

# 中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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

<b>§ 1 重要提示及目录 .....</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介 .....</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告 .....</b>	<b>9</b>
4.1 基金经理及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54

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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 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	98,014,090.68 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	57,250,248.21 份	40,763,842.47 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	<p>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%。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

### 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	朱志明
	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	100010	
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	5,327,087.52	4,528,483.34
本期利润	9,165,455.32	8,066,947.00
加权平均基金份额本期利润	0.1374	0.1450
本期加权平均净值利润率	12.75%	13.63%
本期基金份额净值增长率	13.80%	13.47%

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	9,597,890.09	6,279,632.06	
期末可供分配基金份额利润	0.1676	0.1540	
期末基金资产净值	66,848,138.30	47,043,474.53	
期末基金份额净值	1.1676	1.1540	
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	19.16%	17.77%	

- 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	份额净值增长率为标准差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	5.94%	0.85%	5.71%	1.00%	0.23%	-0.15%
过去三个月	6.58%	1.78%	4.25%	1.90%	2.33%	-0.12%
过去六个月	13.80%	1.56%	10.26%	1.71%	3.54%	-0.15%
过去一年	45.78%	1.85%	35.04%	1.98%	10.74%	-0.13%
自基金合同生效起至今	19.16%	1.69%	2.85%	1.80%	16.31%	-0.11%

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。

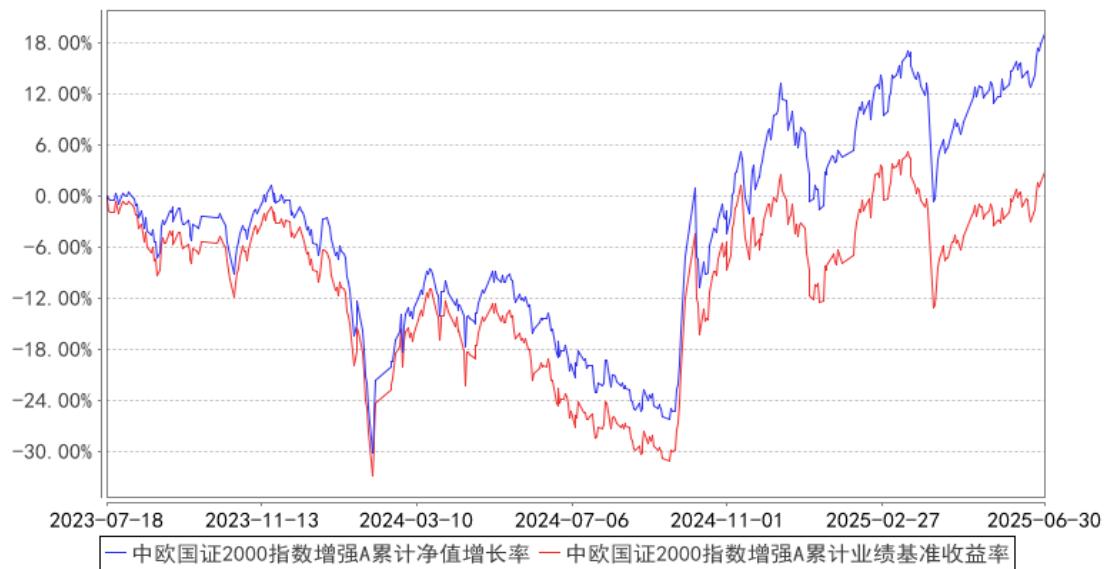
## 中欧国证 2000 指数增强 C

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
过去一个月	5.88%	0.85%	5.71%	1.00%	0.17%	-0.15%
过去三个月	6.42%	1.78%	4.25%	1.90%	2.17%	-0.12%
过去六个月	13.47%	1.56%	10.26%	1.71%	3.21%	-0.15%
过去一年	44.91%	1.85%	35.04%	1.98%	9.87%	-0.13%
自基金合同生效起至今	17.77%	1.69%	2.85%	1.80%	14.92%	-0.11%

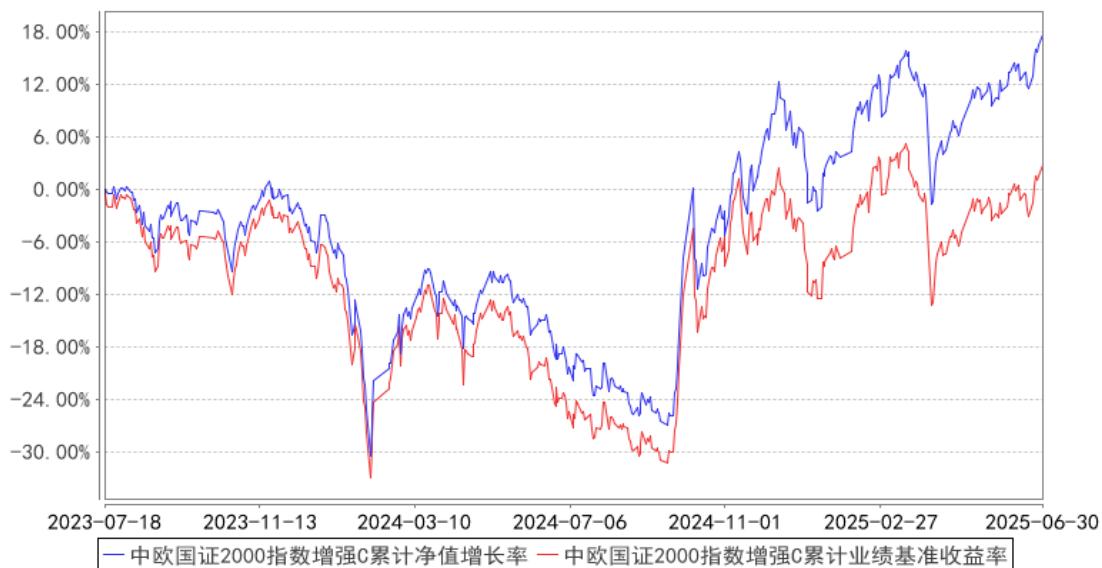
注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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**



## § 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		
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	-	3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	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遵规守信情况的说明**

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**

2025 年上半年，A 股呈现“震荡修复、结构分化”特征。宽基指数中北证 50、中证 1000 等中小盘指数延续强势，沪深 300 等大盘指数表现相对平淡。行业层面，TMT 板块受全球 AI 技术突破及国内新型工业化政策推动持续领涨，大金融与科技共同构成双主线，传统周期板块分化明显，有色金属受益于美联储降息预期下的黄金行情。分节奏来看，市场年初在政策预期驱动下震荡上行，中小盘成长风格占优，2 月春节因素致交投清淡但机器人、低空经济等主题活跃；随后在消化 3 月地缘冲突及 4 月美国对华加征关税冲击后，上证指数展现韧性逐步修复，5 月国内流动性

