

中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48

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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	79
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	79
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	79
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§ 9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	81
§ 10 开放式基金份额变动	81
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中欧国证 2000 指数增强	
基金主代码	018663	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 18 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	66,459,927.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	018663	018664
报告期末下属分级 基金的份额总额	41,984,161.18 份	24,475,766.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以国证 2000 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 同时，本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合外，再基于量化投资方法，利用公司量化团队开发的量化选股模型相结合，综合考虑基本面因子和动量情绪因子等维度，并通过量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合，以争取实现指数增强型基金的目标。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪国证 2000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	黎忆海	邱珂磊
	联系电话	021-68609600	4008-888-108
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95587
传真		021-50190017	010-56162085
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号中信大厦 82 层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		窦玉明	刘成

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 7 月 18 日-2023 年 12 月 31 日	
	中欧国证 2000 指数 增强 A	中欧国证 2000 指数 增强 C	中欧国证 2000 指数 增强 A	中欧国证 2000 指数 增强 C	中欧国证 2000 指数 增强 A	中欧国证 2000 指数 增强 C
本期已实现收益	16,090,269.70	12,601,889.91	1,299,823.77	255,555.46	6,227,126.01	8,995,701.44
本期利润	17,536,749.20	14,298,935.06	1,449,259.54	619,658.58	8,909,756.94	10,620,409.38

加权平均 基金份额 本期利润	0.3160	0.3351	0.0086	0.0042	-0.0290	-0.0305
本期加权 平均净值 利润率	26.96%	29.27%	0.99%	0.49%	-2.98%	-3.14%
本期基金 份额净值 增长率	32.77%	31.98%	7.62%	6.96%	-2.70%	-2.96%
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	15,205,08 7.09	8,375,732 .93	1,896,039 .67	1,206,002 .53	- 6,392,590 .85	- 5,719,369 .73
期末可供 分配基金 份额利润	0.3622	0.3422	0.0260	0.0170	-0.0270	-0.0296
期末基金 资产净值	57,189,24 8.27	32,851,49 9.60	74,958,21 3.66	71,983,67 1.02	230,536,0 58.11	187,279,6 90.69
期末基金 份额净值	1.3622	1.3422	1.0260	1.0170	0.9730	0.9704
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	39.02%	36.98%	4.71%	3.79%	-2.70%	-2.96%

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

中欧国证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	1.25%	1.11%	1.76%	1.11%	-0.51%	0.00%
过去六个月	16.67%	1.07%	18.39%	1.09%	-1.72%	-0.02%
过去一年	32.77%	1.33%	30.53%	1.42%	2.24%	-0.09%
自基金合同生效 起至今	39.02%	1.58%	21.76%	1.68%	17.26%	-0.10%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

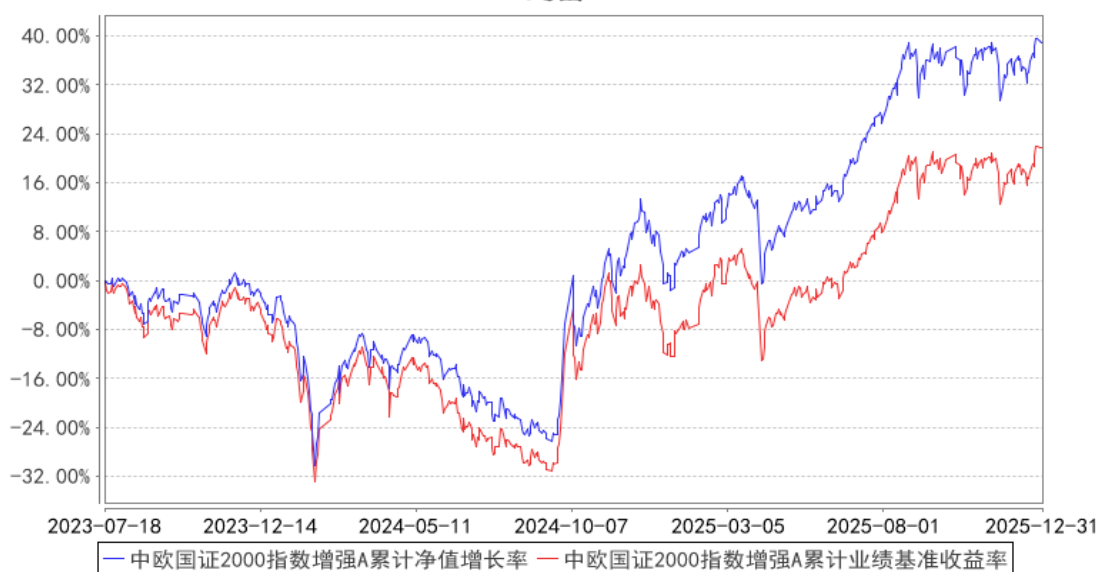
中欧国证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	1.09%	1.11%	1.76%	1.11%	-0.67%	0.00%
过去六个月	16.31%	1.07%	18.39%	1.09%	-2.08%	-0.02%
过去一年	31.98%	1.33%	30.53%	1.42%	1.45%	-0.09%
自基金合同生效 起至今	36.98%	1.58%	21.76%	1.68%	15.22%	-0.10%

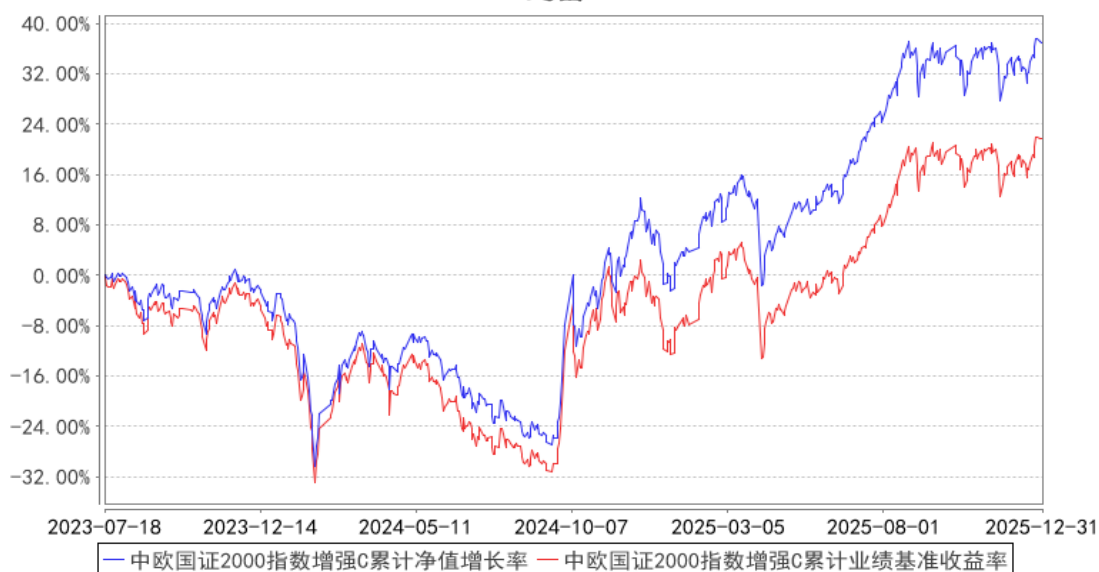
注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

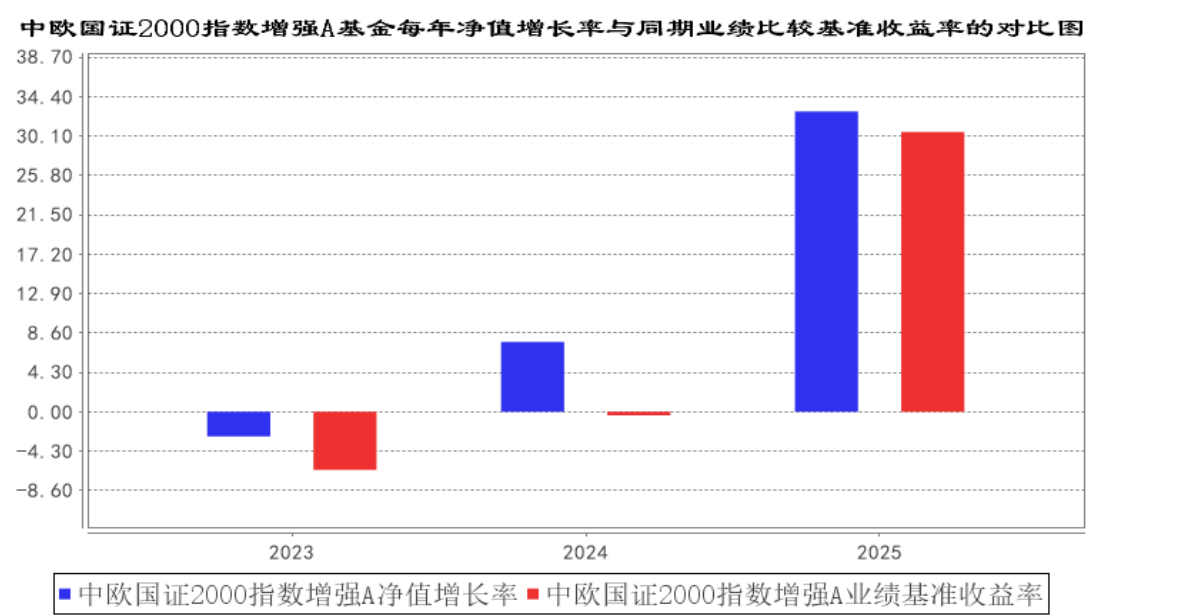
中欧国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



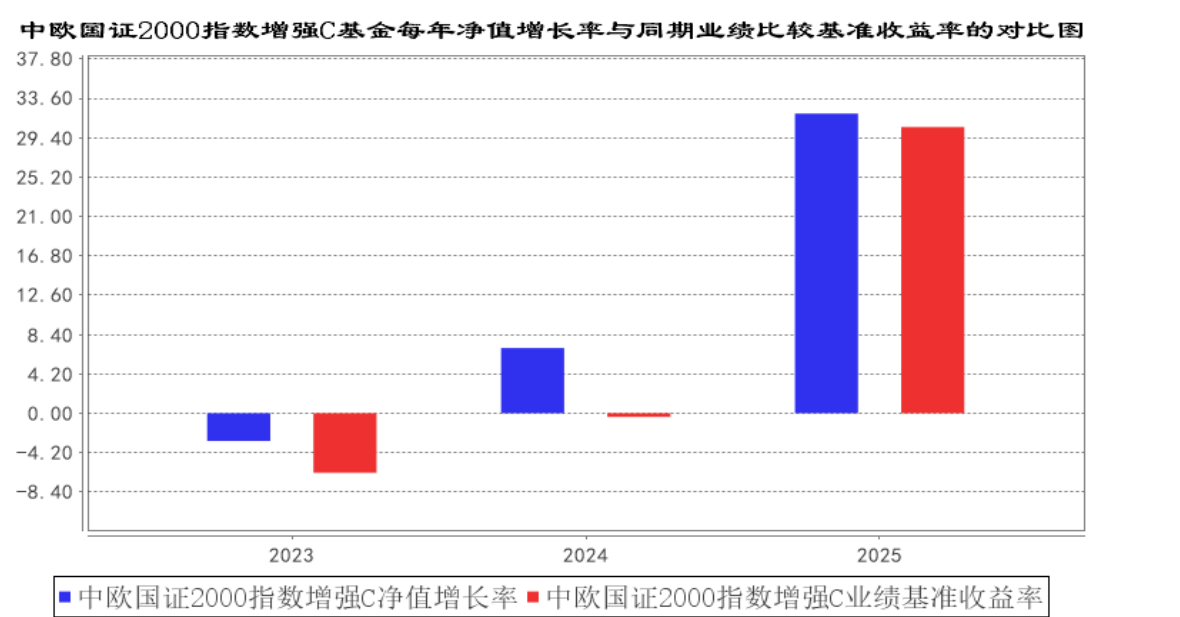
中欧国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，2023 年度数据为 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日数据。



注：本基金合同生效日为 2023 年 7 月 18 日，2023 年度数据为 2023 年 7 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中欧国证 2000 指数增强 A					
年度	每 10 份基金	现金形式发	再投资形式	年度利润分	备注

	份额分红数	放总额	发放总额	配合计	
2024	0.2240	1,798,765.9 6	66,908.26	1,865,674.2 2	-
合计	0.2240	1,798,765.9 6	66,908.26	1,865,674.2 2	-

中欧国证 2000 指数增强 C

年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分 配合计	备注
2024	0.2220	1,586,913.6 7	37,223.90	1,624,137.5 7	-
合计	0.2220	1,586,913.6 7	37,223.90	1,624,137.5 7	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理	2023-07-18	-	9 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任分析师、基金经理助理。
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2024-04-23	-	4 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
宋婷	量化投决会委员 / 基金经理	2025-06-17	-	7 年	历任上海千象资产管理有限公司股票研究员、股票投资经理。2023-07-03 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。

