

中欧瑾添混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧瑾添混合型证券投资基金	
基金简称	中欧瑾添混合	
基金主代码	013998	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 9 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	284,732,583.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧瑾添混合 A	中欧瑾添混合 C
下属分级基金的交易代码	013998	013999
报告期末下属分级基金的份额总额	284,514,105.97 份	218,477.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依据科学严谨的大类资产配置框架，通过把握债券、股票市场的投资机会，在控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2%+中债综合财富（总值）指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金还可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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	冯萌
	联系电话	021-68609600	021-52629999-213310
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95561
传真		021-50190017	021-62159217

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	窦玉明	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	中欧瑾添混合 A	中欧瑾添混合 C
本期已实现收益	-1,101,058.75	113,275.34
本期利润	1,640,123.79	93,488.13
加权平均基金份额 本期利润	0.0063	0.0028
本期加权平均净 值利润率	0.72%	0.32%
本期基金份额净 值增长率	0.68%	0.68%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-38,974,131.97	-29,153.53

期末可供分配基金份额利润	-0.1370	-0.1334
期末基金资产净值	251,637,712.06	194,031.31
期末基金份额净值	0.8844	0.8881
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.56%	-11.19%

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

中欧瑾添混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.33%	0.14%	1.00%	0.11%	0.33%	0.03%
过去三个月	0.53%	0.29%	1.70%	0.21%	-1.17%	0.08%
过去六个月	0.68%	0.28%	1.47%	0.20%	-0.79%	0.08%
过去一年	4.60%	0.42%	7.55%	0.26%	-2.95%	0.16%
过去三年	-12.34%	0.44%	11.12%	0.21%	-	0.23%
自基金合同生效起至今	-11.56%	0.41%	11.98%	0.22%	-	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。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。

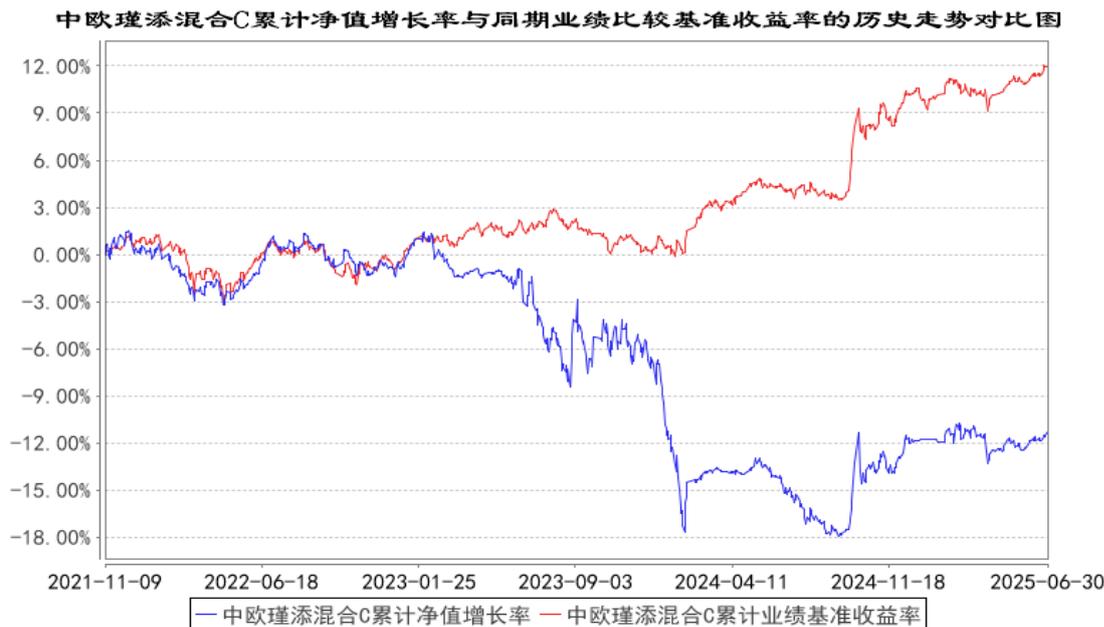
中欧瑾添混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.32%	0.14%	1.00%	0.11%	0.32%	0.03%
过去三个月	0.52%	0.29%	1.70%	0.21%	-1.18%	0.08%
过去六个月	0.68%	0.28%	1.47%	0.20%	-0.79%	0.08%
过去一年	4.53%	0.42%	7.55%	0.26%	-3.02%	0.16%
过去三年	-11.91%	0.44%	11.12%	0.21%	-	0.23%
自基金合同生效起至今	-11.19%	0.41%	11.98%	0.22%	-	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。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





§ 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6月30日，本基金管理人共管理208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		
李波	基金经理 / 基金经理助理	2022-03-01	-	7年	历任海通证券股份有限公司研究所固定收益分析师。2020-04-21加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
赵宇澄	基金经理 / 基金经理助理	2024-04-26	-	6年	历任博时基金管理有限公司基金经理助理兼高级研究员。2024-01-29加入中欧基金管理有限公司。
苏佳	基金经理 / 基金经理助理	2025-03-13	-	8年	历任广发银行股份有限公司总行金融机构部行员，易方达基金管理有限公司投资

	理助理				支持专员,易方达基金管理有限公司投资经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管理有限公司。
苏佳	基金经理 / 基金经理助理	2024-02-02	2025-03-03	8 年	历任广发银行股份有限公司总行金融机构部行员,易方达基金管理有限公司投资支持专员,易方达基金管理有限公司投资经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管理有限公司。
王申	固收投决会委员 / 研究组组长 / 基金经理	2024-08-23	-	15 年	历任友邦保险上海分公司中国计算中心一级程序员,上海申银万国证券研究所有限公司债券分析师,国金证券研究所首席债券分析师/执行总监,博时基金管理有限公司宏观策略部总经理/固定收益研究部总经理、研究总监/基金经理。2024-02-19 加入中欧基金管理有限公司。

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，其中赵宇澄担任本基金的基金经理；李波担任本基金的基金经理助理；苏佳自 2024 年 2 月 2 日至 2025 年 3 月 3 日担任本基金的基金经理，自 2025 年 3 月 13 日起担任本基金的基金经理助理。

