	12, 200	79, 178. 00	0. 01
1, 132	601326	秦港股份	22, 500	78, 525. 00	0. 01
1, 133	002817	黄山胶囊	10, 300	78, 280. 00	0. 01
1, 134	002557	洽洽食品	3, 600	77, 832. 00	0. 01
1, 135	002831	裕同科技	2, 700	76, 977. 00	0. 01
1, 136	301507	民生健康	5, 000	76, 800. 00	0. 01
1, 137	600486	扬农化工	1, 100	76, 329. 00	0. 01
1, 138	603518	锦泓集团	7, 800	75, 738. 00	0. 01
1, 139	601456	国联民生	7, 400	75, 258. 00	0. 01
1, 140	300656	民德电子	3, 400	74, 868. 00	0. 01
1, 141	600055	万东医疗	4, 800	74, 784. 00	0. 01
1, 142	300530	领湃科技	2, 800	74, 760. 00	0. 01

1, 143	688681	科汇股份	4, 241	74, 556. 78	0. 01
1, 144	600416	湘电股份	4, 700	74, 166. 00	0. 01
1, 145	002119	康强电子	4, 500	74, 115. 00	0. 01
1, 146	688037	芯源微	498	73, 957. 98	0. 01
1, 147	000069	华侨城 A	29, 700	73, 656. 00	0. 01
1, 148	300566	激智科技	4, 000	73, 400. 00	0. 01
1, 149	600295	鄂尔多斯	5, 900	72, 924. 00	0. 00
1, 150	002126	银轮股份	1, 900	71, 820. 00	0. 00
1, 151	603329	上海雅仕	6, 500	71, 500. 00	0. 00
1, 152	688281	华秦科技	959	70, 774. 20	0. 00
1, 153	688759	必贝特	2, 789	70, 031. 79	0. 00
1, 154	603256	宏和科技	1, 900	69, 939. 00	0. 00
1, 155	300334	津膜科技	10, 000	69, 600. 00	0. 00
1, 156	600363	联创光电	1, 100	69, 366. 00	0. 00
1, 157	000753	漳州发展	8, 700	68, 469. 00	0. 00
1, 158	601939	建设银行	7, 300	67, 744. 00	0. 00
1, 159	603075	热威股份	3, 100	67, 704. 00	0. 00
1, 160	688486	龙迅股份	902	67, 027. 62	0. 00
1, 161	688659	元琛科技	6, 998	66, 131. 10	0. 00
1, 162	688588	凌志软件	4, 606	65, 911. 86	0. 00
1, 163	605169	洪通燃气	5, 000	65, 900. 00	0. 00
1, 164	001286	陕西能源	7, 000	65, 170. 00	0. 00
1, 165	600490	鹏欣资源	8, 300	64, 159. 00	0. 00
1, 166	603629	利通电子	2, 400	63, 960. 00	0. 00
1, 167	688270	臻镭科技	520	63, 476. 40	0. 00
1, 168	688059	华锐精密	800	62, 960. 00	0. 00
1, 169	605100	华丰股份	1, 400	62, 958. 00	0. 00
1, 170	605006	山东玻纤	8, 600	62, 780. 00	0. 00
1, 171	300355	蒙草生态	15, 400	62, 216. 00	0. 00
1, 172	600561	江西长运	9, 600	62, 208. 00	0. 00
1, 173	603201	常润股份	3, 660	61, 780. 80	0. 00
1, 174	603519	立霸股份	5, 100	61, 353. 00	0. 00
1, 175	002616	长青集团	11, 200	61, 152. 00	0. 00
1, 176	603856	东宏股份	4, 900	61, 103. 00	0. 00
1, 177	688790	昂瑞微	516	60, 470. 04	0. 00
1, 178	002158	汉钟精机	2, 400	60, 072. 00	0. 00
1, 179	600150	中国船舶	1, 800	59, 868. 00	0. 00
1, 180	002591	恒大高新	7, 300	59, 276. 00	0. 00
1, 181	301429	森泰股份	3, 000	57, 000. 00	0. 00
1, 182	001332	锡装股份	1, 000	56, 190. 00	0. 00
1, 183	601798	蓝科高新	6, 300	55, 881. 00	0. 00
1, 184	002114	罗平锌电	6, 600	55, 572. 00	0. 00
1, 185	300466	赛摩智能	5, 500	55, 275. 00	0. 00