改善与中美关税和解形成共振，金融、光模块等权重板块引领收复失地，6月在地缘冲突与联储鸽派表态交织下，军工、银行等避险资产与AI产业链共同发力，北向资金上半年净流入显著，推动市场风险偏好回升。宏观层面，弱复苏背景下产业政策与外资流向主导行情，地缘风险与关税冲击等外部扰动逐步消退，景气赛道修复与权重板块发力共同塑造了“中小盘突围、政策护航”的格局，为下半年结构性行情铺垫基础。从大类因子来看的话，量价、成长、盈利预测类表现较优，价值和质量类表现相对逊色；从风格因子来看的话，小市值因子、低波动因子表现不错，估值、盈利、杠杆因子表现不佳。

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。

#### 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 13.80%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%；基金 C 类份额净值增长率为 13.47%，同期业绩比较基准收益率为 10.26%。

#### 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，短期地缘政治因素或许还会扰动市场节奏，引发阶段性波动。但当前中国市场估值处于低位区间，且在全球资产配置中仍处低配状态，配置性价比突出。面对外部环境压力，国内刺激消费、拉动内需的政策将为经济增长构筑支撑。但也需要保持谨慎的是，下半年部分高增长基数的行业或有增速回落的压力。此外，出口产业链中，海外库存较高的环节也可能受到全球关税压力传导而需求回落。因此，市场需要进一步挖掘结构性投资机会。从行业布局看，我们认为三大方向具备潜力：首先是科技成长领域，AI 产业已进入“硬件铺路、软件变现”的关键阶段，重点关注估值合理的应用层企业，特别是具备垂直行业 know-how 的解决方案提供商。其次，传统周期行业迎来供给侧改革红利，部分化工、建材细分领域经过三年产能出清，行业集中度显著提升，在“整治内卷式竞争”政策指引下，头部优质企业盈利修复弹性可观。最后，消费行业中的“隐形冠军”值得长期布局，那些维持健康资产负债表、持续进行渠道优化的企业，一旦消费景气度回暖，将展现更强的业绩弹性。值得注意的是，这三个方向都符合“高质量增长”的转型主线，在估值洼地和政策催化双重作用下，有望成为引领市场复苏的重要引擎。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关

意见)包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配,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**

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损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧国证 2000 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	9,516,625.82	8,683,892.22
结算备付金		47,887.91	788,530.92
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	107,023,690.98	137,969,908.75
其中：股票投资		107,023,690.98	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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		100,223.51	534,328.66
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		116,688,428.22	147,976,660.55
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
<b>负债：</b>			
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		2,572,949.68	781,442.62

应付管理人报酬		100,403.40	147,339.48
应付托管费		10,040.31	14,733.94
应付销售服务费		23,983.84	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	6.4.7.6	89,438.16	50,000.00
负债合计		2,796,815.39	1,034,775.87
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	98,014,090.68	143,839,842.48
未分配利润	6.4.7.8	15,877,522.15	3,102,042.20
净资产合计		113,891,612.83	146,941,884.68
负债和净资产总计		116,688,428.22	147,976,660.55

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 98,014,090.68 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.1676 元，基金份额总额 57,250,248.21 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.1540 元，基金份额总额 40,763,842.47 份。

## 6.2 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 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
<b>一、营业收入</b>		18,215,650.11	-61,601,825.97
1. 利息收入		22,141.37	54,673.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,141.37	47,228.31
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）		10,785,542.26	-51,140,092.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,390,592.10	-54,636,401.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6. 4. 7. 13	245, 129. 32	282, 116. 17
股利收益	6. 4. 7. 14	1, 149, 820. 84	3, 214, 193. 23
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	7, 376, 831. 46	-10, 551, 810. 01
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	31, 135. 02	35, 402. 95
<b>减：二、营业总支出</b>		983, 247. 79	2, 259, 246. 15
1. 管理人报酬		651, 470. 36	1, 573, 684. 34
2. 托管费		65, 146. 99	157, 368. 41
3. 销售服务费		177, 056. 71	433, 613. 40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 17	-	-
7. 税金及附加		1, 230. 57	1, 044. 64
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	88, 343. 16	93, 535. 36
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		17, 232, 402. 32	-63, 861, 072. 12
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		17, 232, 402. 32	-63, 861, 072. 12
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		17, 232, 402. 32	-63, 861, 072. 12

### 6.3 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 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	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）	-45,825,751.80	-	12,775,479.95	-33,050,271.85
(一)、综合收益总额	-	-	17,232,402.32	17,232,402.32
(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）	-45,825,751.80	-	-4,456,922.37	-50,282,674.17
其中：1.基金申购款	62,662,317.13	-	4,695,774.07	67,358,091.20
2.基金赎回款	108,488,068.93	-	-9,152,696.44	-117,640,765.37
(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	98,014,090.68	-	15,877,522.15	113,891,612.83
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	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）	-99,060,035.83	-	-49,053,526.07	-148,113,561.90
(一)、综合收益总额	-	-	-63,861,072.12	-63,861,072.12
(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）	-99,060,035.83	-	14,807,546.05	-84,252,489.78
其中：1.基金申购款	107,933,196.47	-	-13,895,803.46	94,037,393.01
2.基金赎回款	-	-	28,703,349.51	-178,289,882.79

	206,993,232.30			
(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	330,867,673.55	-	-61,165,486.65	269,702,186.90

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：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

根据《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》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、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、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）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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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管理信息披露管理办法》、《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	2,507,053.38
等于：本金	2,506,774.46
加：应计利息	278.92
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	7,009,572.44
等于：本金	7,009,080.83
加：应计利息	491.61
减：坏账准备	—
合计	9,516,625.82

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	102,929,548.58	—	107,023,690.98	4,094,142.40
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	102,929,548.58	—	107,023,690.98	4,094,142.40

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	19,835.79
其他应付	10,095.00
合计	89,438.16

### 6.4.7.7 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6月30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	34,159,590.53	34,159,590.53
本期赎回(以“-”号填列)	-49,971,516.31	-49,971,516.31
本期末	57,250,248.21	57,250,248.21

中欧国证 2000 指数增强 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	70,777,668.49	70,777,668.49
本期申购	28,502,726.60	28,502,726.60
本期赎回(以“-”号填列)	-58,516,552.62	-58,516,552.62
本期末	40,763,842.47	40,763,842.47

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	5,327,087.52	3,838,367.80	9,165,455.32
本期基金份额交易产生的变动数	-2,040,198.75	576,593.85	-1,463,604.90
其中：基金申购款	5,581,933.56	-2,228,766.61	3,353,166.95
基金赎回款	-7,622,132.31	2,805,360.46	-4,816,771.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,305,446.79	-1,707,556.70	9,597,890.09

##### 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	4,528,483.34	3,538,463.66	8,066,947.00
本期基金份额交易产生的变动数	-4,124,605.83	1,131,288.36	-2,993,317.47
其中：基金申购款	3,608,152.23	-2,265,545.11	1,342,607.12
基金赎回款	-7,732,758.06	3,396,833.47	-4,335,924.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,491,051.77	-1,211,419.71	6,279,632.06

#### 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	3,492.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14,676.28
结算备付金利息收入	3,972.91
其他	-
合计	22,141.37

### 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	365,078,379.68
减：卖出股票成本总额	355,334,890.01
减：交易费用	352,897.57
买卖股票差价收入	9,390,592.10

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

### 6.4.7.13 衍生工具收益

#### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	245,129.32

### 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	1,149,820.84
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	1,149,820.84