4、根据公司安排,李波自 2025 年 08 月 27 日起不再担任该基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 19 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年基本面和股债市场都经历了较大的波动。上半年基本面具备较强的韧性，一方面 924 以来的政策转向、尤其是按揭利率下调对于房地产市场的支撑使得 2024 年 4 季度和 2025 年 1 季度的地产市场总体有所企稳；另一方面，关税冲击落地后中美相关的谈判博弈取得较好的效果，在抢出口带动下也没有受到明显的实际冲击。同时我们也观察到，2 季度中后期，总量层面边际上开始出现一定的走弱迹象，房地产市场的量价从二季度中后期以来逐步走弱，低物价压力仍旧没有出现明显扭转，从上市公司最新财报数据看，营收利润等基本面指标依旧比较疲弱，随着 2021-2023 年大量在建工程转固，2024 年以来产能投放压力和盈利条件的疲弱促使上市公司 2024 年下半年以来整体上资本开支转负，整体呈现一定的自发出清特征。从资本市场看，股债市场都经历了从 4 月中上旬关税极限施压冲击下的剧烈震荡，到对关税博弈逐步脱敏的波动率降低的过程。权益市场表现比较顽强，债市在无风险收益率低位的情况下，二季度的机会主要表现在对信用利差的压缩和对非主流交易品种的价值挖掘。组合在上半年在固收部分对久期的定位总体偏防守，权益上 1-2 季度的 A 股市场运行特征出现了较大的变化，组合立足于绝对收益思路，在仓位上偏向中性，对权益机会把握的力度需要加大。

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 0.68%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；基金 C 类份额净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，财政扩张的力度预计将有一定程度加码，但从债务存续角度看，要出现显著财政扩张促使物价水平出现明显回暖的概率并不高，企业盈利预计在年内仍大概率将在低位徘徊，缺乏明显的向上弹性。货币政策预计有进一步降准降息的宽松空间，随着银行负债成本的持续下行，预计年内无风险利率或将走低。在盈利缺乏弹性的条件下，资本市场的主线仍将围绕宽松流动性在相关的占优策略方向上演绎。预计红利因子、成长因子、小市值因子仍将继续占优。转债整体估值较高，但考虑到后续整体转债市场规模随着部分转债转股将有所降低，而绝对收益低波

稳健类资金对于转债的整体需求仍会持续，转债估值较高的情况预计会持续。组合将继续紧密监测市场，根据动态盈亏比的变化争取把握股债两方面所给出的绝对收益机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的

监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧瑾添混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,100,105.45	644,209.43
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	209,147,980.12	206,747,405.19
其中：股票投资		72,607,015.50	-
基金投资		-	-
债券投资		136,540,964.62	206,747,405.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	41,802,426.03	49,016,017.85
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		15,576.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		252,066,087.60	256,407,632.47

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		123,335.07	49,636.22
应付托管费		20,555.85	8,272.71
应付销售服务费		15.87	2,580.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		42.40	1,263.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	90,395.04	42,598.50
负债合计		234,344.23	104,351.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	284,732,583.81	290,880,567.69
未分配利润	6.4.7.8	-32,900,840.44	-34,577,286.40
净资产合计		251,831,743.37	256,303,281.29
负债和净资产总计		252,066,087.60	256,407,632.47

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 284,732,583.81 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8844 元，基金份额总额 284,514,105.97 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.8881 元，基金份额总额 218,477.84 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧瑾添混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,751,456.07	-8,954,133.82
1. 利息收入		585,458.11	51,061.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	66,973.62	25,177.79
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		518,484.49	25,883.43

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-610,402.83	-10,863,834.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,672,788.65	-12,152,792.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,216,521.46	1,040,887.14
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	845,864.36	248,070.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,721,395.33	1,852,957.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	55,005.46	5,682.23
减：二、营业总支出		1,017,844.15	410,051.45
1. 管理人报酬		764,833.40	251,691.37
2. 托管费		127,472.14	41,948.54
3. 销售服务费		14,197.46	16,244.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		253.01	410.96
其中：卖出回购金融资产支出		253.01	410.96
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,796.35	25.63
8. 其他费用	6.4.7.18	109,291.79	99,730.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,733,611.92	-9,364,185.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,733,611.92	-9,364,185.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,733,611.92	-9,364,185.27

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧瑾添混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	290,880,567.69	-	-34,577,286.40	256,303,281.29
二、本期期初净资产	290,880,567.69	-	-34,577,286.40	256,303,281.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,147,983.88	-	1,676,445.96	-4,471,537.92
（一）、综合收益总额	-	-	1,733,611.92	1,733,611.92
（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）	-6,147,983.88	-	-57,165.96	-6,205,149.84
其中：1. 基金申购款	284,942,869.05	-	-34,533,043.41	250,409,825.64
2. 基金赎回款	-	-	34,475,877.45	-256,614,975.48
（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	284,732,583.81	-	-32,900,840.44	251,831,743.37
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	120,200,162.89	-	-8,414,046.03	111,786,116.86
二、本期期初净资产	120,200,162.89	-	-8,414,046.03	111,786,116.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,234,761.92	-	-3,478,559.52	-46,713,321.44
（一）、综合收益总额	-	-	-9,364,185.27	-9,364,185.27
（二）、本期基金	-43,234,761.92	-	5,885,625.75	-37,349,136.17

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	23,388,998.11	-	-3,224,982.12	20,164,015.99
2. 基金赎回款	-66,623,760.03	-	9,110,607.87	-57,513,152.16
(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	76,965,400.97	-	-11,892,605.55	65,072,795.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧瑾添混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3205号文《关于准予中欧瑾添混合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《中欧瑾添混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 208,906,898.63 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 61362990_B41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧瑾添混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 208,906,998.63 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 100.00 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 68,894,827.64 份，无认购利息折合基金份额；C 类基金的基金份额总额为 140,012,170.99 份，包含认购利息折合 100.00 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾添混合型证券投资基金基金合同》的有