1, 186	002405	四维图新	6, 100	54, 961. 00	0. 00
1, 187	002633	申科股份	3, 300	54, 285. 00	0. 00
1, 188	000702	正虹科技	8, 100	54, 108. 00	0. 00
1, 189	002140	东华科技	4, 800	54, 048. 00	0. 00
1, 190	001258	立新能源	7, 600	54, 036. 00	0. 00
1, 191	300261	雅本化学	7, 900	53, 167. 00	0. 00
1, 192	002235	安妮股份	5, 100	52, 734. 00	0. 00
1, 193	688809	强一股份	259	52, 657. 29	0. 00
1, 194	600616	金枫酒业	9, 800	52, 528. 00	0. 00
1, 195	002446	盛路通信	5, 000	52, 450. 00	0. 00
1, 196	688166	博瑞医药	1, 066	52, 297. 96	0. 00
1, 197	301118	恒光股份	2, 100	51, 996. 00	0. 00
1, 198	002906	华阳集团	1, 700	51, 986. 00	0. 00
1, 199	301060	兰卫医学	5, 600	51, 800. 00	0. 00
1, 200	301097	天益医疗	1, 000	51, 620. 00	0. 00
1, 201	601138	工业富联	800	49, 640. 00	0. 00
1, 202	605366	宏柏新材	8, 000	49, 600. 00	0. 00
1, 203	605001	威奥股份	6, 500	49, 595. 00	0. 00
1, 204	300267	尔康制药	14, 400	49, 104. 00	0. 00
1, 205	688729	屹唐股份	2, 022	49, 094. 16	0. 00
1, 206	002440	闰土股份	6, 500	48, 555. 00	0. 00
1, 207	603163	圣晖集成	700	48, 020. 00	0. 00
1, 208	600833	第一医药	3, 700	47, 841. 00	0. 00
1, 209	603878	武进不锈	5, 100	47, 226. 00	0. 00
1, 210	600728	佳都科技	7, 000	46, 760. 00	0. 00
1, 211	301356	天振股份	2, 200	46, 618. 00	0. 00
1, 212	600547	山东黄金	1, 200	46, 452. 00	0. 00
1, 213	300923	研奥股份	1, 800	45, 954. 00	0. 00
1, 214	601677	明泰铝业	3, 100	45, 849. 00	0. 00
1, 215	301361	众智科技	1, 400	45, 626. 00	0. 00
1, 216	003002	壶化股份	1, 400	45, 318. 00	0. 00
1, 217	600690	海尔智家	1, 700	44, 353. 00	0. 00
1, 218	600458	时代新材	3, 300	43, 791. 00	0. 00
1, 219	601000	唐山港	11, 400	43, 776. 00	0. 00
1, 220	002838	道恩股份	1, 800	43, 344. 00	0. 00
1, 221	002651	利君股份	3, 700	43, 253. 00	0. 00
1, 222	688288	鸿泉技术	1, 581	42, 386. 61	0. 00
1, 223	600137	浪莎股份	2, 200	42, 306. 00	0. 00
1, 224	300349	金卡智能	2, 700	42, 201. 00	0. 00
1, 225	600116	三峡水利	6, 400	41, 856. 00	0. 00
1, 226	002451	摩恩电气	4, 100	41, 533. 00	0. 00
1, 227	000978	桂林旅游	5, 700	41, 268. 00	0. 00
1, 228	000581	威孚高科	2, 000	41, 240. 00	0. 00