### 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	7,376,831.46
股票投资	7,376,831.46
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	7,376,831.46

#### 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	30,953.82
基金转换费收入	181.20
合计	31,135.02

#### 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	—
账户维护费	9,000.00
合计	88,343.16

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

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

金额单位：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	
	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	339,858,915.30	49.87	1,087,386,101.20	47.37

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	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	63,295.27	49.89	-	-

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 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	558,786.53	46.63	-	-

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）。

#### 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	651,470.36	1,573,684.34
其中：应支付销售机构的客户维 护费	243,844.71	606,075.80
应支付基金管理人的净管理费	407,625.65	967,608.54

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。

##### 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	65,146.99	157,368.41

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。

#### 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		
	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	50.48	50.48
中欧财富	0.00	529.97	529.97
中信建投	0.00	118,458.48	118,458.48
合计	0.00	119,038.93	119,038.93
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		
	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	324.85	324.85
中欧财富	0.00	292.10	292.10
中信建投	0.00	272,488.81	272,488.81
合计	0.00	273,105.76	273,105.76

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。

#### 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

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。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信建投证券股份有限公司	5,889,999.04	9,032.77	10,161,940.47	16,963.78

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。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	券 名 称	认购 日	期	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
001335	信凯科 技	2025 年4 月2 日	6 个月	新股 流通 受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股 份	2025 年1 月16 日	6 个月	新股 流通 受限	5.30	14.44	404	2,141.20	5,833.76	-
001382	新亚电 缆	2025 年3 月13 日	6 个月	新股 流通 受限	7.40	20.21	293	2,168.20	5,921.53	-
001388	信通电 子	2025 年6 月24 日	1 个 月 (含 )	新股 未上 市	16.42	16.42	618	10,147.56	10,147.56	-
001388	信通电 子	2025 年6 月24 日	6 个月	新股 流通 受限	16.42	16.42	69	1,132.98	1,132.98	-
001390	古麒绒 材	2025 年5 月21 日	6 个月	新股 流通 受限	12.08	18.12	117	1,413.36	2,120.04	-
001395	亚联机 械	2025 年1 月20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠 佳	2025 年2 月24 日	6 个月	新股 流通 受限	28.33	44.98	130	3,682.90	5,847.40	-
301275	汉朔科 技	2025 年3 月4 日	6 个月	新股 流通 受限	27.50	56.19	130	3,575.00	7,304.70	-
301479	弘景光 电	2025 年3 月6 日	6 个月	新股 流通 受限	29.93	77.87	112	3,352.00	8,721.44	-
301501	恒	2025	6 个月	新股	27.53	45.22	116	3,193.60	5,245.52	-

	鑫生活	年3月11日		流通受限						
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	143	2,359.50	3,925.35	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	30	2,688.00	4,184.40	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	159	2,710.95	4,626.90	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	574	3,845.80	14,235.20	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	82	2,710.92	3,891.72	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	280	3,304.00	6,434.40	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	306	3,142.62	6,851.34	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	202	2,585.60	8,997.08	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	149	1,832.70	8,113.05	-
688545	兴	2025	6 个月	新股	11.68	26.95	464	5,419.52	12,504.80	-

	福 电 子	年 1 月 15 日		流通 受限						
--	-------------	------------------	--	----------	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600962	国投中鲁	2025年6月23日	重大事项停牌	13.43	2025年7月7日	14.77	35,300	502,132.00	474,079.00	-
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项停牌	38.05	2025年7月11日	39.98	4,700	120,603.23	178,835.00	-

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例

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

于 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	9,516,625.82	-	-	-	9,516,625.82
结算备付金	47,887.91	-	-	-	47,887.91
交易性金融资产	-	-	-	107,023,690.98	107,023,690.98
应收申购款	-	-	-	100,223.51	100,223.51
资产总计	9,564,513.73	-	-	107,123,914.49	116,688,428.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,572,949.68	2,572,949.68
应付管理人报酬	-	-	-	100,403.40	100,403.40
应付托管费	-	-	-	10,040.31	10,040.31
应付销售服务费	-	-	-	23,983.84	23,983.84
其他负债	-	-	-	89,438.16	89,438.16
负债总计	-	-	-	2,796,815.39	2,796,815.39
利率敏感度缺口	9,564,513.73	-	-	104,327,099.10	113,891,612.83
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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（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）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	107,023,690.98	93.97	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	107,023,690.98	93.97	137,969,908.75	93.89

#### 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）
分析	业绩比较基准上升5%	5,129,546.87	6,898,550.99
	业绩比较基准下降5%	-5,129,546.87	-6,898,550.99

## 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	106,227,137.11	137,574,952.58
第二层次	664,194.54	18,302.40
第三层次	132,359.33	376,653.77
合计	107,023,690.98	137,969,908.75

#### 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	107,023,690.98	91.72
	其中：股票	107,023,690.98	91.72
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	9,564,513.73	8.20
8	其他各项资产	100,223.51	0.09
9	合计	116,688,428.22	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	260,460.00	0.23
B	采矿业	545,291.00	0.48
C	制造业	66,865,279.15	58.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,598,342.00	2.28
E	建筑业	1,593,901.00	1.40
F	批发和零售业	5,986,418.00	5.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,635,316.00	3.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,571,410.96	11.92

J	金融业	1,051,291.00	0.92
K	房地产业	947,710.00	0.83
L	租赁和商务服务业	2,993,495.00	2.63
M	科学、研究和技术服务业	1,527,858.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	1,853,335.00	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	417,942.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	3,032,002.00	2.66
S	综合	-	-
	合计	106,880,051.11	93.84

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	129,819.17	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学、研究和技术服务业	11,576.70	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	143,639.87	0.13

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300226	上海钢联	32,200	735,448.00	0.65
2	601609	金田股份	73,000	511,730.00	0.45
3	600595	中孚实业	115,800	507,204.00	0.45
4	600179	安通控股	177,900	491,004.00	0.43
5	300232	洲明科技	67,700	490,148.00	0.43
6	300978	东箭科技	43,700	487,692.00	0.43
7	600864	哈投股份	81,300	485,361.00	0.43
8	601096	宏盛华源	117,100	484,794.00	0.43
9	300241	瑞丰光电	84,200	479,940.00	0.42
10	002491	通鼎互联	84,300	478,824.00	0.42
11	603699	纽威股份	15,300	476,901.00	0.42
12	002454	松芝股份	61,600	475,552.00	0.42
13	600962	国投中鲁	35,300	474,079.00	0.42
14	300292	吴通控股	96,400	469,468.00	0.41
15	300369	绿盟科技	60,100	466,977.00	0.41
16	300532	今天国际	37,500	452,250.00	0.40
17	300821	东岳硅材	57,400	451,164.00	0.40
18	605305	中际联合	16,200	450,036.00	0.40
19	000652	泰达股份	105,400	437,410.00	0.38
20	300768	迪普科技	25,400	435,610.00	0.38
21	002419	天虹股份	80,600	432,016.00	0.38
22	603256	宏和科技	29,000	429,780.00	0.38
23	300151	昌红科技	34,700	427,157.00	0.38
24	603668	天马科技	32,400	427,032.00	0.37
25	603698	航天工程	24,000	422,880.00	0.37
26	300825	阿尔特	39,100	422,671.00	0.37
27	002925	盈趣科技	23,400	420,732.00	0.37
28	002970	锐明技术	8,500	419,900.00	0.37