关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品（不含合约类信用衍生品）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-40%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）及可交换债券的比例不超过基金资产的 20%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	946,755.46
等于：本金	946,622.59
加：应计利息	132.87
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	153,349.99
等于：本金	153,322.71
加：应计利息	27.28
减：坏账准备	-
合计	1,100,105.45

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	70,541,941.11	-	72,607,015.50	2,065,074.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	195,956.15	30,743,223.25	554,219.55
	银行间市	104,850,746.29	838,741.37	108,253.71

	场				
	合计	134,843,793.84	1,034,697.52	136,540,964.62	662,473.26
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		205,385,734.95	1,034,697.52	209,147,980.12	2,727,547.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	18,800,000.00	-
银行间市场	23,002,426.03	-
合计	41,802,426.03	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,051.88
其中：交易所市场	-
银行间市场	11,051.88
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	90,395.04

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	76,830,078.51	76,830,078.51
本期申购	284,507,802.16	284,507,802.16
本期赎回(以“-”号填列)	-76,823,774.70	-76,823,774.70
本期末	284,514,105.97	284,514,105.97

中欧瑾添混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	214,050,489.18	214,050,489.18
本期申购	435,066.89	435,066.89
本期赎回(以“-”号填列)	-214,267,078.23	-214,267,078.23
本期末	218,477.84	218,477.84

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧瑾添混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,257,027.16	911,842.47	-9,345,184.69
本期期初	-10,257,027.16	911,842.47	-9,345,184.69
本期利润	-1,101,058.75	2,741,182.54	1,640,123.79
本期基金份额交易产生的变动数	-27,616,046.06	2,444,713.05	-25,171,333.01
其中：基金申购款	-37,833,023.40	3,350,581.35	-34,482,442.05
基金赎回款	10,216,977.34	-905,868.30	9,311,109.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,974,131.97	6,097,738.06	-32,876,393.91

中欧瑾添混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,784,559.12	2,552,457.41	-25,232,101.71
本期期初	-27,784,559.12	2,552,457.41	-25,232,101.71
本期利润	113,275.34	-19,787.21	93,488.13
本期基金份额交易产生的变动数	27,642,130.25	-2,527,963.20	25,114,167.05
其中：基金申购款	-55,663.00	5,061.64	-50,601.36
基金赎回款	27,697,793.25	-2,533,024.84	25,164,768.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,153.53	4,707.00	-24,446.53

6.4.7.9 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,420.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,496.02
结算备付金利息收入	-
其他	9,057.19
合计	66,973.62

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	215,033,075.16
减：卖出股票成本总额	217,345,776.49
减：交易费用	360,087.32
买卖股票差价收入	-2,672,788.65

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,441,997.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-225,476.05
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,216,521.46

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	521,741,722.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	517,770,952.34
减：应计利息总额	4,178,285.79
减：交易费用	17,960.59
买卖债券差价收入	-225,476.05

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	845,864.36
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	845,864.36

6.4.7.15 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6月30日
1. 交易性金融资产	2,721,395.33
股票投资	2,065,074.39
债券投资	656,320.94
资产支持证券投资	-
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	2,721,395.33

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	74.19
基金转换费收入	54,931.27

合计	55,005.46
----	-----------

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,344.39
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
证券组合费	1.80
存托服务费	2.44
合计	109,291.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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
自然人股东	基金管理人股东
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	764,833.40	251,691.37
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,771.85	935.76
应支付基金管理人的净管理费	762,061.55	250,755.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	127,472.14	41,948.54
----------------	------------	-----------

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧瑾添混合 A	中欧瑾添混合 C	合计
中欧财富	0.00	0.86	0.86
中欧基金	0.00	11,204.68	11,204.68
合计	0.00	11,205.54	11,205.54
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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧瑾添混合 A	中欧瑾添混合 C	合计
中欧财富	0.00	1.19	1.19
中欧基金	0.00	16,221.69	16,221.69
合计	0.00	16,222.88	16,222.88

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧瑾添混合 A

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
报告期初持有的 基金份额	53,615,400.24	53,615,400.24
报告期内申购/买 入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分 变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回 /卖出总份额	53,615,400.24	0.00
报告期末持有的 基金份额	0.00	53,615,400.24
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	0.00	69.77%

中欧瑾添混合 C

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
报告期初持有的 基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	170,338.41	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	170,338.41	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	77.97%	0.00

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧瑾添混合 A

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中欧盛世资管	-	-	23,198,004.87	30.19%
自然人股东	110.02	0.00%	120.02	0.00%

份额单位：份

中欧瑾添混合 C

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中欧财富	-	-	28,344,671.20	13.24%
中欧盛世资管	-	-	119,360,072.64	55.76%
自然人股东	0.01	0.00%	0.01	0.00%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有 限公司	946,755.46	45,420.41	13,883.91	7,176.76

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	8,836	278,630.84	336,209.80	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。本基金依据科学严谨的大类资产配置框架，通过把握债券、股票市场的投资机会，在控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	13,057,296.16	144,470,942.09
合计	13,057,296.16	144,470,942.09

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以下未有三方评级的国债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	39,801,120.34	49,952,818.21
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	39,801,120.34	49,952,818.21

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的主体评级。2. 债券投资以全价列示。3. A-1 为 AAA，A-1 以下为 AAA 以下。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	29,347,367.82	10,278,053.55
AAA 以下	9,034,458.99	-
未评级	45,300,721.31	2,045,591.34
合计	83,682,548.12	12,323,644.89

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的国债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人