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

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

等相关规定。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少

的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 79 次，其中 77 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，2 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金是以国证 2000 指数为基准的指数增强基金，对标基准保持了相对均衡的风格和行业配置，跟踪误差力争控制在合理范围内。我们会持续跟踪市场风格因子特征，控制组合风险因子暴露，力争让量化组合的超额收益更为平稳。本基金的选股策略是基于交易所深度行情和上市公司基本面等信息，应用数量化的投资方法，系统性地捕捉市场的非有效性，力争获取相对基准的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 32.77%，同期业绩比较基准收益率为 30.53%；基金 C 类份额净值增长率为 31.98%，同期业绩比较基准收益率为 30.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从中长期配置视角，我们重点关注三大方向：首先是科技成长领域，科技创新是推动经济增长的关键动力，半导体、人工智能、生物科技等行业将继续受到政策和市场的双重支持，有望出现新的增长点；储能需求回升，国内新型储能装机规模持续高增长，叠加海外市场复

苏，带动行业景气上行。其次，全球货币宽松背景下，商品的资源稀缺性被重新定价，我们关注相对滞涨的工业金属板块。最后，看好 2026 年 PPI 底部回升，“反内卷”政策深入推进带来的工业品价格与盈利修复的机遇，其中供给格局清晰的基础化工行业值得重点关注。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

（一）落实法律法规，培养合规文化

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

（二）完善制度体系，提高运作效率

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

（三）加强内部审计，强化风险管理

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

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲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

在本报告期内，本基金托管人在托管中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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_B127 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	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独

	立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	张亚旋
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：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	5,883,773.45	8,683,892.22
结算备付金		45,087.10	788,530.92
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	84,410,771.32	137,969,908.75
其中：股票投资		84,410,771.32	137,969,908.75
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	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		41,959.38	534,328.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		90,381,591.25	147,976,660.55
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		198,697.95	781,442.62
应付管理人报酬		77,284.47	147,339.48
应付托管费		7,728.41	14,733.94
应付销售服务费		17,132.55	41,259.83
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	40,000.00	50,000.00
负债合计		340,843.38	1,034,775.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	66,459,927.85	143,839,842.48
未分配利润	7.4.7.8	23,580,820.02	3,102,042.20
净资产合计		90,040,747.87	146,941,884.68
负债和净资产总计		90,381,591.25	147,976,660.55

注： 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 66,459,927.85 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.3622 元，基金份额总额 41,984,161.18 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.3422 元，基金份额总额 24,475,766.67 份。

7.2 利润表

会计主体：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		33,571,820.32	6,059,385.90
1. 利息收入		37,973.93	89,772.47
其中：存款利息收入	7.4.7.9	37,973.93	82,327.29
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	7,445.18
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,307,358.61	4,845,658.42
其中：股票投资收益	7.4.7.10	28,584,078.55	349,081.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
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	339,210.18	360,857.93
股利收益	7.4.7.14	1,384,069.88	4,135,719.15
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	3,143,524.65	1,024,649.81
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	82,963.13	99,305.20
减：二、营业总支出		1,736,136.06	3,990,467.78
1. 管理人报酬		1,146,595.42	2,756,450.60
2. 托管费		114,659.46	275,645.06
3. 销售服务费		295,650.61	768,948.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,230.57	1,423.93
8. 其他费用	7.4.7.18	178,000.00	188,000.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,835,684.26	2,068,918.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,835,684.26	2,068,918.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,835,684.26	2,068,918.12

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	143,839,842.48	-	3,102,042.20	146,941,884.68
二、本期期初净资产	143,839,842.48	-	3,102,042.20	146,941,884.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-77,379,914.63	-	20,478,777.82	-56,901,136.81
（一）、综合收益总额	-	-	31,835,684.26	31,835,684.26
（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）	-77,379,914.63	-	-11,356,906.44	-88,736,821.07
其中：1. 基金申购款	115,947,251.15	-	20,949,736.25	136,896,987.40
2. 基金赎回款	- 193,327,165.78	-	-32,306,642.69	-225,633,808.47
（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	66,459,927.85	-	23,580,820.02	90,040,747.87
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	429,927,709.38	-	-12,111,960.58	417,815,748.80
二、本期期初净资产	429,927,709.38	-	-12,111,960.58	417,815,748.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 286,087,866.90	-	15,214,002.78	-270,873,864.12
(一)、综合收益总额	-	-	2,068,918.12	2,068,918.12
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 286,087,866.90	-	16,634,896.45	-269,452,970.45
其中：1. 基金申购款	173,706,130.51	-	-19,190,882.11	154,515,248.40
2. 基金赎回款	- 459,793,997.41	-	35,825,778.56	-423,968,218.85
(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)	-	-	-3,489,811.79	-3,489,811.79
四、本期期末净资产	143,839,842.48	-	3,102,042.20	146,941,884.68

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

中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1139 号文《关于准予中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金

法》和《中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 769,410,445.02 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61362990_B18 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 18 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 769,717,491.10 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 307,046.08 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 342,646,381.98 份，包含认购利息折合 159,285.06 份；C 类基金的基金份额总额为 427,071,109.12 份，包含认购利息折合 147,761.02 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司。基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金

红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

（3）同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利

息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

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

7. 4. 7 重要财务报表项目的说明

7. 4. 7. 1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	20,004.42	261,386.07
等于：本金	20,000.00	261,114.52
加：应计利息	4.42	271.55
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	5,863,769.03	8,422,506.15
等于：本金	5,863,229.61	8,421,831.56
加：应计利息	539.42	674.59
减：坏账准备	-	-
合计	5,883,773.45	8,683,892.22

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

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		84,549,935.73	-	84,410,771.32	-139,164.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		84,549,935.73	-	84,410,771.32	-139,164.41
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		141,252,597.81	-	137,969,908.75	-3,282,689.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		141,252,597.81	-	137,969,908.75	-3,282,689.06

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

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	40,000.00	50,000.00
合计	40,000.00	50,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,062,173.99	73,062,173.99
本期申购	69,145,389.52	69,145,389.52
本期赎回（以“-”号填列）	-100,223,402.33	-100,223,402.33
本期末	41,984,161.18	41,984,161.18

中欧国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,777,668.49	70,777,668.49
本期申购	46,801,861.63	46,801,861.63
本期赎回（以“-”号填列）	-93,103,763.45	-93,103,763.45
本期末	24,475,766.67	24,475,766.67

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

中欧国证 2000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,018,558.02	-6,122,518.35	1,896,039.67
本期期初	8,018,558.02	-6,122,518.35	1,896,039.67
本期利润	16,090,269.70	1,446,479.50	17,536,749.20
本期基金份额交易产生的变动数	-5,460,806.19	1,233,104.41	-4,227,701.78
其中：基金申购款	18,853,404.30	-4,346,415.14	14,506,989.16
基金赎回款	-24,314,210.49	5,579,519.55	-18,734,690.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,648,021.53	-3,442,934.44	15,205,087.09

中欧国证 2000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,087,174.26	-5,881,171.73	1,206,002.53
本期期初	7,087,174.26	-5,881,171.73	1,206,002.53
本期利润	12,601,889.91	1,697,045.15	14,298,935.06
本期基金份额交易产生的变动数	-9,324,431.64	2,195,226.98	-7,129,204.66
其中：基金申购款	9,585,590.52	-3,142,843.43	6,442,747.09
基金赎回款	-18,910,022.16	5,338,070.41	-13,571,951.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,364,632.53	-1,988,899.60	8,375,732.93

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	5,724.40	10,512.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	25,158.29	54,062.30
结算备付金利息收入	7,091.24	17,752.05
其他	-	-
合计	37,973.93	82,327.29

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	961,030,777.65	2,175,236,453.66
减：卖出股票成本总额	931,507,287.07	2,172,005,259.64
减：交易费用	939,412.03	2,882,112.68
买卖股票差价收入	28,584,078.55	349,081.34

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

无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	339,210.18	360,857.93

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	1,384,069.88	4,135,719.15
其中：证券出借权益补偿收入	—	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	1,384,069.88	4,135,719.15

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	3,143,524.65	1,024,649.81
股票投资	3,143,524.65	1,024,649.81
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,143,524.65	1,024,649.81

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	80,752.55	99,268.15
基金转换费收入	2,210.58	37.05
合计	82,963.13	99,305.20

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	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	178,000.00	188,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	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（%）
中信建投	865,444,938.92	47.16	1,948,026,006.33	47.62

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 （%）
中信建投	161,008.71	47.17	-	-
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 （%）
中信建投	719,005.15	46.92	-	-

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	1,146,595.42	2,756,450.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	429,032.55	1,056,509.19
应支付基金管理人的净管理费	717,562.87	1,699,941.41

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月第 2 个工作日按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

	12 月 31 日	年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	114,659.46	275,645.06

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月第 2 个工作日按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧国证 2000 指数 增强 A	中欧国证 2000 指数 增强 C	合计
国都证券	0.00	78.12	78.12
中欧财富	0.00	1,152.86	1,152.86
中信建投	0.00	194,543.07	194,543.07
合计	0.00	195,774.05	195,774.05
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		
	中欧国证 2000 指数 增强 A	中欧国证 2000 指数 增强 C	合计
国都证券	0.00	327.08	327.08
中欧财富	0.00	479.75	479.75
中信建投	0.00	491,982.77	491,982.77
合计	0.00	492,789.60	492,789.60

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

计算方法如下

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月第 2 个工作日按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	4,214,387.45	15,160.57	4,244,010.09	32,661.57

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	42.94	69	1,132.98	2,962.86	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股流通受限	14.66	40.99	149	2,184.34	6,107.51	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金

融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 7.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,883,773.45	-	-	-	5,883,773.45
结算备付金	45,087.10	-	-	-	45,087.10
交易性金融资产	-	-	-	84,410,771.32	84,410,771.32
应收申购款	-	-	-	41,959.38	41,959.38
资产总计	5,928,860.55	-	-	84,452,730.70	90,381,591.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	198,697.95	198,697.95
应付管理人报酬	-	-	-	77,284.47	77,284.47
应付托管费	-	-	-	7,728.41	7,728.41
应付销售服务费	-	-	-	17,132.55	17,132.55
其他负债	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	340,843.38	340,843.38
利率敏感度缺口	5,928,860.55	-	-	84,111,887.32	90,040,747.87
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	8,683,892.22	-	-	-	8,683,892.22
结算备付金	788,530.92	-	-	-	788,530.92
交易性金融资产	-	-	-	137,969,908.75	137,969,908.75
应收申购款	-	-	-	534,328.66	534,328.66
资产总计	9,472,423.14	-	-	138,504,237.41	147,976,660.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	781,442.62	781,442.62
应付管理人报酬	-	-	-	147,339.48	147,339.48
应付托管费	-	-	-	14,733.94	14,733.94
应付销售服务费	-	-	-	41,259.83	41,259.83
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	1,034,775.87	1,034,775.87
利率敏感度缺口	9,472,423.14	-	-	137,469,461.54	146,941,884.68

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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	84,410,771.32	93.75	137,969,908.75	93.89
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	84,410,771.32	93.75	137,969,908.75	93.89

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%	4,351,467.79	6,898,550.99

	业绩比较基准下降 5%	-4,351,467.79	-6,898,550.99
--	----------------	---------------	---------------

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	84,401,700.95	137,574,952.58
第二层次	-	18,302.40
第三层次	9,070.37	376,653.77
合计	84,410,771.32	137,969,908.75

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	376,653.77	376,653.77

当期购买	0.00	3,317.32	3,317.32
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	376,653.77	376,653.77
当期利得或损失总额	0.00	5,753.05	5,753.05
其中：计入损益的利得或损失	0.00	5,753.05	5,753.05
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	9,070.37	9,070.37
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	5,753.05	5,753.05
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	416,223.19	416,223.19
当期购买	0.00	154,934.34	154,934.34
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	416,223.19	416,223.19
当期利得或损失总额	0.00	221,719.43	221,719.43
其中：计入损益的利得或损失	0.00	221,719.43	221,719.43
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	376,653.77	376,653.77
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	221,719.43	221,719.43

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	9,070.37	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1920-0.1920	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	376,653.77	平均价格亚式期权模型	波动率	0.3521-5.7444	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	84,410,771.32	93.39
	其中：股票	84,410,771.32	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	5,928,860.55	6.56
8	其他各项资产	41,959.38	0.05
9	合计	90,381,591.25	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	79,380.00	0.09
B	采矿业	1,682,033.00	1.87
C	制造业	51,075,613.49	56.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,204,037.00	2.45
E	建筑业	561,887.00	0.62
F	批发和零售业	3,143,492.00	3.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,716,603.00	1.91
H	住宿和餐饮业	101,244.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,854,004.50	6.50
J	金融业	865,915.00	0.96
K	房地产业	869,580.00	0.97
L	租赁和商务服务业	930,448.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	1,688,240.69	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	707,740.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,452.00	0.01
Q	卫生和社会工作	199,085.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	296,743.00	0.33
S	综合	181,668.00	0.20
	合计	72,166,165.68	80.15