29	300143	盈康生命	43,400	417,942.00	0.37
30	688128	中国电研	17,000	416,500.00	0.37
31	688588	凌志软件	28,000	407,960.00	0.36
32	300655	晶瑞电材	40,100	401,401.00	0.35
33	603601	再升科技	98,600	400,316.00	0.35
34	000758	中色股份	79,300	398,879.00	0.35
35	600726	华电能源	169,700	397,098.00	0.35
36	301017	漱玉平民	30,800	395,164.00	0.35
37	002396	星网锐捷	17,600	395,120.00	0.35
38	002935	天奥电子	24,600	393,600.00	0.35
39	300168	万达信息	51,200	392,704.00	0.34
40	600012	皖通高速	22,900	388,842.00	0.34
41	600817	宇通重工	32,800	388,352.00	0.34
42	300079	数码视讯	65,600	383,760.00	0.34
43	600640	国脉文化	31,500	381,780.00	0.34
44	301270	汉仪股份	8,000	381,280.00	0.33
45	002761	浙江建投	42,800	379,636.00	0.33
46	002823	凯中精密	26,799	375,989.97	0.33
47	301180	万祥科技	25,500	375,615.00	0.33
48	688233	神工股份	11,800	374,886.00	0.33
49	600305	恒顺醋业	48,300	373,359.00	0.33
50	600058	五矿发展	48,200	372,586.00	0.33
51	603060	国检集团	56,300	371,017.00	0.33
52	002782	可立克	28,200	366,036.00	0.32
53	603888	新华网	15,100	361,494.00	0.32
54	300222	科大智能	35,300	359,707.00	0.32
55	603609	禾丰股份	43,100	356,006.00	0.31
56	600458	时代新材	25,900	355,348.00	0.31
57	002267	陕天然气	46,900	355,033.00	0.31
58	002349	精华制药	49,200	353,748.00	0.31
59	603766	隆鑫通用	27,600	352,176.00	0.31
60	688685	迈信林	6,300	351,855.00	0.31
61	300320	海达股份	35,300	350,882.00	0.31
62	002928	华夏航空	42,200	350,682.00	0.31
63	300560	中富通	25,900	349,909.00	0.31
64	600713	XD 南京医	68,100	344,586.00	0.30
65	300206	理邦仪器	28,600	343,772.00	0.30
66	002206	海利得	66,500	339,815.00	0.30
67	301376	致欧科技	18,600	339,450.00	0.30
68	300802	矩子科技	18,000	339,120.00	0.30
69	300236	上海新阳	8,700	337,560.00	0.30
70	000607	华媒控股	73,100	334,067.00	0.29
71	300578	会畅通讯	15,900	333,423.00	0.29

72	600351	亚宝药业	54,700	332,029.00	0.29
73	300393	中来股份	56,900	327,744.00	0.29
74	300293	蓝英装备	13,000	326,820.00	0.29
75	300400	劲拓股份	19,400	326,696.00	0.29
76	300755	华致酒行	16,800	324,240.00	0.28
77	688150	莱特光电	12,900	318,888.00	0.28
78	000551	创元科技	24,700	317,395.00	0.28
79	002438	江苏神通	25,100	315,758.00	0.28
80	300869	康泰医学	22,000	315,480.00	0.28
81	300788	中信出版	9,800	314,384.00	0.28
82	300231	银信科技	25,500	313,905.00	0.28
83	600664	哈药股份	85,100	313,168.00	0.27
84	300266	兴源环境	106,900	312,148.00	0.27
85	605366	宏柏新材	49,700	311,122.00	0.27
86	002111	威海广泰	28,800	309,024.00	0.27
87	002351	漫步者	23,500	308,320.00	0.27
88	300160	秀强股份	54,800	307,976.00	0.27
89	688787	海天瑞声	2,900	307,922.00	0.27
90	002587	奥拓电子	47,700	307,665.00	0.27
91	301408	华人健康	20,200	307,242.00	0.27
92	601068	中铝国际	66,800	305,276.00	0.27
93	600229	城市传媒	42,700	304,451.00	0.27
94	002344	海宁皮城	70,000	303,800.00	0.27
95	002912	中新赛克	12,700	302,895.00	0.27
96	603466	风语筑	30,000	302,700.00	0.27
97	300027	华谊兄弟	112,800	302,304.00	0.27
98	301221	光庭信息	5,800	301,426.00	0.26
99	300685	艾德生物	14,000	301,420.00	0.26
100	300684	中石科技	12,600	300,888.00	0.26
101	300036	超图软件	19,700	300,622.00	0.26
102	601200	上海环境	37,800	300,132.00	0.26
103	300188	国投智能	21,700	299,460.00	0.26
104	002649	博彦科技	20,600	299,318.00	0.26
105	002004	华邦健康	71,700	298,989.00	0.26
106	688029	南微医学	4,400	297,220.00	0.26
107	301215	中汽股份	47,900	296,980.00	0.26
108	600812	华北制药	48,000	296,640.00	0.26
109	688097	博众精工	10,600	295,846.00	0.26
110	688380	中微半导	10,900	295,390.00	0.26
111	300772	运达股份	22,900	294,952.00	0.26
112	300259	新天科技	82,900	294,295.00	0.26
113	301262	海看股份	11,081	292,095.16	0.26
114	600169	太原重工	119,700	289,674.00	0.25

115	300365	恒华科技	43,600	287,324.00	0.25
116	600237	铜峰电子	39,400	285,650.00	0.25
117	000791	甘肃能源	44,500	283,910.00	0.25
118	600880	博瑞传播	52,900	283,015.00	0.25
119	301102	兆讯传媒	25,900	282,828.00	0.25
120	300456	赛微电子	16,400	281,916.00	0.25
121	000727	冠捷科技	116,000	281,880.00	0.25
122	600269	赣粤高速	55,700	281,842.00	0.25
123	300080	易成新能	67,300	281,314.00	0.25
124	301332	德尔玛	27,400	280,576.00	0.25
125	300770	新媒股份	7,000	279,930.00	0.25
126	603230	内蒙新华	21,600	278,856.00	0.24
127	301328	维峰电子	6,600	278,190.00	0.24
128	002232	启明信息	15,200	278,160.00	0.24
129	688660	电气风电	32,000	277,760.00	0.24
130	002777	久远银海	15,200	277,552.00	0.24
131	688533	上声电子	10,300	277,379.00	0.24
132	300098	高新兴	53,300	277,160.00	0.24
133	300257	开山股份	27,500	276,925.00	0.24
134	000030	富奥股份	47,000	276,830.00	0.24
135	600710	苏美达	28,700	275,807.00	0.24
136	601900	南方传媒	17,600	275,264.00	0.24
137	300420	五洋自控	79,900	274,856.00	0.24
138	300447	全信股份	17,500	274,225.00	0.24
139	002950	奥美医疗	31,800	273,480.00	0.24
140	600020	中原高速	57,100	272,938.00	0.24
141	603043	广州酒家	17,500	272,650.00	0.24
142	300360	炬华科技	17,300	272,475.00	0.24
143	600966	博汇纸业	61,600	272,272.00	0.24
144	301087	可孚医疗	8,200	272,240.00	0.24
145	002079	苏州固锝	27,800	271,050.00	0.24
146	601801	皖新传媒	39,600	270,468.00	0.24
147	600783	鲁信创投	21,600	270,000.00	0.24
148	688586	江航装备	23,962	269,572.50	0.24
149	688277	天智航	19,200	266,880.00	0.23
150	301123	奕东电子	11,700	266,877.00	0.23
151	603708	家家悦	26,000	265,200.00	0.23
152	300737	科顺股份	55,000	265,100.00	0.23
153	301080	百普赛斯	3,700	264,661.00	0.23
154	600268	国电南自	33,800	264,316.00	0.23
155	002053	云南能投	24,000	264,240.00	0.23
156	600662	外服控股	51,700	264,187.00	0.23
157	000900	现代投资	61,400	259,722.00	0.23