定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,100,105.45	-	-	-	1,100,105.45
交易性金融资产	57,969,829.10	30,452,376.77	48,118,758.75	72,607,015.50	209,147,980.12
买入返售金融资产	41,802,426.03	-	-	-	41,802,426.03
应收股利	-	-	-	15,576.00	15,576.00
资产总计	100,872,360.58	30,452,376.77	48,118,758.75	72,622,591.50	252,066,087.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	123,335.07	123,335.07
应付托管费	-	-	-	20,555.85	20,555.85
应付销售服务费	-	-	-	15.87	15.87
应交税费	-	-	-	42.40	42.40
其他负债	-	-	-	90,395.04	90,395.04
负债总计	-	-	-	234,344.23	234,344.23
利率敏感度缺口	100,872,360.58	30,452,376.77	48,118,758.75	72,388,247.27	251,831,743.37
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	644,209.43	-	-	-	644,209.43
交易性金融资产	206,747,405.19	-	-	-	206,747,405.19
买入返售金融资产	49,016,017.85	-	-	-	49,016,017.85
资产总计	256,407,632.47	-	-	-	256,407,632.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	49,636.22	49,636.22
应付托管费	-	-	-	8,272.71	8,272.71
应付销售服务费	-	-	-	2,580.56	2,580.56
应交税费	-	-	-	1,263.19	1,263.19
其他负债	-	-	-	42,598.50	42,598.50
负债总计	-	-	-	104,351.18	104,351.18
利率敏感度缺口	256,407,632.47	-	-	-104,351.18	256,303,281.29

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	利率上升 25BP	-2,202,376.22	-49,903.05
	利率下降 25BP	2,321,446.31	49,954.86

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	98,490.60	-	98,490.60
应收股利	-	15,576.00	-	15,576.00
资产合计	-	114,066.60	-	114,066.60
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	114,066.60	-	114,066.60
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
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6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	港币相对人民币贬值 5%	-5,703.33	-
	港币相对人民币升值 5%	5,703.33	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30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	72,607,015.50	28.83	-	-
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	72,607,015.50	28.83	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	13,646,745.96	-
	业绩比较基准下降5%	-13,646,745.96	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	89,956,732.79	-
第二层次	119,191,247.33	206,747,405.19
第三层次	-	-
合计	209,147,980.12	206,747,405.19

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	72,607,015.50	28.80
	其中：股票	72,607,015.50	28.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	136,540,964.62	54.17
	其中：债券	136,540,964.62	54.17
	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	41,802,426.03	16.58
	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	1,100,105.45	0.44
8	其他各项资产	15,576.00	0.01

9	合计	252,066,087.60	100.00
---	----	----------------	--------

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 98,490.60 元，占基金资产净值比例 0.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	31,465.00	0.01
B	采矿业	2,304,165.24	0.91
C	制造业	50,885,478.56	20.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,535,238.00	1.01
E	建筑业	336,066.00	0.13
F	批发和零售业	1,857,395.10	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	1,529,316.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,983,446.71	1.58
J	金融业	2,641,098.00	1.05
K	房地产业	638,625.00	0.25
L	租赁和商务服务业	925,308.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	434,385.26	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	869,837.03	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,536,701.00	1.40
S	综合	-	-
	合计	72,508,524.90	28.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	98,490.60	0.04
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-

电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	98,490.60	0.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000915	华特达因	24,300	859,005.00	0.34
2	605599	菜百股份	52,200	853,470.00	0.34
3	601717	中创智领	50,100	832,662.00	0.33
4	688019	安集科技	5,335	809,853.00	0.32
5	603444	吉比特	2,600	785,070.00	0.31
6	600866	星湖科技	109,700	758,027.00	0.30
7	601801	皖新传媒	109,200	745,836.00	0.30
8	300570	太辰光	7,700	742,126.00	0.29
9	301061	匠心家居	9,102	705,769.08	0.28
10	688008	澜起科技	8,222	674,204.00	0.27
11	000975	山金国际	35,200	666,688.00	0.26
12	002244	滨江集团	65,500	638,625.00	0.25
13	301421	波长光电	7,900	631,921.00	0.25
14	300770	新媒股份	15,800	631,842.00	0.25
15	300476	胜宏科技	4,700	631,586.00	0.25
16	601919	中远海控	40,700	612,128.00	0.24
17	601665	齐鲁银行	96,800	611,776.00	0.24
18	002027	分众传媒	82,800	604,440.00	0.24
19	000423	东阿阿胶	11,400	596,220.00	0.24
20	002895	川恒股份	26,400	595,584.00	0.24
21	002155	湖南黄金	33,170	592,084.50	0.24
22	002270	华明装备	34,800	582,552.00	0.23
23	601825	沪农商行	59,800	580,060.00	0.23
24	603588	高能环境	102,392	577,490.88	0.23
25	300502	新易盛	4,380	556,347.60	0.22
26	600873	梅花生物	51,900	554,811.00	0.22
27	603893	瑞芯微	3,600	546,696.00	0.22
28	002532	天山铝业	64,800	538,488.00	0.21
29	600757	长江传媒	55,600	515,968.00	0.20
30	000623	吉林敖东	30,400	515,280.00	0.20
31	300251	光线传媒	25,300	512,831.00	0.20
32	002648	卫星化学	27,600	478,308.00	0.19
33	002001	新和成	20,300	431,781.00	0.17