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	149,329.00	0.17
B	采矿业	282,509.00	0.31

C	制造业	8,448,630.18	9.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	190,571.00	0.21
E	建筑业	268,089.00	0.30
F	批发和零售业	670,513.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	268,418.00	0.30
H	住宿和餐饮业	12,540.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	541,495.46	0.60
J	金融业	556,963.00	0.62
K	房地产业	250,216.00	0.28
L	租赁和商务服务业	63,075.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	134,489.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	288,271.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,892.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	106,605.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	12,244,605.64	13.60

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600335	国机汽车	113,300	737,583.00	0.82
2	600742	富维股份	69,400	694,000.00	0.77
3	688512	慧智微	60,259	672,490.44	0.75
4	601107	四川成渝	102,800	625,024.00	0.69
5	300134	大富科技	44,800	560,000.00	0.62
6	300098	高新兴	87,400	533,140.00	0.59
7	600388	龙净环保	32,200	525,182.00	0.58

8	688327	云从科技	35,529	510,551.73	0.57
9	002258	利尔化学	37,300	486,765.00	0.54
10	600300	维维股份	136,300	478,413.00	0.53
11	002590	万安科技	31,700	475,500.00	0.53
12	000531	穗恒运 A	72,000	461,520.00	0.51
13	603328	依顿电子	42,000	460,320.00	0.51
14	603505	金石资源	24,200	452,056.00	0.50
15	600814	杭州解百	53,600	434,160.00	0.48
16	000030	富奥股份	75,200	431,648.00	0.48
17	688107	安路科技	15,562	422,975.16	0.47
18	600643	爱建集团	76,000	420,280.00	0.47
19	002016	世荣兆业	72,600	419,628.00	0.47
20	688182	灿勤科技	14,121	416,851.92	0.46
21	688207	格灵深瞳	27,115	412,148.00	0.46
22	603027	千禾味业	39,700	390,251.00	0.43
23	002033	丽江股份	42,500	388,875.00	0.43
24	600572	康恩贝	85,500	381,330.00	0.42
25	601369	陕鼓动力	37,400	374,374.00	0.42
26	688609	九联科技	36,200	369,602.00	0.41
27	300363	博腾股份	15,900	369,516.00	0.41
28	601968	宝钢包装	67,200	358,848.00	0.40
29	300409	道氏技术	15,600	350,844.00	0.39
30	300747	锐科激光	12,900	348,687.00	0.39
31	300249	依米康	23,800	348,194.00	0.39
32	300531	优博讯	19,100	344,564.00	0.38
33	002668	TCL 智家	31,400	325,932.00	0.36
34	600210	紫江企业	44,300	325,605.00	0.36
35	600138	中青旅	32,800	324,064.00	0.36
36	300435	中泰股份	14,000	311,080.00	0.35
37	603317	天味食品	24,800	310,496.00	0.34
38	002075	沙钢股份	53,700	308,775.00	0.34
39	300302	同有科技	17,000	308,380.00	0.34
40	002222	福晶科技	5,400	304,236.00	0.34
41	000923	河钢资源	14,200	300,614.00	0.33
42	301603	乔锋智能	3,900	295,230.00	0.33
43	002057	中钢天源	28,800	293,472.00	0.33
44	002516	旷达科技	43,400	286,006.00	0.32
45	603915	国茂股份	15,400	283,514.00	0.31
46	002707	众信旅游	39,300	282,567.00	0.31
47	300504	天邑股份	18,400	273,976.00	0.30
48	301571	国科天成	4,700	271,096.00	0.30
49	600850	电科数字	9,100	269,724.00	0.30
50	002324	普利特	16,800	268,632.00	0.30

51	002967	广电计量	12,200	268,522.00	0.30
52	300257	开山股份	18,900	265,545.00	0.29
53	002284	亚太股份	17,400	259,782.00	0.29
54	002367	康力电梯	31,600	254,696.00	0.28
55	001896	豫能控股	47,100	244,920.00	0.27
56	300171	东富龙	15,500	243,350.00	0.27
57	688277	天智航	15,409	234,062.71	0.26
58	002454	松芝股份	26,700	232,557.00	0.26
59	300466	赛摩智能	23,100	232,155.00	0.26
60	002419	天虹股份	41,600	230,048.00	0.26
61	002483	润邦股份	31,900	227,766.00	0.25
62	300042	朗科科技	8,800	226,160.00	0.25
63	688321	微芯生物	7,700	224,994.00	0.25
64	688678	福立旺	9,300	224,874.00	0.25
65	002174	游族网络	18,100	221,544.00	0.25
66	002645	华宏科技	14,700	215,208.00	0.24
67	600328	中盐化工	25,900	213,416.00	0.24
68	603969	银龙股份	20,900	211,299.00	0.23
69	601083	锦江航运	18,900	210,924.00	0.23
70	002544	普天科技	6,100	210,389.00	0.23
71	601963	重庆银行	19,400	210,102.00	0.23
72	002117	东港股份	15,200	209,912.00	0.23
73	300267	尔康制药	61,100	208,351.00	0.23
74	600125	铁龙物流	31,800	204,792.00	0.23
75	688001	华兴源创	6,756	203,896.08	0.23
76	688222	成都先导	8,683	203,616.35	0.23
77	300083	创世纪	21,600	198,936.00	0.22
78	600628	新世界	25,200	198,072.00	0.22
79	300602	飞荣达	5,900	195,644.00	0.22
80	603889	新澳股份	24,600	195,570.00	0.22
81	603701	德宏股份	9,700	195,552.00	0.22
82	600114	东睦股份	6,400	195,520.00	0.22
83	300925	法本信息	9,100	193,284.00	0.21
84	605018	长华集团	16,500	191,070.00	0.21
85	600230	沧州大化	12,500	190,750.00	0.21
86	688661	和林微纳	3,683	190,632.08	0.21
87	600478	科力远	27,600	190,164.00	0.21
88	002406	远东传动	23,600	187,384.00	0.21
89	600428	中远海特	26,100	185,310.00	0.21
90	300696	爱乐达	5,800	185,078.00	0.21
91	000600	建投能源	21,600	184,248.00	0.20
92	300149	睿智医药	19,200	183,552.00	0.20
93	600127	金健米业	27,300	183,456.00	0.20

94	688653	康希通信	15,049	182,845.35	0.20
95	600724	宁波富达	31,600	182,016.00	0.20
96	002004	华邦健康	37,800	180,684.00	0.20
97	605196	华通线缆	5,200	180,648.00	0.20
98	600195	中牧股份	22,900	180,223.00	0.20
99	002434	万里扬	18,900	180,117.00	0.20
100	002803	吉宏股份	11,000	179,960.00	0.20
101	600649	城投控股	40,400	179,780.00	0.20
102	002079	苏州固锔	18,800	179,540.00	0.20
103	002556	辉隆股份	29,700	179,388.00	0.20
104	301509	金凯生科	5,300	179,034.00	0.20
105	000767	晋控电力	63,800	178,640.00	0.20
106	300671	富满微	5,600	178,584.00	0.20
107	688127	蓝特光学	4,600	177,054.00	0.20
108	002533	金杯电工	14,100	175,968.00	0.20
109	300709	精研科技	3,700	174,492.00	0.19
110	300036	超图软件	9,500	172,520.00	0.19
111	300072	海新能科	37,300	171,580.00	0.19
112	300244	迪安诊断	10,700	169,595.00	0.19
113	300428	立中集团	7,200	168,120.00	0.19
114	300191	潜能恒信	9,000	166,320.00	0.18
115	000058	深赛格	17,600	165,440.00	0.18
116	601226	华电科工	21,100	165,424.00	0.18
117	002609	捷顺科技	17,800	165,362.00	0.18
118	605277	新亚电子	7,400	162,800.00	0.18
119	603185	弘元绿能	5,300	161,650.00	0.18
120	002950	奥美医疗	14,800	161,616.00	0.18
121	002587	奥拓电子	23,800	160,888.00	0.18
122	002023	海特高新	11,800	159,772.00	0.18
123	300358	楚天科技	16,300	159,577.00	0.18
124	300032	金龙机电	29,400	157,878.00	0.18
125	000601	韶能股份	33,500	157,450.00	0.17
126	002758	浙农股份	15,600	157,092.00	0.17
127	600279	重庆港	28,700	156,702.00	0.17
128	601599	浙文影业	39,200	156,016.00	0.17
129	002204	大连重工	20,300	155,295.00	0.17
130	300791	仙乐健康	6,000	155,160.00	0.17
131	603187	海容冷链	9,800	153,762.00	0.17
132	300415	伊之密	5,900	153,754.00	0.17
133	002626	金达威	7,800	153,738.00	0.17
134	002912	中新赛克	5,100	153,714.00	0.17
135	688488	艾迪药业	9,334	152,424.22	0.17
136	688700	东威科技	4,300	151,704.00	0.17

137	300365	恒华科技	23,700	149,784.00	0.17
138	688550	瑞联新材	3,300	149,523.00	0.17
139	002051	中工国际	16,400	148,748.00	0.17
140	000603	盛达资源	4,800	148,608.00	0.17
141	002755	奥赛康	9,100	148,603.00	0.17
142	300400	劲拓股份	7,500	148,500.00	0.16
143	600888	新疆众和	18,100	148,239.00	0.16
144	300691	联合光电	8,400	145,068.00	0.16
145	601038	一拖股份	10,200	144,534.00	0.16
146	688141	杰华特	3,300	143,319.00	0.16
147	603043	广州酒家	8,100	142,803.00	0.16
148	605300	佳禾食品	12,300	142,680.00	0.16
149	600353	旭光电子	8,700	140,244.00	0.16
150	002577	雷柏科技	7,800	138,918.00	0.15
151	002246	北化股份	7,700	138,754.00	0.15
152	300416	苏试试验	7,700	137,368.00	0.15
153	002121	科陆电子	17,800	137,060.00	0.15
154	600758	辽宁能源	37,400	136,136.00	0.15
155	300447	全信股份	7,400	133,792.00	0.15
156	301507	民生健康	8,700	133,632.00	0.15
157	603132	金徽股份	9,100	133,497.00	0.15
158	600331	宏达股份	10,400	133,016.00	0.15
159	000899	赣能股份	13,400	132,660.00	0.15
160	301607	富特科技	3,300	132,363.00	0.15
161	600963	岳阳林纸	28,200	131,694.00	0.15
162	301487	盟固利	6,000	131,580.00	0.15
163	002975	博杰股份	1,700	130,900.00	0.15
164	300263	隆华科技	14,800	130,832.00	0.15
165	002498	汉缆股份	33,700	129,071.00	0.14
166	605228	神通科技	8,600	128,398.00	0.14
167	002552	宝鼎科技	7,700	127,127.00	0.14
168	002314	南山控股	44,400	126,540.00	0.14
169	688779	五矿新能	16,833	126,079.17	0.14
170	300790	宇瞳光学	4,200	125,622.00	0.14
171	002441	众业达	13,300	125,020.00	0.14
172	300973	立高食品	2,900	124,700.00	0.14
173	600251	冠农股份	13,500	124,605.00	0.14
174	300129	泰胜风能	11,900	124,474.00	0.14
175	002225	濮耐股份	21,800	124,260.00	0.14
176	002233	塔牌集团	13,700	123,437.00	0.14
177	300725	药石科技	3,200	123,392.00	0.14
178	601126	四方股份	4,100	123,328.00	0.14
179	600391	航发科技	3,300	122,430.00	0.14