1, 229	688295	中复神鹰	1, 241	40, 717. 21	0. 00
1, 230	603081	大丰实业	2, 900	40, 687. 00	0. 00
1, 231	688449	联芸科技	900	40, 662. 00	0. 00
1, 232	603989	艾华集团	2, 400	40, 272. 00	0. 00
1, 233	600373	中文传媒	4, 200	39, 228. 00	0. 00
1, 234	600980	北矿科技	1, 700	39, 066. 00	0. 00
1, 235	300909	汇创达	800	38, 480. 00	0. 00
1, 236	601886	江河集团	4, 700	38, 352. 00	0. 00
1, 237	002815	崇达技术	2, 800	38, 248. 00	0. 00
1, 238	688602	康鹏科技	4, 187	36, 343. 16	0. 00
1, 239	000589	贵州轮胎	6, 900	35, 742. 00	0. 00
1, 240	688315	诺禾致源	2, 659	35, 311. 52	0. 00
1, 241	603858	步长制药	2, 200	34, 408. 00	0. 00
1, 242	301638	南网数字	2, 322	32, 995. 62	0. 00
1, 243	301372	科净源	1, 300	32, 968. 00	0. 00
1, 244	000626	远大控股	4, 100	32, 513. 00	0. 00
1, 245	600981	苏豪汇鸿	10, 000	31, 400. 00	0. 00
1, 246	688669	聚石化学	1, 336	31, 048. 64	0. 00
1, 247	002544	普天科技	900	31, 041. 00	0. 00
1, 248	300387	富邦科技	3, 600	30, 636. 00	0. 00
1, 249	600019	宝钢股份	4, 100	30, 545. 00	0. 00
1, 250	002886	沃特股份	1, 400	30, 408. 00	0. 00
1, 251	001386	马可波罗	1, 626	30, 129. 78	0. 00
1, 252	002256	兆新股份	8, 300	28, 967. 00	0. 00
1, 253	002169	智光电气	2, 500	28, 925. 00	0. 00
1, 254	001277	速达股份	700	27, 650. 00	0. 00
1, 255	301316	慧博云通	600	26, 808. 00	0. 00
1, 256	600805	悦达投资	4, 900	26, 607. 00	0. 00
1, 257	688307	中润光学	609	26, 314. 89	0. 00
1, 258	002887	绿茵生态	2, 800	26, 208. 00	0. 00
1, 259	003007	直真科技	700	26, 103. 00	0. 00
1, 260	301190	善水科技	1, 200	25, 452. 00	0. 00
1, 261	000035	中国天楹	4, 600	25, 392. 00	0. 00
1, 262	300192	科德教育	1, 200	25, 356. 00	0. 00
1, 263	002938	鹏鼎控股	500	25, 290. 00	0. 00
1, 264	688358	祥生医疗	800	24, 080. 00	0. 00
1, 265	603599	广信股份	2, 000	22, 960. 00	0. 00
1, 266	300694	蠡湖股份	1, 900	22, 952. 00	0. 00
1, 267	300030	阳普医疗	3, 100	22, 816. 00	0. 00
1, 268	002810	山东赫达	1, 500	22, 245. 00	0. 00
1, 269	301387	光大同创	400	22, 160. 00	0. 00
1, 270	601009	南京银行	1, 900	21, 717. 00	0. 00
1, 271	603685	晨丰科技	1, 100	21, 439. 00	0. 00

1,272	600425	青松建化	5,100	21,216.00	0.00
1,273	600780	通宝能源	3,600	20,448.00	0.00
1,274	002996	顺博合金	2,700	20,412.00	0.00
1,275	600315	上海家化	900	20,268.00	0.00
1,276	688517	金冠电气	1,300	20,267.00	0.00
1,277	605183	确成股份	1,000	19,920.00	0.00
1,278	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
1,279	601609	金田股份	1,800	19,440.00	0.00
1,280	600526	菲达环保	3,600	19,296.00	0.00
1,281	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
1,282	601068	中铝国际	3,600	19,044.00	0.00
1,283	603355	莱克电气	600	19,038.00	0.00
1,284	300670	大烨智能	2,600	18,486.00	0.00
1,285	601218	吉鑫科技	3,600	18,216.00	0.00
1,286	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
1,287	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
1,288	301055	张小泉	900	17,649.00	0.00
1,289	600278	东方创业	2,300	17,480.00	0.00
1,290	000553	安道麦 A	3,000	16,440.00	0.00
1,291	002614	奥佳华	2,200	16,082.00	0.00
1,292	002863	今飞凯达	2,700	15,849.00	0.00
1,293	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
1,294	688378	奥来德	559	15,260.70	0.00
1,295	301277	新天地	1,292	15,232.68	0.00
1,296	688285	高铁电气	1,705	14,799.40	0.00
1,297	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
1,298	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
1,299	301667	纳百川	201	12,630.07	0.00
1,300	688103	国力电子	200	12,118.00	0.00
1,301	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
1,302	000906	浙商中拓	2,000	11,840.00	0.00
1,303	688201	信安世纪	800	11,704.00	0.00
1,304	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
1,305	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
1,306	300471	厚普股份	900	11,340.00	0.00
1,307	600153	建发股份	1,200	11,100.00	0.00
1,308	603637	镇海股份	1,000	10,870.00	0.00
1,309	300992	泰福泵业	400	10,800.00	0.00
1,310	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
1,311	300272	开能健康	1,400	10,472.00	0.00
1,312	002637	赞宇科技	1,000	10,250.00	0.00
1,313	001278	一彬科技	500	9,670.00	0.00
1,314	301601	惠通科技	342	9,504.18	0.00