158	300790	宇瞳光学	12,400	259,284.00	0.23
159	300341	麦克奥迪	16,000	258,880.00	0.23
160	300552	万集科技	9,200	256,128.00	0.22
161	300063	天龙集团	29,700	255,420.00	0.22
162	300566	激智科技	13,100	255,319.00	0.22
163	601700	风范股份	54,600	254,982.00	0.22
164	000523	红棉股份	78,100	254,606.00	0.22
165	600548	深高速	24,300	254,421.00	0.22
166	603203	快克智能	10,200	253,674.00	0.22
167	301207	华兰疫苗	15,000	252,900.00	0.22
168	002539	云图控股	26,900	252,322.00	0.22
169	300415	伊之密	12,500	251,875.00	0.22
170	300048	合康新能	42,900	251,823.00	0.22
171	000544	中原环保	30,800	250,404.00	0.22
172	000550	江铃汽车	12,300	250,059.00	0.22
173	603628	清源股份	20,400	249,084.00	0.22
174	603636	南威软件	19,700	249,008.00	0.22
175	002455	百川股份	33,200	248,336.00	0.22
176	300711	广哈通信	10,800	247,104.00	0.22
177	600757	长江传媒	26,400	244,992.00	0.22
178	300319	麦捷科技	22,800	244,872.00	0.22
179	300331	苏大维格	10,800	244,404.00	0.21
180	605168	三人行	8,300	244,269.00	0.21
181	300471	厚普股份	22,900	243,656.00	0.21
182	300006	莱美药业	64,900	243,375.00	0.21
183	002242	九阳股份	25,600	243,200.00	0.21
184	603328	依顿电子	24,700	242,307.00	0.21
185	002328	新朋股份	41,500	241,530.00	0.21
186	002437	誉衡药业	84,600	241,110.00	0.21
187	300119	瑞普生物	12,400	240,808.00	0.21
188	688663	新风光	8,900	239,855.00	0.21
189	601208	东材科技	25,300	239,844.00	0.21
190	300843	胜蓝股份	7,500	237,675.00	0.21
191	000755	山西高速	48,600	236,682.00	0.21
192	300389	艾比森	20,400	236,232.00	0.21
193	000957	中通客车	21,600	236,088.00	0.21
194	000936	华西股份	34,300	235,984.00	0.21
195	600975	新五丰	39,000	235,950.00	0.21
196	603519	立霸股份	19,400	235,904.00	0.21
197	300861	美畅股份	11,600	235,828.00	0.21
198	601330	绿色动力	30,800	235,312.00	0.21
199	002434	万里扬	32,100	235,293.00	0.21
199	603969	银龙股份	32,100	235,293.00	0.21

200	600388	龙净环保	19,600	235,200.00	0.21
201	300317	珈伟新能	56,700	234,738.00	0.21
202	300976	达瑞电子	4,700	234,013.00	0.21
203	688336	三生国健	4,300	233,232.00	0.20
204	002516	旷达科技	45,200	232,780.00	0.20
205	000751	锌业股份	74,000	232,360.00	0.20
206	688108	赛诺医疗	20,700	232,254.00	0.20
207	300304	云意电气	31,800	231,504.00	0.20
208	688232	新点软件	7,700	231,308.00	0.20
209	600335	XD 国机汽	35,700	230,265.00	0.20
210	002840	华统股份	21,900	227,979.00	0.20
211	300559	佳发教育	19,300	227,740.00	0.20
212	603687	大胜达	30,600	227,358.00	0.20
213	300862	蓝盾光电	8,500	225,080.00	0.20
214	300590	移为通信	17,300	225,073.00	0.20
215	300197	节能铁汉	106,600	222,794.00	0.20
216	001313	粤海饲料	28,500	219,450.00	0.19
217	002613	北玻股份	59,200	218,448.00	0.19
218	300066	三川智慧	49,400	218,348.00	0.19
219	002913	奥士康	7,400	217,634.00	0.19
220	002390	信邦制药	62,400	217,152.00	0.19
221	300596	利安隆	7,500	215,775.00	0.19
222	603713	密尔克卫	4,000	213,280.00	0.19
223	000885	城发环境	16,000	213,120.00	0.19
224	601311	骆驼股份	23,500	212,205.00	0.19
225	002322	理工能科	17,500	211,750.00	0.19
226	603633	徕木股份	24,200	210,298.00	0.18
227	000906	浙商中拓	33,000	210,210.00	0.18
228	300504	天邑股份	13,300	209,874.00	0.18
229	300363	博腾股份	12,200	208,376.00	0.18
230	000828	东莞控股	19,400	207,386.00	0.18
231	603031	安孚科技	7,000	207,130.00	0.18
232	301060	兰卫医学	21,400	206,510.00	0.18
233	300219	鸿利智汇	30,400	204,288.00	0.18
234	688176	亚虹医药	23,000	204,010.00	0.18
235	688779	五矿新能	37,487	203,929.28	0.18
236	688095	福昕软件	3,000	203,730.00	0.18
237	002852	道道全	21,300	203,628.00	0.18
238	002421	达实智能	60,500	203,280.00	0.18
239	002583	海能达	16,500	203,115.00	0.18
240	002130	沃尔核材	8,500	202,470.00	0.18
241	000019	深粮控股	30,400	202,464.00	0.18
242	603966	法兰泰克	21,800	202,304.00	0.18