180	002793	罗欣药业	25,500	122,400.00	0.14
181	600961	株冶集团	7,600	122,360.00	0.14
182	000957	中通客车	10,700	122,194.00	0.14
183	300737	科顺股份	22,100	121,550.00	0.13
184	600389	江山股份	4,800	121,344.00	0.13
185	600459	贵研铂业	6,500	120,965.00	0.13
186	002588	史丹利	12,100	120,758.00	0.13
187	301058	中粮科工	11,000	120,560.00	0.13
188	300386	飞天诚信	6,600	119,196.00	0.13
189	300119	瑞普生物	6,300	118,251.00	0.13
190	300278	华昌达	19,300	117,730.00	0.13
191	300348	长亮科技	7,600	117,648.00	0.13
192	605118	力鼎光电	3,900	117,429.00	0.13
193	600320	振华重工	22,800	117,420.00	0.13
194	002886	沃特股份	5,400	117,288.00	0.13
195	000612	焦作万方	10,600	116,812.00	0.13
196	300505	川金诺	5,200	116,428.00	0.13
197	301219	腾远钴业	1,700	116,076.00	0.13
198	300566	激智科技	6,300	115,605.00	0.13
199	300303	聚飞光电	16,800	114,912.00	0.13
200	000811	冰轮环境	6,200	114,824.00	0.13
201	002446	盛路通信	10,900	114,341.00	0.13
202	300151	昌红科技	7,500	113,100.00	0.13
203	000928	中钢国际	17,000	112,370.00	0.12
204	300043	星辉娱乐	19,800	111,870.00	0.12
205	000833	粤桂股份	5,700	110,922.00	0.12
206	605577	龙版传媒	8,400	109,788.00	0.12
207	600490	鹏欣资源	14,200	109,766.00	0.12
208	605337	李子园	9,200	109,388.00	0.12
209	300328	宜安科技	6,400	109,248.00	0.12
210	002182	宝武镁业	7,100	108,630.00	0.12
211	300471	厚普股份	8,600	108,360.00	0.12
212	603588	高能环境	14,000	108,080.00	0.12
213	300975	商络电子	8,500	107,865.00	0.12
214	000680	山推股份	8,900	106,533.00	0.12
215	600686	金龙汽车	6,000	106,440.00	0.12
216	300168	万达信息	16,400	105,944.00	0.12
217	300382	斯莱克	6,800	105,808.00	0.12
218	600429	三元股份	20,400	105,672.00	0.12
219	300184	力源信息	10,500	104,895.00	0.12
220	002859	洁美科技	3,800	104,880.00	0.12
221	300772	运达股份	5,500	104,830.00	0.12
222	000920	沃顿科技	8,400	104,580.00	0.12

223	002245	蔚蓝锂芯	5,800	103,240.00	0.11
224	300620	光库科技	700	102,935.00	0.11
225	600526	菲达环保	19,100	102,376.00	0.11
226	300299	富春股份	14,400	102,240.00	0.11
227	688131	皓元医药	1,417	102,137.36	0.11
228	002119	康强电子	6,200	102,114.00	0.11
229	002970	锐明技术	2,100	101,850.00	0.11
230	601339	百隆东方	17,500	101,325.00	0.11
231	002922	伊戈尔	3,300	101,046.00	0.11
232	000019	深粮控股	14,500	100,775.00	0.11
233	300349	金卡智能	6,400	100,032.00	0.11
234	300304	云意电气	8,500	98,940.00	0.11
235	600596	新安股份	8,600	98,642.00	0.11
236	688556	高测股份	8,627	98,520.34	0.11
237	688800	瑞可达	1,182	98,106.00	0.11
238	688352	顾中科技	7,754	97,777.94	0.11
239	002897	意华股份	1,800	97,326.00	0.11
240	000936	华西股份	11,800	97,114.00	0.11
241	000931	中关村	19,900	96,913.00	0.11
242	605020	永和股份	3,600	96,804.00	0.11
243	600212	绿能慧充	11,900	95,795.00	0.11
244	002392	北京利尔	12,800	95,744.00	0.11
245	002783	凯龙股份	9,900	94,743.00	0.11
246	002448	中原内配	7,300	94,389.00	0.10
247	600267	海正药业	9,500	93,955.00	0.10
248	000823	超声电子	6,900	93,564.00	0.10
249	000501	武商集团	9,200	93,104.00	0.10
250	600399	抚顺特钢	15,900	92,856.00	0.10
251	600808	马钢股份	22,000	92,840.00	0.10
252	002745	木林森	9,700	92,829.00	0.10
253	600817	宇通重工	8,100	92,097.00	0.10
254	002125	湘潭电化	6,500	92,040.00	0.10
254	002160	常铝股份	17,700	92,040.00	0.10
255	001338	永顺泰	7,600	92,036.00	0.10
256	300232	洲明科技	12,800	90,752.00	0.10
257	688238	和元生物	13,531	90,116.46	0.10
258	300008	天海防务	11,400	89,946.00	0.10
259	688311	盟升电子	1,961	89,421.60	0.10
260	688319	欧林生物	3,489	88,481.04	0.10
261	688062	迈威生物	2,300	88,481.00	0.10
262	688519	南亚新材	1,088	87,975.68	0.10
263	605305	中际联合	2,100	87,486.00	0.10
264	002838	道恩股份	3,600	86,688.00	0.10

265	600278	东方创业	11,400	86,640.00	0.10
266	600787	中储股份	15,300	85,986.00	0.10
267	600496	精工钢构	20,600	85,490.00	0.09
268	300041	回天新材	7,700	85,316.00	0.09
269	688025	杰普特	600	84,942.00	0.09
270	301087	可孚医疗	1,900	84,873.00	0.09
271	000655	金岭矿业	8,900	84,550.00	0.09
272	002960	青鸟消防	8,000	84,080.00	0.09
273	603396	金辰股份	2,500	83,875.00	0.09
274	002011	盾安环境	6,600	83,688.00	0.09
275	000029	深深房 A	3,800	83,676.00	0.09
276	600626	申达股份	17,200	83,076.00	0.09
277	002334	英威腾	9,100	82,082.00	0.09
278	000852	石化机械	11,200	81,424.00	0.09
279	301285	鸿日达	1,200	81,336.00	0.09
280	600962	国投中鲁	3,700	81,141.00	0.09
281	000555	神州信息	4,900	81,095.00	0.09
282	002038	双鹭药业	11,000	81,070.00	0.09
283	300569	天能重工	14,100	80,934.00	0.09
284	300319	麦捷科技	6,900	80,661.00	0.09
285	688048	长光华芯	638	79,973.30	0.09
286	300081	恒信东方	15,300	79,407.00	0.09
287	600108	亚盛集团	25,200	79,380.00	0.09
288	301026	浩通科技	2,800	79,352.00	0.09
289	000672	上峰水泥	6,100	79,239.00	0.09
290	002846	英联股份	4,900	79,086.00	0.09
291	300684	中石科技	1,600	78,752.00	0.09
292	002724	海洋王	11,600	78,648.00	0.09
293	300639	凯普生物	14,600	78,548.00	0.09
294	301251	威尔高	1,500	78,420.00	0.09
295	688333	铂力特	703	78,391.53	0.09
296	300323	华灿光电	9,800	78,204.00	0.09
297	301073	君亭酒店	3,000	78,180.00	0.09
298	600869	远东股份	9,600	77,280.00	0.09
299	002154	报喜鸟	20,000	77,000.00	0.09
300	300489	光智科技	1,500	76,200.00	0.08
301	000915	华特达因	2,300	75,992.00	0.08
302	688300	联瑞新材	1,223	75,936.07	0.08
303	603239	浙江仙通	3,700	75,887.00	0.08
304	603306	华懋科技	1,200	75,612.00	0.08
305	605016	百龙创园	3,500	75,600.00	0.08
306	600318	新力金融	8,400	75,432.00	0.08
307	300577	开润股份	3,500	74,795.00	0.08

308	603912	佳力图	8,700	74,559.00	0.08
309	301626	苏州天脉	400	74,520.00	0.08
310	001267	汇绿生态	3,400	74,460.00	0.08
311	002782	可立克	4,100	74,456.00	0.08
312	001236	弘业期货	7,000	74,200.00	0.08
313	600523	贵航股份	4,700	73,837.00	0.08
314	603166	福达股份	4,700	73,790.00	0.08
315	002534	西子洁能	4,400	73,788.00	0.08
316	603897	长城科技	2,700	73,440.00	0.08
317	688202	美迪西	1,300	73,320.00	0.08
318	601208	东材科技	2,700	73,143.00	0.08
319	002297	博云新材	6,100	73,017.00	0.08
320	603628	清源股份	5,400	72,900.00	0.08
321	603063	禾望电气	2,200	72,754.00	0.08
322	002644	佛慈制药	8,400	72,576.00	0.08
323	688176	亚虹医药	6,300	72,513.00	0.08
324	001376	百通能源	4,300	72,412.00	0.08
325	688428	诺诚健华	3,500	71,820.00	0.08
326	002612	朗姿股份	3,500	71,540.00	0.08
327	605099	共创草坪	2,000	71,380.00	0.08
328	603511	爱慕股份	4,600	71,254.00	0.08
329	300331	苏大维格	2,200	71,192.00	0.08
330	001258	立新能源	10,000	71,100.00	0.08
331	002632	道明光学	5,700	70,965.00	0.08
332	002300	太阳电缆	7,700	70,840.00	0.08
333	002090	金智科技	6,000	70,800.00	0.08
333	002491	通鼎互联	11,800	70,800.00	0.08
334	300049	福瑞医科	1,000	70,410.00	0.08
335	002443	金洲管道	8,600	70,176.00	0.08
336	002100	天康生物	9,500	70,015.00	0.08
337	603121	华培动力	3,300	69,828.00	0.08
338	002810	山东赫达	4,700	69,701.00	0.08
339	000035	中国天楹	12,500	69,000.00	0.08
340	300940	南极光	2,400	68,304.00	0.08
341	688584	上海合晶	3,100	68,014.00	0.08
342	002404	嘉欣丝绸	9,700	67,997.00	0.08
343	300314	戴维医疗	5,400	67,932.00	0.08
344	300206	理邦仪器	5,300	67,787.00	0.08
345	300806	斯迪克	2,200	67,628.00	0.08
346	603489	八方股份	2,200	67,276.00	0.07
347	301316	慧博云通	1,500	67,020.00	0.07
348	300341	麦克奥迪	4,100	66,994.00	0.07
349	002437	誉衡药业	21,800	66,926.00	0.07

350	301039	中集车辆	7,300	66,795.00	0.07
351	301526	国际复材	9,500	66,500.00	0.07
352	002440	闰土股份	8,900	66,483.00	0.07
353	000812	陕西金叶	13,800	65,964.00	0.07
354	002216	三全食品	5,800	65,482.00	0.07
355	600116	三峡水利	10,000	65,400.00	0.07
356	000993	闽东电力	5,400	64,692.00	0.07
357	600367	红星发展	3,700	64,639.00	0.07
358	002398	垒知集团	11,500	64,630.00	0.07
359	301191	菲菱科思	600	64,512.00	0.07
360	002651	利君股份	5,500	64,295.00	0.07
361	300236	上海新阳	1,000	63,760.00	0.07
362	603611	诺力股份	2,600	63,570.00	0.07
363	301062	上海艾录	7,700	63,448.00	0.07
364	002627	三峡旅游	8,500	63,070.00	0.07
365	603127	昭衍新药	1,800	63,018.00	0.07
366	688059	华锐精密	800	62,960.00	0.07
367	601778	晶科科技	16,900	62,868.00	0.07
368	603977	国泰集团	4,500	62,550.00	0.07
369	000777	中核科技	2,400	62,040.00	0.07
370	000886	海南高速	9,000	61,740.00	0.07
371	601609	金田股份	5,700	61,560.00	0.07
372	002165	红宝丽	8,100	61,236.00	0.07
373	002852	道道全	5,800	61,190.00	0.07
374	603058	永吉股份	6,500	60,905.00	0.07
375	002957	科瑞技术	2,800	60,620.00	0.07
376	688549	中巨芯	6,600	60,192.00	0.07
377	002843	泰嘉股份	3,000	60,120.00	0.07
378	300490	华自科技	5,000	59,950.00	0.07
379	603026	石大胜华	800	59,848.00	0.07
380	688150	莱特光电	2,214	59,844.42	0.07
381	300596	利安隆	1,400	59,094.00	0.07
382	002892	科力尔	4,400	59,048.00	0.07
383	300545	联得装备	1,900	58,311.00	0.06
384	600620	天宸股份	8,900	57,850.00	0.06
385	688158	优刻得	2,053	57,668.77	0.06
386	300673	佩蒂股份	3,200	57,376.00	0.06
387	603008	喜临门	2,800	57,344.00	0.06
388	300619	金银河	1,300	57,070.00	0.06
389	603313	梦百合	6,400	56,960.00	0.06
390	001359	平安电工	800	56,800.00	0.06
391	002255	海陆重工	4,500	56,790.00	0.06
392	603012	创力集团	9,400	56,776.00	0.06