1,315	002821	凯莱英	100	9,293.00	0.00
1,316	688380	中微半导	289	9,291.35	0.00
1,317	300738	奥飞数据	500	9,245.00	0.00
1,318	300846	首都在线	400	9,132.00	0.00
1,319	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
1,320	605259	绿田机械	400	8,952.00	0.00
1,321	002896	中大力德	100	8,936.00	0.00
1,322	301003	江苏博云	200	8,920.00	0.00
1,323	301020	密封科技	400	8,840.00	0.00
1,324	002393	力生制药	400	8,684.00	0.00
1,325	301525	儒竞科技	100	8,634.00	0.00
1,326	301310	鑫宏业	200	8,590.00	0.00
1,327	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
1,328	301149	隆华新材	800	8,512.00	0.00
1,329	603219	富佳股份	500	8,420.00	0.00
1,330	688679	通源环境	313	8,325.80	0.00
1,331	300133	华策影视	1,000	8,320.00	0.00
1,332	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
1,333	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
1,334	002313	日海智能	800	8,152.00	0.00
1,335	300782	卓胜微	100	8,148.00	0.00
1,336	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
1,337	603190	亚通精工	300	8,091.00	0.00
1,338	300452	山河药辅	600	8,028.00	0.00
1,339	603587	地素时尚	600	8,016.00	0.00
1,340	301520	万邦医药	200	7,946.00	0.00
1,341	000988	华工科技	100	7,933.00	0.00
1,342	301298	东利机械	500	7,910.00	0.00
1,343	688113	联测科技	200	7,906.00	0.00
1,344	688722	同益中	400	7,820.00	0.00
1,345	301449	天溯计量	118	7,812.34	0.00
1,346	002949	华阳国际	500	7,775.00	0.00
1,347	003020	立方制药	300	7,764.00	0.00
1,348	300451	创业慧康	1,600	7,744.00	0.00
1,349	300517	海波重科	700	7,742.00	0.00
1,350	603159	上海亚虹	300	7,713.00	0.00
1,351	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
1,352	300222	科大智能	700	7,658.00	0.00
1,353	301052	果麦文化	200	7,638.00	0.00
1,354	000063	中兴通讯	200	7,568.00	0.00
1,355	688262	国芯科技	246	7,466.10	0.00
1,356	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
1,357	002890	弘宇股份	500	7,300.00	0.00

1,358	688030	山石网科	400	7,268.00	0.00
1,359	002337	赛象科技	1,100	7,227.00	0.00
1,360	002718	友邦吊顶	200	7,188.00	0.00
1,361	002339	积成电子	800	7,056.00	0.00
1,362	300606	金太阳	300	7,053.00	0.00
1,363	600996	贵广网络	700	7,028.00	0.00
1,364	603551	奥普科技	600	6,954.00	0.00
1,365	300783	三只松鼠	300	6,945.00	0.00
1,366	000031	大悦城	2,400	6,768.00	0.00
1,367	603125	常青科技	400	6,752.00	0.00
1,368	002631	德尔未来	1,100	6,578.00	0.00
1,369	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
1,370	600733	北汽蓝谷	800	6,424.00	0.00
1,371	301065	本立科技	300	6,405.00	0.00
1,372	603220	中贝通信	300	6,390.00	0.00
1,373	300617	安靠智电	200	6,380.00	0.00
1,374	002051	中工国际	700	6,349.00	0.00
1,375	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
1,376	605166	聚合顺	600	6,222.00	0.00
1,377	601929	吉视传媒	1,800	6,192.00	0.00
1,378	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
1,379	000788	北大医药	1,000	6,110.00	0.00
1,380	002560	通达股份	600	6,048.00	0.00
1,381	002799	环球印务	700	5,971.00	0.00
1,382	300993	玉马科技	400	5,888.00	0.00
1,383	688007	光峰科技	314	5,830.98	0.00
1,384	603916	苏博特	600	5,676.00	0.00
1,385	002045	国光电器	400	5,668.00	0.00
1,386	600562	国睿科技	200	5,652.00	0.00
1,387	300967	晓鸣股份	300	5,649.00	0.00
1,388	301577	美信科技	100	5,646.00	0.00
1,389	300986	志特新材	500	5,590.00	0.00
1,390	688132	邦彦技术	300	5,526.00	0.00
1,391	300642	透景生命	300	5,517.00	0.00
1,392	002871	伟隆股份	300	5,400.00	0.00
1,393	688528	秦川物联	492	5,298.84	0.00
1,394	300755	华致酒行	300	5,286.00	0.00
1,395	002852	道道全	500	5,275.00	0.00
1,396	002130	沃尔核材	200	5,264.00	0.00
1,397	600303	曙光股份	1,600	5,216.00	0.00
1,398	300863	卡倍亿	100	5,040.00	0.00
1,399	000921	海信家电	200	4,962.00	0.00
1,400	603248	锡华科技	292	4,941.04	0.00