243	600073	光明肉业	27,300	201,474.00	0.18
244	601949	中国出版	30,300	201,192.00	0.18
245	002847	盐津铺子	2,500	201,000.00	0.18
246	603866	桃李面包	37,200	200,880.00	0.18
247	300706	阿石创	8,700	200,100.00	0.18
248	002933	新兴装备	5,600	200,032.00	0.18
249	002996	顺博合金	26,900	197,984.00	0.17
250	603299	苏盐井神	20,900	197,923.00	0.17
251	603318	水发燃气	30,000	197,700.00	0.17
252	603111	康尼机电	30,000	197,400.00	0.17
253	300739	明阳电路	13,300	197,372.00	0.17
254	300571	平治信息	6,200	197,284.00	0.17
255	300460	惠伦晶体	17,300	196,874.00	0.17
256	600125	铁龙物流	34,600	195,836.00	0.17
257	600033	福建高速	55,100	195,054.00	0.17
258	300358	楚天科技	25,000	195,000.00	0.17
259	002884	凌霄泵业	12,100	192,874.00	0.17
260	301216	万凯新材	15,400	192,038.00	0.17
261	600635	大众公用	48,900	190,710.00	0.17
262	000812	陕西金叶	40,500	189,945.00	0.17
263	603989	艾华集团	12,300	189,420.00	0.17
264	600826	兰生股份	23,000	188,600.00	0.17
265	002221	东华能源	19,500	188,370.00	0.17
266	600550	保变电气	21,900	188,340.00	0.17
267	605123	派克新材	2,400	186,960.00	0.16
268	688579	山大地纬	16,700	186,873.00	0.16
269	002869	金溢科技	7,800	186,654.00	0.16
270	002971	和远气体	8,000	186,640.00	0.16
271	300481	濮阳惠成	13,000	186,030.00	0.16
272	002891	中宠股份	3,000	185,610.00	0.16
273	600602	云赛智联	9,200	185,564.00	0.16
274	301039	中集车辆	22,700	184,551.00	0.16
275	603239	浙江仙通	12,200	184,342.00	0.16
276	600874	创业环保	30,800	183,876.00	0.16
277	300981	中红医疗	15,240	182,422.80	0.16
278	300062	中能电气	33,900	182,382.00	0.16
279	000912	泸天化	39,400	182,028.00	0.16
280	300830	金现代	19,900	181,687.00	0.16
281	603711	香飘飘	13,000	181,480.00	0.16
282	601326	秦港股份	56,100	181,203.00	0.16
283	300582	英飞特	14,100	180,762.00	0.16
284	002283	天润工业	30,300	180,588.00	0.16
285	688313	仕佳光子	4,700	178,835.00	0.16

286	688088	虹软科技	3,700	178,525.00	0.16
287	000928	中钢国际	28,100	176,468.00	0.15
288	603187	海容冷链	15,000	176,400.00	0.15
289	002953	日丰股份	16,900	175,422.00	0.15
290	300497	富祥药业	19,400	174,406.00	0.15
291	300388	节能国祯	25,000	174,000.00	0.15
292	002462	嘉事堂	13,000	173,810.00	0.15
293	002870	香山股份	5,500	173,305.00	0.15
294	688208	道通科技	5,660	173,196.00	0.15
295	002606	大连电瓷	19,300	172,156.00	0.15
296	300272	开能健康	26,200	172,134.00	0.15
297	002783	凯龙股份	19,800	170,874.00	0.15
298	601606	长城军工	5,800	168,490.00	0.15
299	600252	中恒集团	66,500	168,245.00	0.15
300	600846	同济科技	14,700	167,286.00	0.15
301	300105	龙源技术	21,600	166,536.00	0.15
302	300171	东富龙	12,500	166,125.00	0.15
303	603386	骏亚科技	13,100	165,715.00	0.15
304	603058	永吉股份	18,800	164,312.00	0.14
305	001338	永顺泰	13,700	163,304.00	0.14
306	603171	税友股份	3,800	163,058.00	0.14
307	603136	天目湖	12,100	162,987.00	0.14
308	600601	方正科技	30,300	161,802.00	0.14
309	301369	联动科技	3,000	161,130.00	0.14
310	301195	北路智控	4,500	161,100.00	0.14
311	300982	苏文电能	8,900	160,111.00	0.14
312	688327	云从科技	11,500	158,585.00	0.14
313	600230	沧州大化	15,000	157,950.00	0.14
314	600162	香江控股	96,800	157,784.00	0.14
315	603881	数据港	6,160	157,388.00	0.14
316	605198	安德利	3,900	157,209.00	0.14
317	300072	海新能科	44,400	156,732.00	0.14
318	688498	源杰科技	800	156,000.00	0.14
319	300286	安科瑞	6,900	155,733.00	0.14
320	301370	国科恒泰	14,600	155,490.00	0.14
321	002296	辉煌科技	13,900	154,985.00	0.14
322	605186	健麾信息	7,400	154,956.00	0.14
323	000631	顺发恒业	51,900	154,662.00	0.14
324	688343	云天励飞	3,100	153,202.00	0.13
325	601116	三江购物	14,000	152,460.00	0.13
326	002303	美盈森	42,800	152,368.00	0.13
327	002452	长高电新	21,900	152,205.00	0.13
328	002646	天佑德酒	16,400	152,192.00	0.13

329	600643	爱建集团	20,500	152,110.00	0.13
330	300435	中泰股份	10,000	151,800.00	0.13
331	002987	京北方	7,220	150,537.00	0.13
332	603039	泛微网络	2,700	150,390.00	0.13
333	002335	科华数据	3,500	149,380.00	0.13
334	600526	菲达环保	30,900	148,320.00	0.13
335	000931	中关村	27,300	148,239.00	0.13
336	002367	康力电梯	21,000	147,630.00	0.13
337	600446	金证股份	7,700	146,069.00	0.13
338	601595	上海电影	4,900	145,236.00	0.13
339	600433	冠豪高新	47,100	144,597.00	0.13
340	600877	电科芯片	11,400	144,552.00	0.13
341	002946	新乳业	7,700	144,529.00	0.13
342	001236	弘业期货	9,000	143,820.00	0.13
343	301078	孩子王	10,900	142,463.00	0.13
344	603105	芯能科技	17,300	142,206.00	0.12
345	300120	经纬辉开	14,100	141,423.00	0.12
346	300833	浩洋股份	4,200	140,406.00	0.12
347	002546	新联电子	25,500	139,995.00	0.12
348	603337	杰克股份	3,900	139,932.00	0.12
349	000950	重药控股	27,900	139,221.00	0.12
350	301061	匠心家居	1,790	138,796.60	0.12
351	600475	华光环能	13,300	138,586.00	0.12
352	600987	航民股份	19,500	137,865.00	0.12
353	300636	同和药业	17,900	137,472.00	0.12
354	002212	天融信	17,700	136,290.00	0.12
355	002545	东方铁塔	15,300	136,017.00	0.12
356	002544	普天科技	5,800	136,010.00	0.12
357	002441	众业达	14,900	135,143.00	0.12
358	000517	荣安地产	74,200	134,302.00	0.12
359	002746	仙坛股份	23,000	133,860.00	0.12
360	002698	博实股份	8,600	133,644.00	0.12
361	002338	奥普光电	2,800	132,440.00	0.12
362	688409	富创精密	2,400	132,024.00	0.12
363	600206	有研新材	6,900	131,859.00	0.12
364	688789	XD 宏华数	1,800	131,472.00	0.12
365	603997	继峰股份	10,000	130,400.00	0.11
366	605077	华康股份	8,000	129,440.00	0.11
367	600103	青山纸业	58,300	129,426.00	0.11
368	301200	大族数控	3,000	127,410.00	0.11
369	600195	中牧股份	17,300	126,809.00	0.11
370	002752	昇兴股份	22,600	125,882.00	0.11
371	600850	电科数字	5,200	125,788.00	0.11