393	688432	有研硅	4,560	56,589.60	0.06
394	300183	东软载波	3,800	56,354.00	0.06
395	002345	潮宏基	4,500	56,250.00	0.06
396	301516	中远通	3,600	56,196.00	0.06
397	603061	金海通	400	56,160.00	0.06
398	300067	安诺其	11,200	56,000.00	0.06
399	600654	中安科	14,800	55,796.00	0.06
400	003012	东鹏控股	8,500	55,675.00	0.06
401	603032	德新科技	2,900	55,564.00	0.06
402	002913	奥士康	1,300	55,562.00	0.06
403	300130	新国都	2,000	55,460.00	0.06
404	002545	东方铁塔	3,000	55,350.00	0.06
405	603206	嘉环科技	3,200	55,328.00	0.06
406	301548	崇德科技	1,000	55,310.00	0.06
407	300739	明阳电路	3,000	55,140.00	0.06
408	002158	汉钟精机	2,200	55,066.00	0.06
409	301312	智立方	1,100	54,967.00	0.06
410	002328	新朋股份	8,300	54,863.00	0.06
411	002911	佛燃能源	4,500	54,540.00	0.06
412	603267	鸿远电子	1,000	54,430.00	0.06
413	688179	阿拉丁	4,272	53,357.28	0.06
414	603081	大丰实业	3,800	53,314.00	0.06
415	002615	哈尔斯	6,900	52,923.00	0.06
416	300145	南方泵业	11,200	52,864.00	0.06
417	300835	龙磁科技	800	52,464.00	0.06
418	600158	中体产业	6,000	52,380.00	0.06
419	688510	航亚科技	1,943	52,266.70	0.06
420	001287	中电港	2,300	52,118.00	0.06
421	002947	恒铭达	1,000	52,020.00	0.06
422	600226	亨通股份	9,700	51,701.00	0.06
423	300258	精锻科技	3,600	51,552.00	0.06
424	002823	凯中精密	3,200	51,392.00	0.06
425	000567	海德股份	8,000	51,360.00	0.06
426	002895	川恒股份	1,400	51,324.00	0.06
427	002469	三维化学	6,100	50,935.00	0.06
428	000506	招金黄金	3,900	50,934.00	0.06
429	300065	海兰信	2,800	50,876.00	0.06
430	301286	侨源股份	1,200	50,748.00	0.06
431	301439	泓淋电力	3,400	50,694.00	0.06
432	600012	皖通高速	3,400	50,388.00	0.06
433	002489	浙江永强	13,100	50,173.00	0.06
434	002243	力合科创	5,000	49,750.00	0.06
435	601121	宝地矿业	6,700	49,446.00	0.05

436	603680	今创集团	3,200	49,312.00	0.05
437	603569	长久物流	6,400	48,960.00	0.05
438	688378	奥来德	1,791	48,894.30	0.05
439	000753	漳州发展	6,200	48,794.00	0.05
440	603966	法兰泰克	4,100	48,790.00	0.05
441	603800	洪田股份	1,000	48,770.00	0.05
442	002706	良信股份	4,500	48,510.00	0.05
443	300480	光力科技	2,900	48,459.00	0.05
444	688636	智明达	1,122	48,066.48	0.05
445	603203	快克智能	1,300	47,593.00	0.05
446	603091	众鑫股份	600	47,526.00	0.05
447	300402	宝色股份	2,200	47,322.00	0.05
448	000888	峨眉山 A	3,600	47,232.00	0.05
449	300510	金冠股份	11,400	47,082.00	0.05
450	688588	凌志软件	3,285	47,008.35	0.05
451	301168	通灵股份	1,000	46,700.00	0.05
452	301183	东田微	300	46,527.00	0.05
453	300570	太辰光	400	46,220.00	0.05
454	688620	安凯微	3,832	46,137.28	0.05
455	688049	炬芯科技	871	45,814.60	0.05
456	002378	章源钨业	3,200	45,376.00	0.05
457	603057	紫燕食品	2,200	44,748.00	0.05
458	300201	海伦哲	6,500	44,395.00	0.05
459	300465	高伟达	2,200	44,286.00	0.05
460	300080	易成新能	9,100	44,226.00	0.05
461	300265	通光线缆	3,300	44,220.00	0.05
462	688097	博众精工	1,163	43,903.25	0.05
463	002218	拓日新能	10,100	43,834.00	0.05
464	688733	壹石通	1,512	43,817.76	0.05
465	002698	博实股份	2,600	43,706.00	0.05
466	688372	伟测科技	400	43,636.00	0.05
467	300551	古鳌科技	2,600	43,264.00	0.05
468	002046	国机精工	1,000	43,180.00	0.05
469	002986	宇新股份	4,000	43,040.00	0.05
470	301511	德福科技	1,200	42,948.00	0.05
471	300811	铂科新材	600	42,786.00	0.05
472	601003	柳钢股份	8,500	42,755.00	0.05
473	300741	华宝股份	2,300	42,734.00	0.05
474	300101	振芯科技	1,500	42,645.00	0.05
475	603878	武进不锈	4,600	42,596.00	0.05
476	300139	晓程科技	1,400	42,504.00	0.05
477	300443	金雷股份	1,500	42,195.00	0.05
478	000534	万泽股份	1,900	41,800.00	0.05

479	001337	四川黄金	1,500	41,790.00	0.05
480	688205	德科立	299	41,106.52	0.05
481	300420	五洋自控	10,300	41,097.00	0.05
482	603815	交建股份	5,500	40,920.00	0.05
483	300133	华策影视	4,900	40,768.00	0.05
484	601068	中铝国际	7,700	40,733.00	0.05
485	002301	齐心集团	5,300	40,704.00	0.05
486	000576	甘化科工	3,800	40,014.00	0.04
487	002073	软控股份	4,900	39,935.00	0.04
488	002020	京新药业	2,100	39,858.00	0.04
489	000652	泰达股份	9,500	39,520.00	0.04
489	600094	大名城	9,500	39,520.00	0.04
490	300056	中创环保	4,800	39,456.00	0.04
491	300586	美联新材	3,600	39,204.00	0.04
492	688003	天准科技	664	39,109.60	0.04
493	688505	复旦张江	4,700	39,010.00	0.04
494	601900	南方传媒	2,900	38,889.00	0.04
495	300057	万顺新材	6,800	38,692.00	0.04
496	000065	北方国际	3,100	38,626.00	0.04
497	688443	智翔金泰	1,417	38,599.08	0.04
498	002036	联创电子	3,500	38,570.00	0.04
499	002511	中顺洁柔	4,500	38,520.00	0.04
500	603929	亚翔集成	400	38,200.00	0.04
501	002428	云南锗业	1,200	38,100.00	0.04
502	301328	维峰电子	800	38,056.00	0.04
503	300893	松原安全	1,600	37,824.00	0.04
504	002833	弘亚数控	2,300	37,651.00	0.04
505	002354	天娱数科	5,900	37,583.00	0.04
506	603308	应流股份	900	37,575.00	0.04
507	002344	海宁皮城	7,900	37,446.00	0.04
508	300272	开能健康	5,000	37,400.00	0.04
509	300530	领湃科技	1,400	37,380.00	0.04
510	002096	易普力	2,800	37,296.00	0.04
511	003037	三和管桩	4,600	37,260.00	0.04
512	601890	亚星锚链	3,600	37,044.00	0.04
513	002137	实益达	4,300	36,894.00	0.04
513	300011	鼎汉技术	4,300	36,894.00	0.04
514	002824	和胜股份	1,900	36,860.00	0.04
515	603040	新坐标	400	36,796.00	0.04
516	002614	奥佳华	5,000	36,550.00	0.04
517	603015	弘讯科技	2,900	36,395.00	0.04
518	300053	航宇微	1,900	36,138.00	0.04
519	300219	鸿利智汇	5,000	36,050.00	0.04

520	601089	福元医药	1,500	36,000.00	0.04
521	001328	登康口腔	900	35,532.00	0.04
522	603002	宏昌电子	4,800	35,472.00	0.04
523	603031	安孚科技	800	35,440.00	0.04
524	688380	中微半导	1,100	35,365.00	0.04
525	600186	莲花控股	5,900	35,282.00	0.04
526	300241	瑞丰光电	6,300	35,217.00	0.04
527	300048	合康新能	5,900	35,105.00	0.04
528	605116	奥锐特	1,400	35,070.00	0.04
529	300196	长海股份	2,400	34,944.00	0.04
530	300352	北信源	5,700	34,941.00	0.04
531	000837	秦川机床	2,700	34,776.00	0.04
532	603283	赛腾股份	800	34,656.00	0.04
533	002048	宁波华翔	1,100	34,606.00	0.04
534	300693	盛弘股份	900	34,452.00	0.04
534	605338	巴比食品	1,100	34,452.00	0.04
535	300068	南都电源	2,200	34,188.00	0.04
536	300997	欢乐家	1,300	33,995.00	0.04
537	301391	卡莱特	400	33,940.00	0.04
538	688531	日联科技	511	33,741.33	0.04
539	300698	万马科技	800	33,704.00	0.04
540	300909	汇创达	700	33,670.00	0.04
541	002728	特一药业	3,100	33,635.00	0.04
542	301150	中一科技	800	33,592.00	0.04
543	301180	万祥科技	2,000	33,400.00	0.04
544	688799	华纳药厂	700	33,390.00	0.04
545	002946	新乳业	1,800	33,354.00	0.04
546	300629	新劲刚	1,400	33,292.00	0.04
547	300401	花园生物	2,200	33,264.00	0.04
548	300963	中洲特材	1,600	33,248.00	0.04
549	600179	安通控股	6,000	33,120.00	0.04
550	300177	中海达	3,200	33,056.00	0.04
551	300787	海能实业	2,800	32,900.00	0.04
552	300872	天阳科技	1,600	32,896.00	0.04
553	605008	长鸿高科	2,300	32,821.00	0.04
554	000422	湖北宜化	2,300	32,683.00	0.04
555	002536	飞龙股份	1,100	32,670.00	0.04
556	605399	晨光新材	2,400	32,448.00	0.04
557	688173	希荻微	2,179	32,031.30	0.04
558	603663	三祥新材	900	31,815.00	0.04
559	688639	华恒生物	975	31,765.50	0.04
560	000523	红棉股份	8,400	31,668.00	0.04
561	300821	东岳硅材	2,700	31,482.00	0.03

562	603258	电魂网络	1,700	31,467.00	0.03
563	301522	上大股份	800	31,336.00	0.03
564	301268	铭利达	1,700	30,991.00	0.03
565	603711	香飘飘	2,300	30,889.00	0.03
566	002167	东方锆业	2,500	30,875.00	0.03
567	688410	山外山	2,062	30,868.14	0.03
568	688392	骄成超声	275	30,855.00	0.03
569	300105	龙源技术	4,300	30,788.00	0.03
570	600313	农发种业	4,700	30,268.00	0.03
571	002560	通达股份	3,000	30,240.00	0.03
572	603901	永创智能	2,100	29,820.00	0.03
573	300968	格林精密	2,000	29,780.00	0.03
574	603758	秦安股份	1,700	29,563.00	0.03
575	688362	甬矽电子	912	29,557.92	0.03
576	301293	三博脑科	500	29,490.00	0.03
577	300227	光韵达	3,200	29,472.00	0.03
578	000045	深纺织 A	2,400	29,328.00	0.03
579	300131	英唐智控	2,000	29,320.00	0.03
580	600121	郑州煤电	7,000	29,190.00	0.03
581	300942	易瑞生物	3,100	29,171.00	0.03
582	300019	硅宝科技	1,400	28,910.00	0.03
582	300045	华力创通	1,000	28,910.00	0.03
583	300292	吴通控股	6,400	28,864.00	0.03
584	301179	泽宇智能	1,800	28,458.00	0.03
585	603109	神驰机电	1,100	28,369.00	0.03
586	301017	漱玉平民	1,900	28,025.00	0.03
587	600993	马应龙	1,000	28,000.00	0.03
588	688147	微导纳米	436	27,376.44	0.03
589	002081	金螳螂	8,000	27,360.00	0.03
590	301127	武汉天源	1,800	27,342.00	0.03
591	002478	常宝股份	3,200	27,104.00	0.03
592	002866	传艺科技	1,500	27,015.00	0.03
593	002303	美盈森	6,700	27,001.00	0.03
594	002538	司尔特	4,200	26,964.00	0.03
595	688630	芯碁微装	200	26,906.00	0.03
596	603103	横店影视	1,600	26,528.00	0.03
597	300769	德方纳米	600	26,406.00	0.03
598	688298	东方生物	1,100	25,773.00	0.03
599	001301	尚太科技	300	25,743.00	0.03
600	002918	蒙娜丽莎	1,800	25,614.00	0.03
601	300984	金沃股份	300	25,464.00	0.03
602	688031	星环科技	232	25,100.08	0.03
603	300138	晨光生物	2,000	24,820.00	0.03