34	600887	伊利股份	15,400	429,352.00	0.17
35	300432	富临精工	32,440	423,990.80	0.17
36	300100	双林股份	8,800	414,304.00	0.16
37	688502	茂莱光学	1,437	413,367.42	0.16
38	600105	永鼎股份	51,000	412,590.00	0.16
39	603612	索通发展	22,200	408,036.00	0.16
40	600551	时代出版	44,800	399,616.00	0.16
41	002893	京能热力	37,200	397,668.00	0.16
42	000600	建投能源	57,500	397,325.00	0.16
43	002206	海利得	77,700	397,047.00	0.16
44	688200	华峰测控	2,747	396,117.40	0.16
45	688392	骄成超声	5,796	394,881.48	0.16
46	002948	青岛银行	79,100	393,918.00	0.16
47	002588	史丹利	44,400	391,164.00	0.16
48	600282	南钢股份	92,300	387,660.00	0.15
49	601619	嘉泽新能	107,900	386,282.00	0.15
50	603855	华荣股份	17,400	385,062.00	0.15
51	002034	旺能环境	22,900	384,491.00	0.15
52	002352	顺丰控股	7,800	380,328.00	0.15
53	300308	中际旭创	2,600	379,236.00	0.15
54	000700	模塑科技	48,200	378,370.00	0.15
55	688120	华海清科	2,223	375,020.10	0.15
56	003010	若羽臣	6,180	374,508.00	0.15
57	600183	生益科技	12,300	370,845.00	0.15
58	688049	炬芯科技	6,117	370,078.50	0.15
59	301260	格力博	18,700	368,764.00	0.15
60	603129	春风动力	1,700	368,050.00	0.15
61	601100	恒立液压	5,100	367,200.00	0.15
62	600817	宇通重工	31,000	367,040.00	0.15
63	300153	科泰电源	10,800	365,580.00	0.15
64	002487	大金重工	11,000	361,900.00	0.14
65	688018	乐鑫科技	2,469	360,720.90	0.14
66	600066	宇通客车	14,500	360,470.00	0.14
67	603816	顾家家居	14,100	359,832.00	0.14
68	601369	陕鼓动力	41,000	359,570.00	0.14
69	688372	伟测科技	5,952	359,500.80	0.14
70	688029	南微医学	5,306	358,420.30	0.14
71	603583	捷昌驱动	9,800	357,896.00	0.14
72	002345	潮宏基	24,400	356,972.00	0.14
73	605376	博迁新材	9,200	352,636.00	0.14
74	688789	XD 宏华数	4,817	351,833.68	0.14
75	688608	恒玄科技	1,011	351,807.78	0.14
76	000538	云南白药	6,200	345,898.00	0.14

77	000651	格力电器	7,700	345,884.00	0.14
78	605499	XD 东鹏饮	1,100	345,455.00	0.14
79	603596	伯特利	6,500	342,485.00	0.14
80	688522	纳睿雷达	6,658	341,022.76	0.14
81	601921	浙版传媒	42,200	340,132.00	0.14
82	002683	广东宏大	10,000	339,400.00	0.13
83	603063	禾望电气	10,000	338,600.00	0.13
84	688314	康拓医疗	10,951	338,166.88	0.13
85	600987	航民股份	47,700	337,239.00	0.13
86	688313	仕佳光子	8,836	336,209.80	0.13
87	000831	中国稀土	9,300	335,916.00	0.13
88	000951	中国重汽	19,100	335,778.00	0.13
89	688270	臻镭科技	7,183	334,440.48	0.13
90	600398	海澜之家	47,700	331,992.00	0.13
91	600132	重庆啤酒	6,000	330,600.00	0.13
92	002003	伟星股份	30,200	329,482.00	0.13
93	300124	汇川技术	5,100	329,307.00	0.13
94	600295	鄂尔多斯	37,800	329,238.00	0.13
95	000157	中联重科	45,500	328,965.00	0.13
96	000893	亚钾国际	10,900	328,526.00	0.13
97	002170	芭田股份	32,000	328,000.00	0.13
98	601339	百隆东方	69,300	327,096.00	0.13
99	600547	山东黄金	10,218	326,260.74	0.13
100	600019	宝钢股份	49,300	324,887.00	0.13
101	601928	凤凰传媒	28,900	322,813.00	0.13
102	603379	三美股份	6,700	322,404.00	0.13
103	300662	科锐国际	10,800	320,868.00	0.13
104	600176	中国巨石	28,100	320,340.00	0.13
105	002032	苏泊尔	6,100	319,579.00	0.13
106	601298	XD 青岛港	36,600	318,054.00	0.13
107	600801	华新水泥	26,800	317,312.00	0.13
108	688093	世华科技	10,120	314,226.00	0.12
109	603197	保隆科技	8,000	312,560.00	0.12
110	605099	共创草坪	9,300	312,387.00	0.12
111	600803	新奥股份	16,400	309,960.00	0.12
112	601098	XD 中南传	23,600	309,632.00	0.12
113	301031	中熔电气	3,872	308,404.80	0.12
114	000672	上峰水泥	39,000	308,100.00	0.12
115	688300	联瑞新材	6,605	307,462.75	0.12
116	300573	兴齐眼药	5,840	302,453.60	0.12
117	002293	罗莱生活	34,600	302,404.00	0.12
118	000408	藏格矿业	7,000	298,690.00	0.12
119	000932	华菱钢铁	66,600	293,040.00	0.12

120	603288	海天味业	7,500	291,825.00	0.12
121	603799	华友钴业	7,800	288,756.00	0.11
122	300888	稳健医疗	7,000	287,700.00	0.11
123	002043	兔宝宝	29,300	287,140.00	0.11
124	688123	聚辰股份	3,541	286,785.59	0.11
125	300487	蓝晓科技	5,700	286,710.00	0.11
126	300685	艾德生物	13,300	286,349.00	0.11
127	601019	山东出版	30,200	285,994.00	0.11
128	300181	佐力药业	16,400	284,212.00	0.11
129	605016	百龙创园	13,750	283,662.50	0.11
130	600563	法拉电子	2,600	283,634.00	0.11
131	688617	惠泰医疗	954	283,338.00	0.11
132	603239	浙江仙通	18,500	279,535.00	0.11
133	002884	凌霄泵业	17,300	275,762.00	0.11
134	603235	天新药业	10,100	275,629.00	0.11
135	688677	海泰新光	7,001	273,109.01	0.11
136	300910	瑞丰新材	4,700	271,425.00	0.11
137	603027	千禾味业	23,300	270,513.00	0.11
138	002690	美亚光电	16,000	269,920.00	0.11
139	300666	江丰电子	3,600	266,760.00	0.11
140	002371	北方华创	600	265,326.00	0.11
141	600276	恒瑞医药	5,100	264,690.00	0.11
142	603199	九华旅游	7,300	264,552.00	0.11
143	600389	江山股份	14,200	264,120.00	0.10
144	688188	柏楚电子	2,002	263,583.32	0.10
145	002539	云图控股	27,600	258,888.00	0.10
146	603040	新坐标	6,400	257,088.00	0.10
147	603605	珀莱雅	3,100	256,649.00	0.10
148	603170	宝立食品	20,500	255,635.00	0.10
149	601555	东吴证券	29,100	254,625.00	0.10
150	600739	辽宁成大	22,800	250,800.00	0.10
151	003006	百亚股份	9,100	249,158.00	0.10
152	002595	豪迈科技	4,200	248,724.00	0.10
153	002419	天虹股份	44,900	240,664.00	0.10
154	600073	光明肉业	32,600	240,588.00	0.10
155	688501	青达环保	8,430	234,775.50	0.09
156	600027	华电国际	42,900	234,663.00	0.09
157	603233	大参林	14,300	233,090.00	0.09
158	002050	三花智控	8,800	232,144.00	0.09
159	688213	XD 思特威	2,256	230,608.32	0.09
160	300138	晨光生物	18,800	227,856.00	0.09
161	000858	五粮液	1,600	190,240.00	0.08
162	603993	洛阳钼业	22,400	188,608.00	0.07