372	688177	百奥泰	5,000	125,300.00	0.11
373	002314	南山控股	47,300	124,399.00	0.11
374	688798	艾为电子	1,800	122,760.00	0.11
375	301117	佳缘科技	5,400	122,310.00	0.11
376	600882	妙可蓝多	4,000	122,120.00	0.11
377	688123	聚辰股份	1,500	121,485.00	0.11
378	300463	迈克生物	10,200	121,380.00	0.11
379	000650	仁和药业	22,300	120,866.00	0.11
380	605333	沪光股份	4,400	120,780.00	0.11
381	000681	视觉中国	5,900	118,826.00	0.10
382	688700	东威科技	3,000	118,350.00	0.10
383	000411	英特集团	11,000	117,920.00	0.10
384	600186	莲花控股	19,100	114,600.00	0.10
385	600649	城投控股	26,500	113,685.00	0.10
386	301050	雷电微力	2,100	111,930.00	0.10
387	688300	联瑞新材	2,400	111,720.00	0.10
388	600750	江中药业	5,100	111,333.00	0.10
389	600285	羚锐制药	4,900	111,083.00	0.10
390	002036	联创电子	10,200	110,262.00	0.10
391	600114	东睦股份	5,400	109,836.00	0.10
392	603103	横店影视	6,800	109,140.00	0.10
393	003040	楚天龙	4,500	109,125.00	0.10
394	000718	苏宁环球	50,200	108,934.00	0.10
395	603530	神马电力	4,200	108,864.00	0.10
396	000795	英洛华	10,000	108,600.00	0.10
397	600577	精达股份	14,500	107,880.00	0.09
398	688185	康希诺	1,800	107,334.00	0.09
399	600035	楚天高速	25,100	106,424.00	0.09
400	002139	拓邦股份	7,700	106,337.00	0.09
401	688362	甬矽电子	3,500	104,230.00	0.09
402	300620	光库科技	2,200	103,642.00	0.09
403	000919	金陵药业	15,200	103,512.00	0.09
404	600330	天通股份	14,400	103,248.00	0.09
405	600594	益佰制药	26,600	102,410.00	0.09
406	688432	有研硅	9,250	102,120.00	0.09
407	002081	金螳螂	29,200	100,156.00	0.09
408	600266	城建发展	21,800	98,972.00	0.09
409	002108	沧州明珠	25,600	98,816.00	0.09
410	002479	富春环保	19,600	98,196.00	0.09
411	688127	蓝特光学	3,800	97,698.00	0.09
412	600452	涪陵电力	10,600	97,520.00	0.09
413	002911	佛燃能源	9,500	97,470.00	0.09
414	301171	易点天下	3,600	96,228.00	0.08

415	600776	东方通信	8,600	95,804.00	0.08
416	688686	奥普特	1,000	95,620.00	0.08
417	300745	欣锐科技	5,000	95,450.00	0.08
418	688083	中望软件	1,480	95,326.80	0.08
419	605599	菜百股份	5,800	94,830.00	0.08
420	300664	鹏鹞环保	17,200	94,256.00	0.08
421	603033	三维股份	8,400	94,164.00	0.08
422	002003	伟星股份	8,600	93,826.00	0.08
423	601126	四方股份	5,700	92,739.00	0.08
424	688190	云路股份	1,000	92,560.00	0.08
425	600248	陕建股份	24,200	92,202.00	0.08
426	000498	山东路桥	15,600	91,728.00	0.08
427	688351	微电生理	4,600	90,620.00	0.08
428	002550	千红制药	10,700	89,880.00	0.08
429	603113	金能科技	12,800	88,704.00	0.08
430	600993	马应龙	3,100	87,668.00	0.08
431	603220	中贝通信	4,000	85,880.00	0.08
432	002218	拓日新能	26,300	85,212.00	0.07
433	600961	株冶集团	7,600	84,968.00	0.07
434	603383	顶点软件	2,000	84,800.00	0.07
435	001287	中电港	4,600	84,226.00	0.07
436	600301	华锡有色	4,200	83,874.00	0.07
437	000680	山推股份	9,300	83,421.00	0.07
438	002375	亚厦股份	21,600	83,160.00	0.07
439	002063	远光软件	13,700	81,515.00	0.07
440	000058	深赛格	9,800	81,438.00	0.07
441	000969	安泰科技	6,300	81,144.00	0.07
442	000682	东方电子	7,900	80,896.00	0.07
443	603169	兰石重装	10,200	80,376.00	0.07
444	603327	福蓉科技	8,620	79,735.00	0.07
445	000829	天音控股	7,800	79,638.00	0.07
446	688523	航天环宇	3,700	79,587.00	0.07
447	600055	万东医疗	4,600	79,488.00	0.07
448	002416	爱施德	6,600	79,332.00	0.07
449	002093	国脉科技	6,700	79,261.00	0.07
450	002017	东信和平	4,300	79,249.00	0.07
451	002675	东诚药业	5,500	79,145.00	0.07
452	601882	海天精工	4,100	78,310.00	0.07
453	002637	赞宇科技	7,800	77,844.00	0.07
454	603355	莱克电气	3,400	76,228.00	0.07
455	002160	常铝股份	17,600	76,032.00	0.07
456	603533	掌阅科技	3,400	75,854.00	0.07
457	002626	金达威	3,700	75,702.00	0.07

458	301339	通行宝	4,400	75,372.00	0.07
459	002666	德联集团	14,700	74,823.00	0.07
460	600645	中源协和	3,200	74,240.00	0.07
461	001215	千味央厨	2,600	74,074.00	0.07
462	000555	神州信息	5,200	73,944.00	0.06
463	000837	秦川机床	6,100	73,322.00	0.06
464	600986	浙文互联	8,800	71,896.00	0.06
465	002245	蔚蓝锂芯	5,600	71,848.00	0.06
466	603889	新澳股份	12,300	71,340.00	0.06
467	000676	智度股份	7,700	70,224.00	0.06
468	002324	普利特	6,600	70,158.00	0.06
469	600869	远东股份	13,600	69,088.00	0.06
470	002967	广电计量	3,900	68,601.00	0.06
471	603301	振德医疗	3,200	67,552.00	0.06
472	000848	承德露露	7,200	65,736.00	0.06
473	000603	盛达资源	4,200	62,538.00	0.05
474	300123	亚光科技	8,600	62,092.00	0.05
475	002149	西部材料	3,100	61,535.00	0.05
476	002895	川恒股份	2,700	60,912.00	0.05
477	000059	华锦股份	11,300	60,907.00	0.05
478	600633	浙数文化	4,400	60,896.00	0.05
479	000810	创维数字	5,100	60,078.00	0.05
480	600552	凯盛科技	5,300	59,890.00	0.05
481	002011	盾安环境	5,100	59,160.00	0.05
482	002215	诺普信	5,700	58,881.00	0.05
483	600609	金杯汽车	11,100	58,719.00	0.05
484	002182	宝武镁业	4,700	57,528.00	0.05
485	603100	川仪股份	2,700	55,701.00	0.05
486	300527	中船应急	6,100	55,693.00	0.05
487	600510	黑牡丹	10,800	54,972.00	0.05
488	003039	顺控发展	4,000	54,240.00	0.05
489	301508	中机认检	1,600	54,080.00	0.05
490	603915	国茂股份	3,600	52,344.00	0.05
491	603283	赛腾股份	1,500	50,910.00	0.04
492	600320	振华重工	11,500	50,255.00	0.04
493	688222	成都先导	3,100	49,848.00	0.04
494	600780	通宝能源	8,300	49,219.00	0.04
495	000407	胜利股份	14,400	48,960.00	0.04
496	301381	赛维时代	2,400	47,880.00	0.04
497	601369	陕鼓动力	5,300	46,481.00	0.04
498	002859	洁美科技	2,300	45,793.00	0.04
499	601038	一拖股份	3,500	45,745.00	0.04
500	002758	浙农股份	5,100	45,543.00	0.04