604	300228	富瑞特装	2,500	24,725.00	0.03
605	688166	博瑞医药	500	24,530.00	0.03
606	600345	长江通信	700	24,262.00	0.03
607	600826	兰生股份	2,300	24,242.00	0.03
608	601020	华钰矿业	900	24,174.00	0.03
609	301217	铜冠铜箔	700	23,996.00	0.03
610	688486	龙迅股份	317	23,556.27	0.03
611	300440	运达科技	1,900	23,389.00	0.03
612	605108	同庆楼	1,200	23,064.00	0.03
613	601801	XD 皖新传	3,500	23,030.00	0.03
614	600982	宁波能源	5,300	23,002.00	0.03
615	688478	晶升股份	613	22,932.33	0.03
616	600710	苏美达	2,100	22,701.00	0.03
617	688382	益方生物	829	22,581.96	0.03
618	300377	赢时胜	1,000	22,550.00	0.03
619	688315	诺禾致源	1,691	22,456.48	0.02
620	002695	煌上煌	1,900	22,306.00	0.02
621	688209	英集芯	1,118	22,292.92	0.02
622	002175	东方智造	5,000	22,150.00	0.02
623	002254	泰和新材	2,200	22,044.00	0.02
624	002993	奥海科技	500	21,855.00	0.02
625	002658	雪迪龙	2,400	21,672.00	0.02
626	605009	豪悦护理	700	21,630.00	0.02
627	688343	云天励飞	282	21,454.56	0.02
628	301215	中汽股份	3,100	21,235.00	0.02
629	600738	丽尚国潮	4,100	21,156.00	0.02
630	603301	振德医疗	300	21,150.00	0.02
631	002730	电光科技	1,400	21,056.00	0.02
632	002212	天融信	2,300	20,861.00	0.02
633	300762	上海瀚讯	500	20,840.00	0.02
634	002734	利民股份	1,300	20,722.00	0.02
635	300843	胜蓝股份	400	20,624.00	0.02
636	600602	云赛智联	1,100	20,559.00	0.02
637	000797	中国武夷	5,200	20,436.00	0.02
638	688208	道通科技	554	20,387.20	0.02
639	301128	强瑞技术	200	20,182.00	0.02
640	600645	中源协和	800	20,160.00	0.02
641	688776	国光电气	200	20,148.00	0.02
642	002636	金安国纪	1,200	20,052.00	0.02
643	603181	皇马科技	1,400	20,006.00	0.02
644	002928	华夏航空	1,800	19,890.00	0.02
645	002666	德联集团	3,600	19,836.00	0.02
646	603013	亚普股份	800	19,736.00	0.02

647	605376	博迁新材	300	19,620.00	0.02
648	002026	山东威达	1,300	19,565.00	0.02
649	603997	继峰股份	1,400	19,460.00	0.02
650	300290	荣科科技	700	19,271.00	0.02
651	300360	炬华科技	1,100	19,129.00	0.02
652	002791	坚朗五金	900	19,089.00	0.02
653	002961	瑞达期货	700	18,949.00	0.02
654	600531	豫光金铅	1,600	18,800.00	0.02
654	603612	索通发展	800	18,800.00	0.02
654	688091	上海谊众	400	18,800.00	0.02
655	603629	利通电子	700	18,655.00	0.02
656	688516	奥特维	406	18,375.56	0.02
657	002290	禾盛新材	400	18,280.00	0.02
658	002882	金龙羽	600	18,096.00	0.02
659	300990	同飞股份	200	18,030.00	0.02
660	002539	云图控股	1,500	17,730.00	0.02
661	002522	浙江众成	3,100	17,484.00	0.02
662	002941	新疆交建	1,100	17,435.00	0.02
663	301500	飞南资源	1,100	17,259.00	0.02
664	002531	天顺风能	2,500	17,150.00	0.02
665	002317	众生药业	900	17,082.00	0.02
666	300733	西菱动力	900	16,911.00	0.02
667	600259	中稀有色	300	16,878.00	0.02
668	300708	聚灿光电	1,900	16,872.00	0.02
669	301205	联特科技	100	16,851.00	0.02
670	002664	信质集团	700	16,772.00	0.02
671	688376	美埃科技	290	16,767.80	0.02
672	300850	新强联	400	16,548.00	0.02
673	601619	嘉泽新能	3,700	16,428.00	0.02
674	600569	安阳钢铁	7,300	16,425.00	0.02
675	002416	爱施德	1,300	16,354.00	0.02
676	600475	华光环能	900	16,353.00	0.02
677	300488	恒锋工具	500	16,320.00	0.02
678	300389	艾比森	1,000	16,230.00	0.02
679	300066	三川智慧	2,600	16,198.00	0.02
680	002237	恒邦股份	1,200	16,104.00	0.02
681	603158	腾龙股份	1,500	15,900.00	0.02
682	002985	北摩高科	500	15,865.00	0.02
682	603355	莱克电气	500	15,865.00	0.02
683	603690	至纯科技	500	15,725.00	0.02
684	605389	长龄液压	200	15,600.00	0.02
685	603093	南华期货	800	15,592.00	0.02
686	300451	创业慧康	3,200	15,488.00	0.02

687	688258	卓易信息	200	15,314.00	0.02
688	603098	森特股份	1,100	15,301.00	0.02
689	603610	麒盛科技	800	15,240.00	0.02
690	300552	万集科技	500	15,180.00	0.02
691	300005	探路者	1,400	15,162.00	0.02
692	600284	浦东建设	1,800	15,120.00	0.02
693	688275	万润新能	200	15,080.00	0.02
694	603169	兰石重装	1,400	14,924.00	0.02
695	002540	亚太科技	2,100	14,868.00	0.02
696	300581	晨曦航空	900	14,841.00	0.02
697	688087	英科再生	481	14,824.42	0.02
698	688259	创耀科技	346	14,462.80	0.02
699	688033	天宜新材	1,868	14,383.60	0.02
700	301349	信德新材	300	14,073.00	0.02
701	605183	确成股份	700	13,944.00	0.02
702	300006	莱美药业	2,700	13,878.00	0.02
703	002919	名臣健康	600	13,794.00	0.02
704	603496	恒为科技	500	13,640.00	0.02
705	300861	美畅股份	900	13,437.00	0.01
706	003019	宸展光电	400	13,392.00	0.01
707	600846	同济科技	1,000	13,150.00	0.01
708	000090	天健集团	3,500	12,950.00	0.01
709	000532	华金资本	800	12,896.00	0.01
710	002206	海利得	2,200	12,870.00	0.01
711	603683	晶华新材	500	12,790.00	0.01
712	002438	江苏神通	800	12,720.00	0.01
713	301376	致欧科技	700	12,649.00	0.01
714	300047	天源迪科	1,000	12,550.00	0.01
714	600662	外服控股	2,500	12,550.00	0.01
715	688548	广钢气体	858	12,475.32	0.01
716	688390	固德威	200	12,426.00	0.01
717	300469	信息发展	200	12,360.00	0.01
718	601010	文峰股份	4,500	12,285.00	0.01
719	300353	东土科技	600	12,216.00	0.01
720	601086	国芳集团	1,200	12,204.00	0.01
721	301202	朗威股份	300	12,120.00	0.01
722	603016	新宏泰	400	12,048.00	0.01
723	603587	地素时尚	900	12,024.00	0.01
724	301367	瑞迈特	140	11,999.40	0.01
725	002365	永安药业	800	11,936.00	0.01
726	601326	秦港股份	3,400	11,866.00	0.01
727	301000	肇民科技	300	11,811.00	0.01
728	002870	香山股份	300	11,796.00	0.01

729	002733	雄韬股份	600	11,778.00	0.01
730	300158	振东制药	2,000	11,620.00	0.01
731	605056	XD 咸亨国	700	11,550.00	0.01
732	603366	日出东方	1,200	11,532.00	0.01
733	300434	金石亚药	1,100	11,308.00	0.01
734	002956	西麦食品	400	11,248.00	0.01
735	002580	圣阳股份	900	11,196.00	0.01
736	603300	海南华铁	1,400	10,990.00	0.01
737	300752	隆利科技	600	10,950.00	0.01
738	002103	广博股份	1,200	10,944.00	0.01
739	600713	南京医药	2,000	10,920.00	0.01
740	300224	正海磁材	700	10,822.00	0.01
741	301071	力量钻石	300	10,752.00	0.01
742	300345	华民股份	1,700	10,659.00	0.01
743	603618	杭电股份	1,300	10,478.00	0.01
744	688559	海目星	216	10,380.96	0.01
745	002523	天桥起重	2,400	10,296.00	0.01
746	300040	九洲集团	1,700	10,234.00	0.01
747	300310	宜通世纪	1,700	10,047.00	0.01
748	301153	中科江南	400	9,888.00	0.01
749	688105	诺唯赞	488	9,769.76	0.01
750	002292	奥飞娱乐	1,100	9,735.00	0.01
751	300245	天玑科技	800	9,672.00	0.01
752	001288	运机集团	300	9,585.00	0.01
753	002401	中远海科	600	9,558.00	0.01
754	300740	水羊股份	400	9,536.00	0.01
755	603167	渤海轮渡	1,000	9,430.00	0.01
756	603004	鼎龙科技	400	9,388.00	0.01
757	002869	金溢科技	400	9,304.00	0.01
758	000061	农产品	900	9,261.00	0.01
759	002315	焦点科技	200	9,152.00	0.01
759	688236	XD 春立医	400	9,152.00	0.01
760	002467	二六三	1,500	9,135.00	0.01
761	300815	玉禾田	400	9,112.00	0.01
762	300354	东华测试	200	9,100.00	0.01
763	600351	亚宝药业	1,400	9,086.00	0.01
764	002955	鸿合科技	300	9,081.00	0.01
765	300324	旋极信息	1,500	8,970.00	0.01
766	002896	中大力德	100	8,936.00	0.01
767	300397	天和防务	600	8,892.00	0.01
768	300210	森远股份	1,000	8,890.00	0.01
769	301628	强达电路	100	8,875.00	0.01
770	603533	掌阅科技	400	8,848.00	0.01

771	300663	科蓝软件	500	8,820.00	0.01
772	301172	君逸数码	400	8,804.00	0.01
773	300188	国投智能	600	8,766.00	0.01
774	688212	澳华内镜	200	8,742.00	0.01
775	300453	三鑫医疗	1,000	8,720.00	0.01
776	603337	杰克科技	200	8,666.00	0.01
777	301525	儒竞科技	100	8,634.00	0.01
778	301099	雅创电子	200	8,512.00	0.01
778	301149	隆华新材	800	8,512.00	0.01
779	002860	星帅尔	600	8,460.00	0.01
779	603520	司太立	900	8,460.00	0.01
780	300192	科德教育	400	8,452.00	0.01
781	603273	天元智能	400	8,396.00	0.01
782	300099	尤洛卡	1,100	8,283.00	0.01
783	000880	潍柴重机	300	8,196.00	0.01
784	300166	东方国信	800	8,176.00	0.01
785	000727	冠捷科技	3,200	8,128.00	0.01
786	688518	联赢激光	334	8,112.86	0.01
787	002183	怡亚通	1,700	8,092.00	0.01
788	002929	润建股份	200	7,962.00	0.01
789	603590	康辰药业	200	7,950.00	0.01
790	002943	宇晶股份	200	7,920.00	0.01
791	301596	瑞迪智驱	100	7,862.00	0.01
792	300307	慈星股份	1,100	7,777.00	0.01
793	603348	文灿股份	400	7,704.00	0.01
794	603339	四方科技	600	7,698.00	0.01
795	300802	矩子科技	400	7,656.00	0.01
796	603583	捷昌驱动	200	7,614.00	0.01
797	300497	富祥药业	500	7,555.00	0.01
798	300882	万胜智能	400	7,520.00	0.01
799	301270	汉仪股份	200	7,476.00	0.01
800	603223	恒通股份	800	7,440.00	0.01
801	300918	南山智尚	400	7,436.00	0.01
802	603324	盛剑科技	300	7,431.00	0.01
803	605218	伟时电子	400	7,380.00	0.01
804	000028	国药一致	300	7,368.00	0.01
805	002988	豪美新材	200	7,360.00	0.01
805	600223	福瑞达	1,000	7,360.00	0.01
806	603319	美湖股份	200	7,316.00	0.01
807	688552	航天南湖	200	7,264.00	0.01
808	603662	柯力传感	100	7,200.00	0.01
809	301160	翔楼新材	100	7,189.00	0.01
810	301095	广立微	100	7,171.00	0.01