163	300274	阳光电源	2,700	182,979.00	0.07
164	601336	新华保险	3,100	181,350.00	0.07
165	600362	江西铜业	7,600	178,068.00	0.07
166	601319	中国人保	20,400	177,684.00	0.07
167	000902	新洋丰	12,800	177,024.00	0.07
168	601600	中国铝业	25,100	176,704.00	0.07
169	600219	南山铝业	45,800	175,414.00	0.07
170	601677	明泰铝业	14,100	175,122.00	0.07
171	600483	福能股份	18,100	174,484.00	0.07
172	002083	孚日股份	36,000	173,880.00	0.07
173	600531	豫光金铅	22,400	173,376.00	0.07
174	601628	中国人寿	4,200	172,998.00	0.07
175	600956	新天绿能	22,400	172,928.00	0.07
176	600018	上港集团	30,200	172,442.00	0.07
177	601117	中国化学	22,200	170,274.00	0.07
178	000528	柳工	17,400	167,214.00	0.07
179	600062	华润双鹤	8,900	166,074.00	0.07
180	000928	中钢国际	26,400	165,792.00	0.07
181	600216	浙江医药	11,100	164,169.00	0.07
182	600988	赤峰黄金	6,500	161,720.00	0.06
183	600694	大商股份	8,700	161,385.00	0.06
184	000921	海信家电	6,200	159,340.00	0.06
185	688343	云天励飞	3,108	153,597.36	0.06
186	600000	浦发银行	9,800	136,024.00	0.05
187	002594	比亚迪	400	132,764.00	0.05
188	688256	寒武纪	208	125,112.00	0.05
189	603275	众辰科技	2,200	108,658.00	0.04
190	603809	豪能股份	6,800	104,040.00	0.04
191	603119	浙江荣泰	2,200	101,728.00	0.04
192	002600	领益智造	11,700	100,503.00	0.04
193	000887	中鼎股份	5,700	100,263.00	0.04
194	603009	北特科技	2,400	100,080.00	0.04
195	002126	银轮股份	4,100	99,548.00	0.04
196	00179	德昌电机控股	5,000	98,490.60	0.04
197	300580	贝斯特	4,000	98,280.00	0.04
198	301550	斯菱股份	1,100	98,219.00	0.04
199	603166	福达股份	6,300	97,461.00	0.04
200	300660	江苏雷利	2,200	97,328.00	0.04
201	301160	翔楼新材	1,200	96,096.00	0.04
202	603662	柯力传感	1,500	95,895.00	0.04
203	300611	美力科技	4,100	95,489.00	0.04
204	301000	肇民科技	2,000	95,280.00	0.04
205	300622	博士眼镜	2,730	94,922.10	0.04

206	603236	移远通信	1,100	94,380.00	0.04
207	600986	浙文互联	11,500	93,955.00	0.04
208	688052	纳芯微	521	90,909.29	0.04
209	002850	科达利	800	90,536.00	0.04
210	688631	莱斯信息	984	87,772.80	0.03
211	603019	中科曙光	1,200	84,480.00	0.03
212	688100	威胜信息	2,212	81,954.60	0.03
213	300033	同花顺	300	81,903.00	0.03
214	688183	生益电子	1,580	80,896.00	0.03
215	688266	泽璟制药	751	80,740.01	0.03
216	688568	中科星图	2,190	78,861.90	0.03
217	300133	华策影视	10,500	78,855.00	0.03
218	688041	海光信息	558	78,839.82	0.03
219	688717	艾罗能源	1,460	78,591.80	0.03
220	688582	芯动联科	1,165	78,288.00	0.03
221	688088	虹软科技	1,610	77,682.50	0.03
222	688161	威高骨科	2,873	76,967.67	0.03
223	688147	微导纳米	2,544	76,777.92	0.03
224	002230	科大讯飞	1,600	76,608.00	0.03
225	600633	浙数文化	5,500	76,120.00	0.03
226	688400	凌云光	2,756	75,982.92	0.03
227	688322	奥比中光	1,277	75,355.77	0.03
228	688443	智翔金泰	2,706	75,064.44	0.03
229	688208	道通科技	2,448	74,908.80	0.03
230	688289	圣湘生物	3,655	74,854.40	0.03
231	688198	佰仁医疗	728	74,758.32	0.03
232	688232	新点软件	2,487	74,709.48	0.03
233	000681	视觉中国	3,700	74,518.00	0.03
234	688027	国盾量子	270	74,252.70	0.03
235	688248	南网科技	2,351	73,962.46	0.03
236	688798	艾为电子	1,084	73,928.80	0.03
237	688686	奥普特	773	73,914.26	0.03
238	002439	启明星辰	4,600	73,554.00	0.03
239	002415	海康威视	2,600	72,098.00	0.03
240	000977	浪潮信息	1,400	71,232.00	0.03
241	688778	厦钨新能	1,239	69,284.88	0.03
242	688235	百济神州	294	68,690.16	0.03
243	603986	兆易创新	500	63,265.00	0.03
244	300378	鼎捷数智	1,700	62,220.00	0.02
245	002881	美格智能	1,300	60,320.00	0.02
246	301236	软通动力	1,100	60,104.00	0.02
247	603881	数据港	2,320	59,276.00	0.02
248	002261	拓维信息	1,900	58,805.00	0.02