1,401	000717	中南股份	1,700	4,403.00	0.00
1,402	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
1,403	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
1,404	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
1,405	600201	生物股份	200	3,014.00	0.00
1,406	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
1,407	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
1,408	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	600497	驰宏锌锗	16,421,550.00	4.60
2	002624	完美世界	16,380,148.00	4.59
3	600428	中远海特	15,357,865.20	4.30
4	601168	西部矿业	14,829,438.00	4.15
5	600027	华电国际	14,595,439.00	4.09
6	300476	胜宏科技	14,574,534.00	4.08
7	000893	亚钾国际	14,529,695.99	4.07
8	002414	高德红外	14,508,566.64	4.06
9	600795	国电电力	14,443,370.45	4.05
10	600909	华安证券	14,422,061.00	4.04
11	300079	数码视讯	14,150,752.00	3.96
12	603225	新凤鸣	13,700,556.00	3.84
13	601107	四川成渝	13,680,650.00	3.83
14	002299	圣农发展	13,607,210.00	3.81
15	002335	科华数据	13,485,554.00	3.78
16	002284	亚太股份	13,322,109.00	3.73
17	601901	方正证券	13,195,524.00	3.70
18	002170	芭田股份	13,165,954.00	3.69
19	603566	普莱柯	12,671,833.00	3.55
20	600098	广州发展	12,510,613.00	3.50
21	600761	安徽合力	12,443,181.00	3.49
22	600109	国金证券	12,383,287.00	3.47
23	601117	中国化学	12,334,899.00	3.45
24	601555	东吴证券	12,097,953.10	3.39
25	000060	中金岭南	11,728,656.00	3.28
26	300279	和晶科技	11,309,724.00	3.17
27	600578	京能电力	11,270,674.00	3.16
28	000582	北部湾港	11,111,198.00	3.11
29	300207	欣旺达	11,026,837.00	3.09
30	688258	卓易信息	10,988,077.87	3.08

31	002080	中材科技	10,979,072.50	3.07
32	002803	吉宏股份	10,932,584.00	3.06
33	600873	梅花生物	10,910,909.00	3.06
34	000726	鲁泰A	10,857,874.00	3.04
35	300363	博腾股份	10,775,592.00	3.02
36	300098	高新兴	10,723,995.00	3.00
37	000543	皖能电力	10,705,665.38	3.00
38	300369	绿盟科技	10,476,632.00	2.93
39	600739	辽宁成大	10,464,095.00	2.93
40	601108	财通证券	10,448,726.00	2.93
41	002340	格林美	10,446,138.00	2.93
42	600742	富维股份	10,247,350.00	2.87
43	600531	豫光金铅	10,244,421.00	2.87
44	600499	科达制造	10,226,343.00	2.86
45	600266	城建发展	10,171,087.00	2.85
46	300395	菲利华	10,160,320.00	2.85
47	600166	福田汽车	10,102,233.00	2.83
48	300602	飞荣达	10,012,829.00	2.80
49	000600	建投能源	10,005,847.00	2.80
50	603500	祥和实业	9,981,618.00	2.80
51	002281	光迅科技	9,976,914.00	2.79
52	600262	北方股份	9,957,994.00	2.79
53	600549	厦门钨业	9,938,343.86	2.78
54	002545	东方铁塔	9,926,674.00	2.78
55	300502	新易盛	9,858,526.40	2.76
56	300134	大富科技	9,818,842.00	2.75
57	300088	长信科技	9,770,741.00	2.74
58	300972	万辰集团	9,758,799.56	2.73
59	002851	麦格米特	9,725,321.00	2.72
60	000728	国元证券	9,698,505.00	2.72
61	000878	云南铜业	9,489,750.00	2.66
62	600073	光明肉业	9,414,027.37	2.64
63	600378	昊华科技	9,382,483.00	2.63
64	605020	永和股份	9,176,145.12	2.57
65	688321	微芯生物	9,170,785.69	2.57
66	688410	山外山	9,121,823.85	2.55
67	600673	东阳光	9,071,591.30	2.54
68	000830	鲁西化工	9,063,225.00	2.54
69	002367	康力电梯	9,035,798.00	2.53
70	002632	道明光学	9,033,047.00	2.53
71	600970	中材国际	9,018,452.00	2.53
72	600011	华能国际	9,015,797.00	2.53
73	688222	成都先导	9,009,891.05	2.52