501	000420	吉林化纤	11,400	44,460.00	0.04
502	002284	亚太股份	3,900	43,095.00	0.04
503	002020	京新药业	3,300	43,065.00	0.04
504	000990	诚志股份	5,500	41,580.00	0.04
505	601137	博威合金	2,300	40,917.00	0.04
506	000090	天健集团	10,700	37,878.00	0.03
507	002993	奥海科技	900	37,323.00	0.03
508	688609	九联科技	3,500	36,645.00	0.03
509	002947	恒铭达	1,100	36,509.00	0.03
510	603855	华荣股份	1,600	35,408.00	0.03
511	603197	保隆科技	900	35,163.00	0.03
512	603508	思维列控	1,300	34,424.00	0.03
513	002158	汉钟精机	1,900	33,022.00	0.03
514	002226	江南化工	4,700	27,260.00	0.02
515	300303	聚飞光电	4,000	25,360.00	0.02
516	002458	益生股份	3,000	24,510.00	0.02
517	000061	农产品	3,600	23,004.00	0.02
518	600572	康恩贝	5,200	22,776.00	0.02
519	300480	光力科技	1,200	19,080.00	0.02
520	600496	精工钢构	5,500	17,600.00	0.02
521	603227	雪峰科技	2,100	17,598.00	0.02
522	300962	中金辐照	800	14,184.00	0.01
523	002832	比音勒芬	800	12,840.00	0.01
524	301367	瑞迈特	140	11,774.00	0.01
525	301217	铜冠铜箔	900	11,259.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301602	超研股份	574	14,235.20	0.01
2	688545	兴福电子	464	12,504.80	0.01
3	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
4	001388	信通电子	687	11,280.54	0.01
5	301678	新恒汇	202	8,997.08	0.01
6	301479	弘景光电	112	8,721.44	0.01
7	603072	天和磁材	149	8,113.05	0.01
8	301275	汉朔科技	130	7,304.70	0.01
9	301665	泰禾股份	306	6,851.34	0.01
10	301658	首航新能	280	6,434.40	0.01
11	001382	新亚电缆	293	5,921.53	0.01
12	301173	毓恬冠佳	130	5,847.40	0.01
13	001356	富岭股份	404	5,833.76	0.01
14	301501	恒鑫生活	116	5,245.52	0.00

15	301595	太力科技	159	4,626.90	0.00
16	301590	优优绿能	30	4,184.40	0.00
17	301560	众捷汽车	143	3,925.35	0.00
18	301636	泽润新能	82	3,891.72	0.00
19	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
20	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
21	001390	古麒绒材	117	2,120.04	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	300226	上海钢联	1,420,289.00	0.97
2	603197	保隆科技	1,131,330.00	0.77
3	601068	中铝国际	998,363.00	0.68
4	603169	兰石重装	981,160.00	0.67
5	002970	锐明技术	922,489.00	0.63
6	600726	华电能源	910,299.00	0.62
7	603687	大胜达	851,348.00	0.58
8	603327	福蓉科技	831,013.90	0.57
9	688088	虹软科技	829,520.64	0.56
10	300872	天阳科技	811,801.00	0.55
11	300160	秀强股份	811,209.00	0.55
12	688222	成都先导	799,170.91	0.54
13	603888	新华网	787,253.00	0.54
14	301376	致欧科技	785,739.00	0.53
15	300379	*ST 东通	782,380.00	0.53
16	002925	盈趣科技	779,552.00	0.53
17	301195	北路智控	775,932.00	0.53
18	603386	骏亚科技	775,388.99	0.53
19	300456	赛微电子	749,136.00	0.51
20	002351	漫步者	743,481.00	0.51

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

### 7.4.2 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	603169	兰石重装	1,305,210.00	0.89
2	603558	健盛集团	1,268,847.00	0.86
3	002546	新联电子	1,260,773.00	0.86
4	603387	基蛋生物	1,175,099.00	0.80
5	002578	闽发铝业	1,142,175.00	0.78

6	603158	腾龙股份	1,137,076.00	0.77
7	603687	大胜达	1,131,007.00	0.77
8	603689	皖天然气	1,100,753.00	0.75
9	300226	上海钢联	1,071,493.00	0.73
10	002376	新北洋	1,069,230.00	0.73
11	301025	读客文化	1,057,998.00	0.72
12	603661	恒林股份	1,008,108.00	0.69
13	603966	法兰泰克	1,004,336.00	0.68
14	605098	行动教育	991,129.00	0.67
15	688510	航亚科技	986,577.88	0.67
16	300485	赛升药业	982,017.00	0.67
17	002724	海洋王	942,757.00	0.64
18	688222	成都先导	939,360.18	0.64
19	603197	保隆科技	928,535.00	0.63
20	002666	德联集团	912,039.00	0.62

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	317,011,840.78
卖出股票收入（成交）总额	365,078,379.68

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 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，深圳市洲明科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到大铲海事局的处罚。广东东箭汽车科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到佛山市住房公积金管理中心的处罚。

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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,223.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,223.51

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301602	超研股份	14,235.20	0.01	新股流通受限
2	688545	兴福电子	12,504.80	0.01	新股流通受限
3	301601	惠通科技	11,576.70	0.01	新股流通受限
4	001388	信通电子	11,280.54	0.01	新股未上市
5	301678	新恒汇	8,997.08	0.01	新股流通受限

### 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
中欧国证 2000 指数 增强 A	1,410	40,603.01	5,319,098.02	9.29%	51,931,150.19	90.71%
中欧国证 2000 指数 增强 C	1,321	30,858.32	0.00	0.00%	40,763,842.47	100.00%
合计	2,731	35,889.45	5,319,098.02	5.43%	92,694,992.66	94.57%

### 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	中欧国证 2000 指数增强 A	0.00	0.00%
	中欧国证 2000 指数增强 C	187.49	0.00%
	合计	187.49	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧国证 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

## § 9 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	34,159,590.53	28,502,726.60
减：本报告期基金 总赎回份额	49,971,516.31	58,516,552.62
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	57,250,248.21	40,763,842.47

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

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

### 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 (%)	
东北证券	3	341,673,450 .32	50.13	63,568.31	50.11	-
中信建投	3	339,858,915 .30	49.87	63,295.27	49.89	-

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(%)
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。

### 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
3	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
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告	中国证监会指定媒介	2025-06-09
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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20% 的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.zofund.com](http://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