249	002714	牧原股份	700	29,407.00	0.01
250	000737	北方铜业	2,700	29,322.00	0.01
251	002705	新宝股份	1,800	26,460.00	0.01
252	603611	诺力股份	1,200	25,848.00	0.01
253	002056	横店东磁	1,800	25,470.00	0.01
254	601899	紫金矿业	1,300	25,350.00	0.01
255	603919	金徽酒	1,400	25,340.00	0.01
256	000598	兴蓉环境	3,500	25,235.00	0.01
257	000680	山推股份	2,800	25,116.00	0.01
258	600664	哈药股份	6,800	25,024.00	0.01
258	601900	南方传媒	1,600	25,024.00	0.01
259	605080	浙江自然	900	25,020.00	0.01
260	000783	长江证券	3,600	24,948.00	0.01
261	603889	新澳股份	4,300	24,940.00	0.01
262	601688	华泰证券	1,400	24,934.00	0.01
263	601137	博威合金	1,400	24,906.00	0.01
264	002237	恒邦股份	2,100	24,780.00	0.01
264	600690	海尔智家	1,000	24,780.00	0.01
265	605166	聚合顺	2,200	24,618.00	0.01
266	600021	上海电力	2,800	24,612.00	0.01
267	600163	中闽能源	4,800	24,576.00	0.01
268	002296	辉煌科技	2,200	24,530.00	0.01
269	601311	骆驼股份	2,700	24,381.00	0.01
270	601233	桐昆股份	2,300	24,380.00	0.01
271	600323	瀚蓝环境	1,000	24,350.00	0.01
272	600989	宝丰能源	1,500	24,210.00	0.01
273	001872	招商港口	1,200	23,832.00	0.01
274	600710	苏美达	2,400	23,064.00	0.01
275	000333	美的集团	300	21,660.00	0.01
276	603713	密尔克卫	400	21,328.00	0.01
277	688082	盛美上海	131	14,926.14	0.01
278	688163	赛伦生物	646	12,564.70	0.00
279	688117	圣诺生物	210	7,066.50	0.00
280	688787	海天瑞声	64	6,795.52	0.00
281	688187	时代电气	144	6,141.60	0.00
282	301312	智立方	140	5,558.00	0.00
283	300724	捷佳伟创	100	5,430.00	0.00
284	688561	奇安信	135	4,587.30	0.00
285	601088	中国神华	100	4,054.00	0.00
286	300628	亿联网络	100	3,476.00	0.00
287	300915	海融科技	140	3,445.40	0.00
288	300816	艾可蓝	100	3,412.00	0.00
289	002472	双环传动	100	3,349.00	0.00

290	600329	达仁堂	100	3,336.00	0.00
291	603699	纽威股份	100	3,117.00	0.00
292	603255	鼎际得	100	3,085.00	0.00
293	605111	新洁能	100	3,074.00	0.00
294	600900	长江电力	100	3,014.00	0.00
295	601689	拓普集团	60	2,835.00	0.00
296	301130	西点药业	100	2,800.00	0.00
297	002156	通富微电	100	2,562.00	0.00
298	301181	标榜股份	100	2,478.00	0.00
299	000895	双汇发展	100	2,441.00	0.00
300	002831	裕同科技	100	2,342.00	0.00
301	600750	江中药业	100	2,183.00	0.00
302	688056	莱伯泰科	64	2,136.32	0.00
303	603477	巨星农牧	100	2,058.00	0.00
304	002273	水晶光电	100	1,997.00	0.00
305	688252	天德钰	79	1,926.02	0.00
306	603201	常润股份	100	1,845.00	0.00
307	002275	桂林三金	100	1,431.00	0.00
308	688475	萤石网络	39	1,229.28	0.00
309	601107	四川成渝	200	1,204.00	0.00
310	603299	苏盐井神	100	947.00	0.00
311	300404	博济医药	100	922.00	0.00
312	002966	苏州银行	100	878.00	0.00
313	688557	兰剑智能	23	688.39	0.00
314	300088	长信科技	100	596.00	0.00
315	688122	西部超导	4	207.52	0.00
316	688114	华大智造	3	194.49	0.00
317	688159	有方科技	2	143.34	0.00
318	688273	麦澜德	3	90.63	0.00
319	688766	普冉股份	1	63.20	0.00
320	688480	赛恩斯	1	32.15	0.00
321	688210	统联精密	1	22.80	0.00
322	688026	洁特生物	1	16.40	0.00
323	688469	芯联集成	1	4.77	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	3,306,762.00	1.29
2	688008	澜起科技	2,544,217.66	0.99
3	000975	山金国际	2,235,906.00	0.87
4	688777	中控技术	2,123,020.96	0.83

5	688099	晶晨股份	1,965,496.12	0.77
6	600988	赤峰黄金	1,961,943.00	0.77
7	600547	山东黄金	1,860,371.46	0.73
8	688188	柏楚电子	1,825,492.82	0.71
9	603893	瑞芯微	1,633,744.00	0.64
10	000623	吉林敖东	1,620,335.00	0.63
11	601318	XD 中国平	1,545,959.00	0.60
12	301061	匠心家居	1,522,062.04	0.59
13	002027	分众传媒	1,517,722.00	0.59
14	002270	华明装备	1,499,398.00	0.59
15	002155	湖南黄金	1,475,761.12	0.58
16	688018	乐鑫科技	1,472,124.02	0.57
17	002043	兔宝宝	1,466,538.00	0.57
18	601717	中创智领	1,448,988.00	0.57
19	688475	萤石网络	1,446,544.32	0.56
20	600216	浙江医药	1,400,683.62	0.55