74	600061	国投资本	8,913,410.00	2.50
75	000938	紫光股份	8,850,601.00	2.48
76	000027	深圳能源	8,840,935.09	2.48
77	000783	长江证券	8,828,658.00	2.47
78	002484	江海股份	8,811,456.00	2.47
79	002345	潮宏基	8,734,326.00	2.45
80	603267	鸿远电子	8,728,205.00	2.44
81	300624	万兴科技	8,691,746.03	2.43
82	300041	回天新材	8,691,730.10	2.43
83	688512	慧智微	8,674,125.93	2.43
84	603228	景旺电子	8,620,437.20	2.41
85	600176	中国巨石	8,528,190.71	2.39
86	002736	国信证券	8,521,253.00	2.39
87	688772	珠海冠宇	8,507,449.01	2.38
88	601339	百隆东方	8,474,333.00	2.37
89	000932	华菱钢铁	8,465,076.00	2.37
90	601208	东材科技	8,423,198.00	2.36
91	603588	高能环境	8,380,769.00	2.35
92	002436	兴森科技	8,335,202.00	2.33
93	002469	三维化学	8,321,144.00	2.33
94	600704	物产中大	8,266,117.00	2.32
95	002913	奥士康	8,196,566.00	2.30
96	300032	金龙机电	8,190,181.00	2.29
97	300017	网宿科技	8,188,760.00	2.29
98	603697	有友食品	8,184,050.00	2.29
99	600057	厦门象屿	8,165,698.18	2.29
100	600867	通化东宝	8,145,625.55	2.28
101	000987	越秀资本	8,125,264.00	2.28
102	688182	灿勤科技	8,110,492.30	2.27
103	300496	中科创达	8,095,707.00	2.27
104	002701	奥瑞金	8,092,386.48	2.27
105	600901	江苏金租	8,086,157.20	2.26
106	600999	招商证券	8,067,933.70	2.26
107	603969	银龙股份	8,056,647.00	2.26
108	000960	锡业股份	8,055,975.20	2.26
109	300073	当升科技	8,012,338.00	2.24
110	002091	江苏国泰	8,004,013.32	2.24
111	300638	广和通	7,990,549.60	2.24
112	300168	万达信息	7,974,933.00	2.23
113	600866	星湖科技	7,868,790.00	2.20
114	000792	盐湖股份	7,856,226.00	2.20
115	300570	太辰光	7,843,473.00	2.20
116	300003	乐普医疗	7,838,623.00	2.20

117	600039	四川路桥	7,817,852.00	2.19
118	688207	格灵深瞳	7,806,830.77	2.19
119	002483	润邦股份	7,762,236.00	2.17
120	000899	赣能股份	7,699,730.00	2.16
121	300777	中简科技	7,682,385.00	2.15
122	600998	九州通	7,634,502.68	2.14
123	301270	汉仪股份	7,620,253.00	2.13
124	300241	瑞丰光电	7,618,071.00	2.13
125	002419	天虹股份	7,559,925.00	2.12
126	300400	劲拓股份	7,554,988.00	2.12
127	000902	新洋丰	7,532,801.00	2.11
128	600282	南钢股份	7,512,466.00	2.10
129	600487	亨通光电	7,508,877.00	2.10
130	601688	华泰证券	7,429,930.00	2.08
131	000686	东北证券	7,427,186.00	2.08
132	300765	新诺威	7,413,224.52	2.08
133	300684	中石科技	7,411,080.00	2.08
134	000603	盛达资源	7,393,903.00	2.07
135	605305	中际联合	7,376,973.51	2.07
136	300731	科创新源	7,374,739.00	2.07
137	601601	中国太保	7,337,588.00	2.06
138	688373	盟科药业	7,309,430.12	2.05
139	002169	智光电气	7,307,918.00	2.05
140	603659	璞泰来	7,260,774.96	2.03
141	300752	隆利科技	7,253,590.00	2.03
142	600517	国网英大	7,245,252.00	2.03
143	300048	合康新能	7,228,619.00	2.02
144	002487	大金重工	7,225,646.45	2.02
145	000729	燕京啤酒	7,220,216.00	2.02
146	002206	海利得	7,197,697.00	2.02
147	601918	新集能源	7,184,722.00	2.01
148	688097	博众精工	7,184,189.26	2.01
149	000690	宝新能源	7,182,662.50	2.01
150	300232	洲明科技	7,173,162.00	2.01

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	300476	胜宏科技	16,874,339.15	4.73
2	000893	亚钾国际	15,742,176.00	4.41
3	002335	科华数据	15,499,729.00	4.34
4	603225	新凤鸣	14,769,710.00	4.14