811	603085	天成自控	600	7,110.00	0.01
812	688246	嘉和美康	304	7,068.00	0.01
813	600273	嘉化能源	800	6,992.00	0.01
814	002635	安洁科技	500	6,930.00	0.01
815	002646	天佑德酒	800	6,920.00	0.01
816	301307	美利信	200	6,916.00	0.01
817	301195	北路智控	200	6,906.00	0.01
818	688177	百奥泰	298	6,895.72	0.01
819	600751	海航科技	1,800	6,894.00	0.01
820	600433	冠豪高新	2,100	6,888.00	0.01
821	301047	义翘神州	100	6,760.00	0.01
822	603687	大胜达	700	6,671.00	0.01
823	301558	三态股份	800	6,520.00	0.01
824	300962	中金辐照	400	6,492.00	0.01
825	002132	恒星科技	1,800	6,390.00	0.01
826	300582	英飞特	400	6,388.00	0.01
827	300617	安靠智电	200	6,380.00	0.01
828	002034	旺能环境	400	6,360.00	0.01
829	002550	千红制药	800	6,288.00	0.01
830	605179	一鸣食品	300	6,273.00	0.01
831	301368	丰立智能	100	6,267.00	0.01
832	688108	赛诺医疗	324	6,233.76	0.01
833	603111	康尼机电	900	6,165.00	0.01
834	300685	艾德生物	300	6,138.00	0.01
835	002150	通润装备	300	6,030.00	0.01
836	600201	生物股份	400	6,028.00	0.01
837	300197	节能铁汉	3,400	6,018.00	0.01
838	688593	新相微	298	6,013.64	0.01
839	300976	达瑞电子	100	6,007.00	0.01
840	601882	海天精工	300	5,838.00	0.01
841	300170	汉得信息	300	5,676.00	0.01
842	300910	瑞丰新材	100	5,655.00	0.01
843	603713	密尔克卫	100	5,577.00	0.01
844	600059	古越龙山	600	5,556.00	0.01
845	603848	好太太	300	5,481.00	0.01
846	603995	甬金股份	300	5,424.00	0.01
847	300199	翰宇药业	300	5,370.00	0.01
848	300860	锋尚文化	200	5,360.00	0.01
849	603078	江化微	300	5,355.00	0.01
850	601069	西部黄金	200	5,336.00	0.01
851	002768	国恩股份	100	5,268.00	0.01
852	603112	华翔股份	300	5,211.00	0.01
853	688403	汇成股份	316	5,176.08	0.01

854	002891	中宠股份	100	5,176.00	0.01
854	003020	立方制药	200	5,176.00	0.01
855	002116	中国海诚	500	5,140.00	0.01
856	603867	新化股份	200	5,080.00	0.01
857	300399	天利科技	200	5,070.00	0.01
858	688707	振华新材	313	4,335.05	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	600983	惠而浦	40,600	388,136.00	0.43
2	601901	方正证券	37,700	294,060.00	0.33
3	600288	大恒科技	17,800	266,644.00	0.30
4	600739	辽宁成大	22,300	249,314.00	0.28
5	002281	光迅科技	3,500	244,825.00	0.27
6	688280	精进电动	24,600	214,020.00	0.24
7	002436	兴森科技	9,900	209,583.00	0.23
8	002902	铭普光磁	8,900	201,941.00	0.22
9	600378	昊华科技	6,300	201,348.00	0.22
10	600497	驰宏锌锗	27,400	200,294.00	0.22
11	300735	光弘科技	7,100	176,506.00	0.20
12	601918	新集能源	23,400	154,674.00	0.17
13	000683	博源化工	20,700	154,008.00	0.17
14	002624	完美世界	9,100	149,149.00	0.17
15	603172	万丰股份	8,200	145,960.00	0.16
16	600522	中天科技	7,400	134,088.00	0.15
17	002014	永新股份	10,800	128,736.00	0.14
18	300074	华平股份	27,900	128,619.00	0.14
19	603797	联泰环保	26,300	122,821.00	0.14
20	600676	交运股份	20,500	120,540.00	0.13
21	002209	达意隆	6,700	108,004.00	0.12
22	001389	广合科技	1,300	106,119.00	0.12
23	300567	精测电子	1,100	100,320.00	0.11
24	600970	中材国际	9,600	99,744.00	0.11
25	002984	森麒麟	4,600	97,382.00	0.11
26	603697	有友食品	7,700	94,325.00	0.10
27	688079	美迪凯	8,300	93,956.00	0.10
28	600549	厦门钨业	2,200	90,332.00	0.10
29	601108	财通证券	10,200	88,944.00	0.10
30	002157	正邦科技	26,800	86,832.00	0.10
31	600487	亨通光电	3,500	86,555.00	0.10
32	300502	新易盛	200	86,176.00	0.10
33	600148	长春一东	4,200	82,194.00	0.09

34	002667	威领股份	6,200	81,158.00	0.09
35	600778	友好集团	12,100	80,707.00	0.09
36	002858	力盛体育	5,100	76,500.00	0.08
37	300018	中元股份	6,900	75,900.00	0.08
38	601318	中国平安	1,100	75,240.00	0.08
39	301081	严牌股份	7,400	74,962.00	0.08
40	002811	郑中设计	5,000	74,200.00	0.08
41	301152	天力锂能	2,400	73,344.00	0.08
42	000702	正虹科技	10,800	72,144.00	0.08
43	600100	同方股份	7,500	66,900.00	0.07
44	300920	润阳科技	1,400	64,498.00	0.07
45	300438	鹏辉能源	1,200	63,864.00	0.07
46	603596	伯特利	1,200	61,524.00	0.07
47	300394	天孚通信	300	60,909.00	0.07
48	300604	长川科技	600	60,786.00	0.07
49	600748	上实发展	11,000	59,620.00	0.07
50	000060	中金岭南	9,800	57,330.00	0.06
51	600725	云维股份	13,500	56,430.00	0.06
52	603568	伟明环保	2,200	55,836.00	0.06
53	600067	冠城新材	13,300	55,195.00	0.06
54	002787	华源控股	4,300	53,535.00	0.06
55	000977	浪潮信息	800	53,280.00	0.06
56	600761	安徽合力	2,500	52,225.00	0.06
57	600128	苏豪弘业	4,600	50,554.00	0.06
58	000657	中钨高新	1,800	49,878.00	0.06
59	002412	汉森制药	7,700	49,357.00	0.05
60	600166	福田汽车	16,900	49,348.00	0.05
61	300285	国瓷材料	1,800	49,338.00	0.05
62	002133	广宇集团	14,500	49,155.00	0.05
63	002830	名雕股份	2,500	48,750.00	0.05
64	600844	金煤科技	16,900	48,672.00	0.05
65	002442	龙星科技	7,800	48,438.00	0.05
66	000415	渤海租赁	11,900	48,195.00	0.05
67	301107	瑜欣电子	1,700	48,008.00	0.05
68	603937	丽岛新材	4,000	47,960.00	0.05
69	301321	翰博高新	2,500	47,625.00	0.05
70	300283	温州宏丰	6,300	47,439.00	0.05
71	600795	国电电力	9,400	47,376.00	0.05
72	600830	香溢融通	4,900	46,893.00	0.05
73	002091	江苏国泰	5,100	46,053.00	0.05
74	600326	西藏天路	4,100	45,223.00	0.05
75	301086	鸿富瀚	400	44,756.00	0.05
76	603456	九洲药业	2,500	44,750.00	0.05

77	300487	蓝晓科技	700	43,225.00	0.05
78	601702	华峰铝业	2,100	42,987.00	0.05
79	300223	北京君正	400	42,416.00	0.05
80	000639	西王食品	12,600	41,706.00	0.05
81	600419	天润乳业	4,200	41,580.00	0.05
82	603163	圣晖集成	600	41,160.00	0.05
83	001210	金房能源	2,400	41,112.00	0.05
84	002828	贝肯能源	3,800	40,508.00	0.04
85	002486	嘉麟杰	13,000	40,430.00	0.04
86	688565	力源科技	3,609	40,384.71	0.04
87	002299	圣农发展	2,400	39,696.00	0.04
88	000011	深物业 A	4,400	39,644.00	0.04
89	002188	中天服务	6,500	39,520.00	0.04
90	600558	大西洋	6,400	39,040.00	0.04
91	603188	亚邦股份	8,500	39,015.00	0.04
92	600561	江西长运	6,000	38,880.00	0.04
93	605268	王力安防	3,600	38,412.00	0.04
94	300030	阳普医疗	5,200	38,272.00	0.04
95	002931	锋龙股份	1,200	38,040.00	0.04
96	300915	海融科技	1,600	38,000.00	0.04
97	301236	软通动力	800	37,944.00	0.04
98	300959	线上线下	400	37,880.00	0.04
99	600241	时代万恒	4,500	37,575.00	0.04
100	002775	文科股份	8,700	37,236.00	0.04
101	002517	恺英网络	1,700	37,179.00	0.04
102	000755	山西高速	7,400	37,148.00	0.04
103	003031	中瓷电子	500	36,580.00	0.04
104	603506	南都物业	2,800	36,568.00	0.04
105	002474	榕基软件	3,700	36,482.00	0.04
106	600078	澄星股份	3,800	36,442.00	0.04
107	688255	凯尔达	987	36,153.81	0.04
108	688689	银河微电	1,271	36,070.98	0.04
109	001216	华瓷股份	2,100	35,931.00	0.04
110	301365	矩阵股份	1,500	35,760.00	0.04
111	600578	京能电力	7,000	35,700.00	0.04
112	002725	跃岭股份	2,100	35,490.00	0.04
113	600152	维科技术	4,800	35,040.00	0.04
114	600397	江钨装备	4,600	34,960.00	0.04
115	002748	世龙实业	2,700	34,857.00	0.04
116	003030	祖名股份	1,700	34,323.00	0.04
117	002602	世纪华通	1,900	32,414.00	0.04
118	300700	岱勒新材	2,600	32,110.00	0.04
119	000582	北部湾港	3,400	31,892.00	0.04

119	601933	永辉超市	6,800	31,892.00	0.04
120	300594	朗进科技	1,600	31,376.00	0.03
121	002198	嘉应制药	4,400	30,932.00	0.03
122	603979	金诚信	400	30,460.00	0.03
123	603379	三美股份	500	30,360.00	0.03
124	600774	汉商集团	3,300	30,162.00	0.03
125	300395	菲利华	300	30,090.00	0.03
126	000566	海南海药	4,200	30,030.00	0.03
127	688387	信科移动	2,280	29,412.00	0.03
128	002631	德尔未来	4,900	29,302.00	0.03
129	601198	东兴证券	2,100	29,148.00	0.03
130	600697	欧亚集团	2,200	29,018.00	0.03
131	002790	瑞尔特	3,400	28,526.00	0.03
132	002836	新宏泽	1,900	28,462.00	0.03
133	600829	人民同泰	2,600	28,106.00	0.03
134	688005	容百科技	782	27,682.80	0.03
135	000798	中水渔业	2,600	27,508.00	0.03
136	002309	中利集团	8,100	27,459.00	0.03
137	300837	浙矿股份	800	27,216.00	0.03
138	002484	江海股份	900	26,730.00	0.03
139	603022	新通联	2,600	26,702.00	0.03
140	603499	翔港科技	1,300	26,572.00	0.03
141	000967	盈峰环境	3,600	26,424.00	0.03
142	002487	大金重工	500	25,965.00	0.03
143	600115	中国东航	4,300	25,800.00	0.03
144	688496	清越科技	4,336	25,755.84	0.03
145	000887	中鼎股份	1,100	25,531.00	0.03
146	000959	首钢股份	5,200	25,480.00	0.03
147	605138	盛泰集团	3,600	25,056.00	0.03
148	600039	四川路桥	2,500	24,875.00	0.03
149	688396	华润微	465	24,579.90	0.03
150	000599	青岛双星	3,700	24,494.00	0.03
151	000421	南京公用	3,500	24,185.00	0.03
152	002760	凤形股份	1,100	23,881.00	0.03
153	002638	勤上股份	7,700	23,793.00	0.03
154	603182	嘉华股份	1,500	23,730.00	0.03
155	603488	展鹏科技	3,000	23,400.00	0.03
156	603177	德创环保	2,100	23,373.00	0.03
157	300103	达刚控股	2,900	23,287.00	0.03
158	000632	三木集团	4,100	23,165.00	0.03
159	000017	深中华 A	2,900	22,823.00	0.03
160	603150	万朗磁塑	600	22,788.00	0.03
161	000955	欣龙控股	3,600	22,392.00	0.02