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601899	紫金矿业	3,225,405.00	1.26
2	688777	中控技术	2,039,725.34	0.80
3	600988	赤峰黄金	1,920,364.00	0.75
4	688099	晶晨股份	1,884,541.29	0.74
5	688008	澜起科技	1,868,518.48	0.73
6	601318	XD 中国平	1,575,354.00	0.61
7	688188	柏楚电子	1,527,262.98	0.60
8	600547	山东黄金	1,526,511.00	0.60
9	000975	山金国际	1,506,088.00	0.59
10	688475	萤石网络	1,396,961.64	0.55
11	600648	外高桥	1,289,761.00	0.50
12	002984	森麒麟	1,223,417.00	0.48
13	601336	新华保险	1,222,589.00	0.48
14	688578	艾力斯	1,210,713.14	0.47
15	688111	金山办公	1,178,111.31	0.46
16	600216	浙江医药	1,158,546.00	0.45
17	601628	中国人寿	1,144,474.00	0.45
18	002043	兔宝宝	1,121,563.00	0.44
19	300881	盛德鑫泰	1,116,898.00	0.44
20	000623	吉林敖东	1,095,483.00	0.43

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	287,887,717.60
卖出股票收入（成交）总额	215,033,075.16

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	58,358,017.47	23.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,695,899.72	8.22
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	17,685,927.09	7.02
8	同业存单	39,801,120.34	15.80
9	其他	-	-
10	合计	136,540,964.62	54.22

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	230023	23 付息国债 23	200,000	24,956,229.51	9.91
2	2500001	25 超长特别 国债 01	200,000	20,344,491.80	8.08
3	112404068	24 中国银行 CD068	200,000	19,930,147.81	7.91
4	112505087	25 建设银行 CD087	200,000	19,870,972.53	7.89
5	019766	25 国债 01	130,000	13,057,296.16	5.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。安集微电子科技(上海)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市浦东新区卫生健康委员会的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	15,576.00
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,576.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	4,509,868.49	1.79
2	113062	常银转债	2,783,830.55	1.11
3	113056	重银转债	1,357,769.06	0.54
4	113685	升 24 转债	518,356.40	0.21
5	113640	苏利转债	274,120.81	0.11
6	123159	崧盛转债	152,508.69	0.06
7	123085	万顺转 2	152,456.29	0.06
8	113681	镇洋转债	152,062.83	0.06
9	128130	景兴转债	151,486.22	0.06
10	123147	中辰转债	151,208.22	0.06
11	123183	海顺转债	151,031.01	0.06
12	113627	太平转债	151,009.92	0.06
13	127059	永东转 2	150,909.23	0.06
14	123168	惠云转债	150,824.76	0.06
15	123119	康泰转 2	150,802.89	0.06
16	128138	侨银转债	150,775.98	0.06
17	127042	嘉美转债	150,737.32	0.06
18	113656	嘉诚转债	150,721.55	0.06
19	123174	精锻转债	150,686.00	0.06
20	123193	海能转债	150,678.88	0.06
21	123192	科思转债	150,663.91	0.06
22	123212	立中转债	150,574.24	0.06
23	118023	广大转债	150,515.26	0.06
24	113647	禾丰转债	150,466.78	0.06
25	123165	回天转债	150,411.78	0.06
26	123120	隆华转债	150,401.08	0.06
27	111019	宏柏转债	150,385.99	0.06
28	113631	皖天转债	150,304.22	0.06
29	113670	金 23 转债	150,287.79	0.06
30	113636	甬金转债	150,174.37	0.06
31	118028	会通转债	150,107.93	0.06
32	118013	道通转债	150,018.39	0.06
33	128135	洽洽转债	149,990.99	0.06
34	123133	佩蒂转债	149,985.53	0.06
35	127041	弘亚转债	149,869.48	0.06

36	123178	花园转债	149,856.27	0.06
37	113606	荣泰转债	149,800.69	0.06
38	113676	荣 23 转债	149,740.26	0.06
39	127076	中宠转 2	149,498.34	0.06
40	123213	天源转债	148,663.35	0.06
41	113615	金诚转债	148,327.05	0.06
42	113690	豪 24 转债	2,435.60	0.00
43	128141	旺能转债	1,299.93	0.00
44	111005	富春转债	1,242.56	0.00
45	127024	盈峰转债	1,235.33	0.00
46	110081	闻泰转债	1,116.61	0.00
47	113048	晶科转债	1,106.42	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧瑾添混合 A	198	1,436,939.93	284,477,696.86	99.99%	36,409.11	0.01%
中欧瑾添混合 C	86	2,540.44	170,338.41	77.97%	48,139.43	22.03%
合计	284	1,002,579.52	284,648,035.27	99.97%	84,548.54	0.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧瑾添混合 A	9,361.86	0.00%
	中欧瑾添混合 C	127.12	0.06%

	合计	9,488.98	0.00%
--	----	----------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中欧瑾添混合 A	0~10
	中欧瑾添混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧瑾添混合 A	0
	中欧瑾添混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧瑾添混合 A	中欧瑾添混合 C
基金合同生效日（2021 年 11 月 9 日）基金份额总额	68,894,827.64	140,012,170.99
本报告期期初基金份额总额	76,830,078.51	214,050,489.18
本报告期基金总申购份额	284,507,802.16	435,066.89
减：本报告期基金总赎回份额	76,823,774.70	214,267,078.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	284,514,105.97	218,477.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-06-10
采取稽查或处罚等措施的机构	上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内控管理不完善
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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
兴业证券	3	502,324,420.76	100.00	219,052.04	100.00	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取

方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	332,596,883.35	100.00	4,108,700,000.00	100.00	-	-

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧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	2025-01-17
2	中欧瑾添混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-17
3	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
4	中欧基金管理有限公司关于提高中欧瑾添混合型证券投资基金 C 类基金份额净值精度的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-25
5	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
6	中欧瑾添混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2025-03-04
7	中欧瑾添混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-03-05
8	中欧瑾添混合型证券投资基金更新	中国证监会指定媒介	2025-03-05

	招募说明书（2025 年 3 月）		
9	中欧瑾添混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
10	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
11	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
12	中欧瑾添混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
13	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
14	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
15	中欧瑾添混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-06-03
16	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 01 月 26 日	142,558,077.51	0.00	142,558,077.51	0.00	0.00%
	2	2025 年 01 月 22 日至 2025 年 06 月 30 日	0.00	284,477,696.86	0.00	284,477,696.86	99.91%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。</p>							

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日