5	688258	卓易信息	14,216,801.13	3.98
6	002170	芭田股份	13,761,088.00	3.85
7	601168	西部矿业	13,398,378.99	3.75
8	002080	中材科技	13,002,940.00	3.64
9	002284	亚太股份	12,949,407.00	3.63
10	600109	国金证券	12,844,369.00	3.60
11	600531	豫光金铅	12,386,543.00	3.47
12	002414	高德红外	12,214,363.80	3.42
13	002624	完美世界	12,175,157.00	3.41
14	300279	和晶科技	12,128,710.00	3.40
15	002851	麦格米特	11,271,300.00	3.16
16	300369	绿盟科技	11,166,583.60	3.13
17	600428	中远海特	10,426,526.40	2.92
18	600578	京能电力	10,359,808.00	2.90
19	000728	国元证券	10,128,993.00	2.84
20	002545	东方铁塔	9,962,852.00	2.79
21	000600	建投能源	9,700,018.00	2.72
22	300363	博腾股份	9,615,754.00	2.69
23	300400	劲拓股份	9,547,591.62	2.67
24	000932	华菱钢铁	9,463,896.00	2.65
25	300624	万兴科技	9,442,577.00	2.64
26	300972	万辰集团	9,424,772.00	2.64
27	600499	科达制造	9,354,164.00	2.62
28	000783	长江证券	9,353,731.00	2.62
29	600176	中国巨石	9,249,317.00	2.59
30	300079	数码视讯	9,169,523.00	2.57
31	600761	安徽合力	9,147,320.00	2.56
32	600073	光明肉业	9,116,019.94	2.55
33	000027	深圳能源	9,017,849.00	2.53
34	000830	鲁西化工	9,016,603.00	2.53
35	600873	梅花生物	8,996,036.00	2.52
36	603267	鸿远电子	8,984,598.00	2.52
37	000938	紫光股份	8,876,326.80	2.49
38	000987	越秀资本	8,864,677.00	2.48
39	000988	华工科技	8,859,684.00	2.48
40	002469	三维化学	8,814,383.00	2.47
41	600027	华电国际	8,797,963.00	2.46
42	300088	长信科技	8,701,604.00	2.44
43	600673	东阳光	8,654,426.00	2.42
44	002345	潮宏基	8,615,365.00	2.41
45	688183	生益电子	8,568,456.14	2.40
46	000960	锡业股份	8,551,879.00	2.40
47	300241	瑞丰光电	8,550,513.00	2.39

48	002632	道明光学	8,548,199.00	2.39
49	300638	广和通	8,509,751.40	2.38
50	000686	东北证券	8,441,420.38	2.36
51	603228	景旺电子	8,374,723.00	2.35
52	300602	飞荣达	8,320,614.00	2.33
53	603566	普莱柯	8,265,552.00	2.31
54	300731	科创新源	8,180,972.00	2.29
55	002169	智光电气	8,119,075.00	2.27
56	600867	通化东宝	8,104,635.00	2.27
57	603588	高能环境	8,100,807.00	2.27
58	002913	奥士康	8,087,376.00	2.27
59	000726	鲁泰A	8,038,778.00	2.25
60	605020	永和股份	8,037,112.89	2.25
61	300777	中简科技	8,036,996.55	2.25
62	300207	欣旺达	7,994,221.00	2.24
63	000878	云南铜业	7,986,453.00	2.24
64	300684	中石科技	7,981,979.00	2.24
65	002299	圣农发展	7,942,768.00	2.22
66	300752	隆利科技	7,822,357.00	2.19
67	601208	东材科技	7,771,548.00	2.18
68	600497	驰宏锌锗	7,628,966.60	2.14
69	300073	当升科技	7,617,748.56	2.13
70	002736	国信证券	7,586,795.00	2.12
71	002056	横店东磁	7,564,722.00	2.12
72	688002	睿创微纳	7,548,375.39	2.11
73	601311	骆驼股份	7,544,461.00	2.11
74	600795	国电电力	7,535,545.00	2.11
75	603659	璞泰来	7,511,907.80	2.10
76	600731	湖南海利	7,476,312.00	2.09
77	605305	中际联合	7,461,405.60	2.09
78	002303	美盈森	7,451,261.76	2.09
79	000582	北部湾港	7,450,385.82	2.09
80	601688	华泰证券	7,407,997.00	2.07
81	600262	北方股份	7,391,984.00	2.07
82	000792	盐湖股份	7,331,469.00	2.05
83	600704	物产中大	7,306,213.00	2.05
84	000603	盛达资源	7,285,261.00	2.04
85	600378	昊华科技	7,264,874.33	2.03
86	600517	国网英大	7,236,920.00	2.03
87	600219	南山铝业	7,156,546.00	2.00

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	6,811,860,587.90
卖出股票收入（成交）总额	6,015,195,251.30

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,241,205.48	2.75
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	40,241,205.48	2.75

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	400,000	40,241,205.48	2.75

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以及适当对冲系统性风险。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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中，财通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行浙江省分行的处罚。东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