162	300126	锐奇股份	2,600	22,256.00	0.02
163	002772	众兴菌业	1,500	21,885.00	0.02
164	002842	翔鹭钨业	1,500	21,690.00	0.02
165	300929	华骐环保	2,000	21,500.00	0.02
166	000543	皖能电力	2,700	21,465.00	0.02
167	002837	英维克	200	21,378.00	0.02
168	301100	风光股份	1,000	21,310.00	0.02
169	600137	浪莎股份	1,100	21,153.00	0.02
170	603681	永冠新材	1,100	20,878.00	0.02
171	603657	春光科技	700	20,860.00	0.02
172	688651	盛邦安全	473	20,821.46	0.02
173	000020	深华发 A	1,500	20,805.00	0.02
174	300549	优德精密	1,100	20,746.00	0.02
175	300670	大烨智能	2,900	20,619.00	0.02
176	688629	华丰科技	200	20,012.00	0.02
177	002512	达华智能	3,200	19,936.00	0.02
178	002370	亚太药业	2,700	19,737.00	0.02
179	600802	福建水泥	3,000	19,680.00	0.02
180	603095	越剑智能	1,100	19,624.00	0.02
181	688135	利扬芯片	700	19,432.00	0.02
182	002596	海南瑞泽	3,600	19,404.00	0.02
183	301113	雅艺科技	800	19,136.00	0.02
184	002849	威星智能	1,200	19,080.00	0.02
185	300118	东方日升	1,300	19,058.00	0.02
186	603155	新亚强	1,100	18,843.00	0.02
187	002603	以岭药业	1,100	18,777.00	0.02
188	001203	大中矿业	600	18,390.00	0.02
189	603269	海鸥股份	1,400	18,326.00	0.02
190	300912	凯龙高科	1,100	18,150.00	0.02
191	002333	罗普斯金	3,200	17,984.00	0.02
192	600382	广东明珠	2,500	17,825.00	0.02
193	002493	荣盛石化	1,500	17,565.00	0.02
194	603818	曲美家居	4,800	17,328.00	0.02
195	003003	天元股份	1,300	17,186.00	0.02
196	002905	金逸影视	1,500	16,950.00	0.02
197	002701	奥瑞金	2,700	16,065.00	0.02
198	688669	聚石化学	689	16,012.36	0.02
199	688597	煜邦电力	1,899	15,590.79	0.02
200	301336	趣睡科技	300	15,495.00	0.02
201	301176	逸豪新材	600	15,102.00	0.02
202	605060	联德股份	400	14,784.00	0.02
203	300644	南京聚隆	400	14,764.00	0.02
204	001209	洪兴股份	700	14,602.00	0.02

205	000975	山金国际	600	14,598.00	0.02
206	603500	祥和实业	1,200	14,376.00	0.02
207	601399	国机重装	3,000	14,340.00	0.02
208	300385	雪浪环境	2,300	14,306.00	0.02
209	300616	尚品宅配	1,000	13,930.00	0.02
210	002576	通达动力	800	13,920.00	0.02
211	688257	新锐股份	400	13,712.00	0.02
212	000626	远大控股	1,700	13,481.00	0.01
213	002055	ST 得润	2,000	13,480.00	0.01
214	600692	亚通股份	1,900	13,319.00	0.01
215	300086	康芝药业	1,100	13,233.00	0.01
216	300511	雪榕生物	2,100	13,104.00	0.01
217	688148	芳源股份	1,485	13,023.45	0.01
218	300948	冠中生态	600	13,014.00	0.01
219	002659	凯文教育	2,200	12,892.00	0.01
220	301027	华蓝集团	700	12,887.00	0.01
221	603048	浙江黎明	600	12,684.00	0.01
222	000952	广济药业	1,800	12,654.00	0.01
223	000428	华天酒店	3,800	12,540.00	0.01
224	301118	恒光股份	500	12,380.00	0.01
225	002589	瑞康医药	3,700	11,914.00	0.01
226	002429	兆驰股份	1,600	11,872.00	0.01
227	300106	西部牧业	1,100	11,825.00	0.01
228	605366	宏柏新材	1,900	11,780.00	0.01
229	301587	中瑞股份	500	11,700.00	0.01
230	601869	长飞光纤	100	11,636.00	0.01
231	002169	智光电气	1,000	11,570.00	0.01
232	002633	申科股份	700	11,515.00	0.01
233	002593	日上集团	1,900	11,229.00	0.01
234	003007	直真科技	300	11,187.00	0.01
235	688670	金迪克	552	11,166.96	0.01
236	600319	亚星化学	1,200	11,136.00	0.01
237	002394	联发股份	700	11,102.00	0.01
238	000039	中集集团	1,100	11,099.00	0.01
239	002796	世嘉科技	400	11,092.00	0.01
240	301235	华康洁净	300	11,061.00	0.01
241	300082	奥克股份	1,100	10,890.00	0.01
242	600156	华升股份	1,300	10,738.00	0.01
243	300838	浙江力诺	700	10,675.00	0.01
244	000155	川能动力	900	10,485.00	0.01
245	301468	博盈特焊	200	10,456.00	0.01
246	600312	平高电气	600	10,410.00	0.01
247	603616	韩建河山	2,000	10,380.00	0.01

248	600250	南京商旅	900	10,359.00	0.01
249	605162	新中港	1,200	10,248.00	0.01
250	300923	研奥股份	400	10,212.00	0.01
251	301372	科净源	400	10,144.00	0.01
252	603696	安记食品	500	10,140.00	0.01
253	300141	和顺电气	800	10,056.00	0.01
254	600860	京城股份	800	10,032.00	0.01
255	300340	科恒股份	800	9,856.00	0.01
256	603045	福达合金	500	9,825.00	0.01
257	002591	恒大高新	1,200	9,744.00	0.01
258	000059	华锦股份	1,800	9,630.00	0.01
259	603918	金桥信息	600	9,414.00	0.01
260	603399	永杉锂业	900	9,351.00	0.01
261	688309	恒誉环保	379	9,145.27	0.01
262	301338	凯格精机	100	8,811.00	0.01
263	300665	飞鹿股份	900	8,784.00	0.01
264	600356	恒丰纸业	1,000	8,780.00	0.01
265	000665	湖北广电	1,500	8,730.00	0.01
266	603170	宝立食品	600	8,568.00	0.01
267	300242	佳云科技	1,700	8,500.00	0.01
268	603341	龙旗科技	200	8,452.00	0.01
269	601601	中国太保	200	8,382.00	0.01
270	600689	上海三毛	600	8,064.00	0.01
271	603218	日月股份	600	7,950.00	0.01
272	603113	金能科技	1,300	7,943.00	0.01
273	002492	恒基达鑫	900	7,866.00	0.01
274	603307	扬州金泉	200	7,862.00	0.01
275	002156	通富微电	200	7,540.00	0.01
276	002731	萃华珠宝	600	7,536.00	0.01
277	300645	正元智慧	400	7,492.00	0.01
278	603179	新泉股份	100	7,388.00	0.01
279	000987	越秀资本	900	7,326.00	0.01
280	002136	安纳达	600	7,284.00	0.01
281	688221	前沿生物	400	7,220.00	0.01
282	603636	南威软件	600	7,104.00	0.01
283	603136	天目湖	600	7,068.00	0.01
284	000892	欢瑞世纪	1,000	6,980.00	0.01
285	601336	新华保险	100	6,970.00	0.01
286	002348	高乐股份	1,200	6,900.00	0.01
287	600857	宁波中百	500	6,855.00	0.01
288	002444	巨星科技	200	6,804.00	0.01
289	688360	德马科技	319	6,781.94	0.01
290	002634	棒杰股份	1,200	6,780.00	0.01

291	300720	海川智能	200	6,778.00	0.01
292	688373	盟科药业	1,100	6,644.00	0.01
293	603660	苏州科达	600	6,618.00	0.01
294	603391	力聚热能	100	6,547.00	0.01
295	301248	杰创智能	200	6,436.00	0.01
296	002678	珠江钢琴	1,200	6,396.00	0.01
297	600415	小商品城	400	6,380.00	0.01
298	603365	水星家纺	300	6,312.00	0.01
299	000520	凤凰航运	1,300	6,292.00	0.01
300	301539	宏鑫科技	300	6,270.00	0.01
301	600743	华远控股	3,100	6,200.00	0.01
302	002208	合肥城建	500	6,190.00	0.01
303	603230	内蒙新华	500	6,175.00	0.01
304	688162	巨一科技	200	6,160.00	0.01
305	301609	山大电力	149	6,107.51	0.01
306	600546	山煤国际	600	6,054.00	0.01
307	300190	维尔利	1,400	6,006.00	0.01
308	301230	泓博医药	200	5,974.00	0.01
309	300073	当升科技	100	5,780.00	0.01
310	300756	金马游乐	100	5,688.00	0.01
311	603097	江苏华辰	200	5,680.00	0.01
312	003013	地铁设计	400	5,668.00	0.01
313	002335	科华数据	100	5,553.00	0.01
314	001319	铭科精技	200	5,494.00	0.01
315	300836	佰奥智能	100	5,490.00	0.01
316	300390	天华新能	100	5,461.00	0.01
317	600410	华胜天成	300	5,364.00	0.01
318	600293	三峡新材	1,700	5,355.00	0.01
319	300442	润泽科技	100	5,280.00	0.01
320	002130	沃尔核材	200	5,264.00	0.01
321	600159	大龙地产	1,900	5,263.00	0.01
322	603699	纽威股份	100	5,197.00	0.01
323	000338	潍柴动力	300	5,160.00	0.01
324	603920	世运电路	100	4,841.00	0.01
325	001388	信通电子	69	2,962.86	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300226	上海钢联	1,875,699.00	1.28
2	002970	锐明技术	1,541,970.41	1.05
3	603197	保隆科技	1,500,988.00	1.02

4	300134	大富科技	1,437,857.00	0.98
5	601107	四川成渝	1,419,229.00	0.97
6	688222	成都先导	1,371,166.39	0.93
7	601068	中铝国际	1,356,092.00	0.92
8	002139	拓邦股份	1,352,011.00	0.92
9	002446	盛路通信	1,336,572.00	0.91
10	600335	国机汽车	1,318,023.00	0.90
11	600628	新世界	1,278,045.00	0.87
12	600814	杭州解百	1,274,809.00	0.87
13	300072	海新能科	1,258,420.00	0.86
14	002925	盈趣科技	1,248,603.00	0.85
15	688088	虹软科技	1,240,044.45	0.84
16	002419	天虹股份	1,222,919.00	0.83
17	600526	菲达环保	1,205,776.00	0.82
18	000829	天音控股	1,171,280.00	0.80
19	600962	国投中鲁	1,170,066.00	0.80
20	301376	致欧科技	1,169,292.00	0.80

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300226	上海钢联	2,390,264.00	1.63
2	002546	新联电子	1,760,563.00	1.20
3	002376	新北洋	1,682,198.00	1.14
4	002970	锐明技术	1,658,686.49	1.13
5	603601	再升科技	1,610,788.00	1.10
6	603387	基蛋生物	1,526,327.20	1.04
7	603256	宏和科技	1,523,605.00	1.04
8	688088	虹软科技	1,520,706.24	1.03
9	002578	闽发铝业	1,516,959.00	1.03
10	603687	大胜达	1,504,948.00	1.02
11	000551	创元科技	1,461,870.80	0.99
12	603169	兰石重装	1,438,330.00	0.98
13	688222	成都先导	1,387,226.98	0.94
14	603966	法兰泰克	1,386,007.00	0.94
15	601068	中铝国际	1,380,242.00	0.94
16	600330	天通股份	1,378,821.00	0.94
17	000931	中关村	1,378,032.00	0.94
18	002139	拓邦股份	1,362,935.00	0.93
19	301025	读客文化	1,349,835.00	0.92
20	300203	聚光科技	1,343,744.00	0.91

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	874,804,624.99
卖出股票收入（成交）总额	961,030,777.65

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,959.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,959.38

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧国证 2000 指数增强 A	1,236	33,967.77	3,185,570.83	7.59%	38,798,590.35	92.41%

中欧国证 2000 指数增强 C	1,130	21,659.97	0.00	0.00%	24,475,766.67	100.00%
合计	2,366	28,089.57	3,185,570.83	4.79%	63,274,357.02	95.21%

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	中欧国证 2000 指数增强 A	99,398.96	0.24%
	中欧国证 2000 指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	99,398.96	0.15%

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	中欧国证 2000 指数增强 A	0
	中欧国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧国证 2000 指数增强 A	0
	中欧国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧国证 2000 指数增强 A	中欧国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 7 月 18 日）基金份额总额	342,646,381.98	427,071,109.12
本报告期期初基金份额总额	73,062,173.99	70,777,668.49
本报告期基金总申购份额	69,145,389.52	46,801,861.63
减：本报告期基金总赎回份额	100,223,402.33	93,103,763.45
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	41,984,161.18	24,475,766.67

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

自 2025 年 12 月起，中信建投证券股份有限公司托管部高级管理人员增加邱珂磊为托管部联席负责人。

自 2026 年 1 月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

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

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 40,000.00 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 (%)	
东北证券	3	969,810,868.10	52.84	180,341.41	52.83	-
中信建投	3	865,444,938.92	47.16	161,008.71	47.17	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东北证	-	-	-	-	-	-

券						
中信建投	-	-	-	-	-	-

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。

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	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
6	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
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
9	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
10	中欧基金管理有限公司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	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-06-03
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	中国证监会指定媒介	2025-06-09

	告		
13	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2025-06-18
14	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-06-19
15	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2025-06-19
16	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 7 月）	中国证监会指定媒介	2025-07-08
17	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
18	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-07-19
19	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会指定媒介	2025-08-30
20	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
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
23	中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-10-28

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

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