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

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	1,763,701.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,333,319.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,097,021.57

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

本基金本报告期末前十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
中欧数据 挖掘混合 A	12,322	23,253.64	184,089,158.90	64.25%	102,442,251.56	35.75%
中欧数据 挖掘混合 C	28,159	12,810.41	308,188,520.61	85.44%	52,539,873.97	14.56%
合计	40,481	15,989.22	492,277,679.51	76.06%	154,982,125.53	23.94%

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	中欧数据挖掘混合 A	1,601,453.11	0.56%
	中欧数据挖掘混合 C	344.84	0.00%
	合计	1,601,797.95	0.25%

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	中欧数据挖掘混合 A	0
	中欧数据挖掘混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧数据挖掘混合 A	0
	中欧数据挖掘混合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
曲径	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
基金合同生效日 （2016 年 1 月 13 日）基金份额总额	506,409,681.98	—
本报告期期初基金份额总额	148,884,540.64	69,895,138.86
本报告期基金总申购份额	255,481,568.19	456,110,008.70
减：本报告期基金总赎回份额	117,834,698.37	165,276,752.98
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	286,531,410.46	360,728,394.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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 2017 年 12 月 30 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

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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 (%)	

民生证券	2	2,626,235,286.46	20.48	1,144,843.26	20.48	-
浙商证券	1	1,485,880,821.66	11.59	647,749.02	11.59	-
国盛证券	1	1,095,711,890.72	8.55	477,629.12	8.55	-
申万宏源证券	1	898,946,253.01	7.01	391,855.61	7.01	-
东方财富	1	826,628,582.70	6.45	360,331.78	6.45	-
国海证券	1	731,751,909.55	5.71	319,011.54	5.71	-
华创证券	2	659,138,272.47	5.14	287,312.59	5.14	-
中泰证券	2	638,629,846.35	4.98	278,386.96	4.98	-
华福证券	1	610,054,990.36	4.76	265,992.35	4.76	-
中金公司	1	587,067,869.34	4.58	255,906.66	4.58	本报告期新增1个
东方证券	1	575,888,589.90	4.49	251,042.08	4.49	-
国泰海通	2	326,872,835.30	2.55	142,486.82	2.55	-
兴业证券	1	234,988,458.98	1.83	102,464.52	1.83	-
天风证券	1	216,498,143.11	1.69	94,401.14	1.69	-
开源证券	1	213,018,594.58	1.66	92,860.96	1.66	-
国都证券	2	182,480,277.77	1.42	79,560.26	1.42	-
国联民生	1	160,111,326.15	1.25	69,793.62	1.25	本报告期新增1个
东吴证券	1	132,291,985.21	1.03	57,667.21	1.03	-
财通证券	1	131,404,137.41	1.02	57,294.91	1.03	-
长江证券	1	108,972,688.39	0.85	47,500.06	0.85	-

中信证券	2	81,073,615.05	0.63	35,343.08	0.63	-
中信建投	1	73,632,821.09	0.57	32,097.80	0.57	-
国金证券	1	55,720,056.60	0.43	24,288.75	0.43	-
华泰证券	1	51,310,515.26	0.40	22,366.92	0.40	-
华源证券	1	47,635,238.91	0.37	20,764.16	0.37	-
西部证券	1	27,365,424.78	0.21	11,933.61	0.21	-
广发证券	1	24,595,856.65	0.19	10,725.35	0.19	-
西南证券	1	18,080,192.90	0.14	7,881.61	0.14	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增1个
平安证券	1	-	-	-	-	-

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

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

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券，海通证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
民生证 券	-	-	9,000,000.00	2.91	-	-
浙商证 券	-	-	140,300,000.00	45.39	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	54,300,000.00	17.57	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	2,003,558.36	4.99	3,100,000.00	1.00	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券	33,116,969.17	82.52	62,700,000.00	20.28	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	29,000,000.00	9.38	-	-
开源证 券	5,013,289.73	12.49	10,700,000.00	3.46	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
中信证	-	-	-	-	-	-

券						
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

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

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

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券，海通证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

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	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 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
6	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 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
8	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
9	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
10	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
11	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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	2025-06-03
12	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
13	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合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
14	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
15	中欧基金管理有限公司旗下部分基	中国证监会指定媒介	2025-07-19

	金 2025 年第二季度报告的提示性公告		
16	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	2025-07-28
17	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
18	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
19	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
20	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“芯原股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2025-09-04
21	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
22	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-10-28
23	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 05 月 21 日至 2025 年 05 月 22 日	26,800,392.88	27,570,806.90	0.00	54,371,199.78	8.40 %
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