

中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	58
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	58

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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金		
基金简称	中欧中证 A500 指数发起		
基金主代码	022432		
基金运作方式	契约型、开放式、发起式		
基金合同生效日	2024 年 11 月 4 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	924,420,899.39 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
下属分级基金的交 易代码	022432	022433	022898
报告期末下属分级 基金的份额总额	267,538,406.25 份	613,255,887.79 份	43,626,605.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（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。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中欧基金管理有限公司		中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	滕菲菲
	联系电话	021-68609600	4006800000
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700		95558
传真	021-50190017		010-85230024
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层		北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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		北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120		100020
法定代表人	窦玉明		方合英

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)		
	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
本期已实现收益	22,704,926.07	51,579,286.80	3,068,980.02
本期利润	44,337,692.74	101,406,623.72	5,777,978.38
加权平均基金份额本期利润	0.1541	0.1512	0.1604
本期加权平均净值利润	11.95%	11.77%	12.35%

率			
本期基金份额净值增长率	12.65%	12.52%	12.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	39,096,238.11	86,506,366.00	6,634,042.71
期末可供分配基金份额利润	0.1461	0.1411	0.1521
期末基金资产净值	369,777,426.25	844,112,079.68	60,588,559.08
期末基金份额净值	1.3821	1.3764	1.3888
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	38.21%	37.64%	39.45%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证 A500 指数发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.72%	1.33%	13.54%	1.34%	1.18%	-0.01%

过去六个月	12.65%	1.22%	11.34%	1.22%	1.31%	0.00%
过去一年	37.80%	1.09%	34.41%	1.09%	3.39%	0.00%
自基金合同生效起 至今	38.21%	1.04%	35.40%	1.08%	2.81%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧中证 A500 指数发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.65%	1.33%	13.54%	1.34%	1.11%	-0.01%
过去六个月	12.52%	1.22%	11.34%	1.22%	1.18%	0.00%
过去一年	37.45%	1.09%	34.41%	1.09%	3.04%	0.00%
自基金合同生效起 至今	37.64%	1.04%	35.40%	1.08%	2.24%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧中证 A500 指数发起 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.81%	1.33%	13.54%	1.34%	1.27%	-0.01%
过去六个月	12.83%	1.22%	11.34%	1.22%	1.49%	0.00%
过去一年	38.22%	1.09%	34.41%	1.09%	3.81%	0.00%
自基金份额起始运 作日至今	39.45%	1.06%	33.93%	1.06%	5.52%	0.00%

注：本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧中证A500指数发起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



中欧中证A500指数发起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



中欧中证A500指数发起Y累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额，图示日期为 2024 年 12 月 16 日至 2026 年 06 月 30 日。

§ 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 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		
宋巍巍	量化投委会委员 / 基金经理	2024-11-04	-	9 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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

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

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 9 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

2026 年上半年，A 股走出一条“倒 V 型开局、V 型反转收官”的完整曲线：一季度受海外实际利率上行冲击深度回调，二季度在地缘风险出清与国内制度供给的双轮驱动下强势修复，上半年整体呈现“先抑后扬、结构剧烈分化”的格局。理解上半年关键在于把握两个周期锚——外部的美国货币政策周期（实际利率）与内部的中国经济复苏周期（消费与地产的内生动能）——的节奏与矛盾。

上半年，全球产业周期在 A 股映射——半导体存储超级周期（供给刚性收缩驱动全链条涨价）、全球 AI 算力周期（海外云厂资本开支扩张带动硬件订单兑现）、国内 AI 产业化周期（国产算力进入商业化、科创板制度供给共振）；而与全球产业趋势关联度较弱的国内消费周期（红利低波、自

由现金流所锚定的高股息稳健资产）与汽车周期（电动化深化但价格战重启）则相对承压。这一“产业趋势主导、传统价值退潮”的分化格局，构成理解各产品上半年表现分化、并推演下半年走势的基本盘。

一季度，指数累计下跌 2.06%：1 月在美联储重启扩表、人民币汇率升值、中美经济周期错位的共振下强势上涨 4.52%，上证指数一度连收 17 根阳线突破 4000 点；杠杆资金大规模进场引发监管层主动降温，叠加 2 月初有色金属板块回调，但 2 月指数仍震荡上涨 1.14%——核心支撑来自国内经济基本面的强势复苏：M1 同比增速从 3.8% 跃升至 4.9%，社融增量 7.22 万亿元创历史同期新高，企业中长期贷款占比首次超过政府债券，PPI 同比降幅连续收窄，正式确认经济从“政策呵护弱复苏”转向内生驱动的复苏初期。3 月，地缘冲突推升油价、通胀预期反扑导致美联储宽松预期回落，实际利率重新上行，全球风险资产共振下跌，指数单月回调 7.35%——3 月的深度回调本质是 1 月大涨逻辑的镜像反转：实际利率方向逆转。

二季度，指数上涨 14.26%，市场经历“地缘风险出清→政策宽松落地→海外鹰派冲击”三阶段演绎。4 月大幅上涨 8.93%：4 月 7 日美伊达成临时停火协议，地缘风险溢价快速回吐，4 月 8 日 A 股全线放量长阳；4 月末政治局会议强调深入整治“内卷式”竞争、全面实施“人工智能+”行动，市场风险偏好进一步修复。5 月上涨 1.32%：5 月 7 日央行降准 0.5 个百分点、下调政策利率 0.1 个百分点的组合拳超预期落地，随后央行一季度货币政策执行报告删除“降准降息”表述，短期宽松预期降温，指数窄幅震荡。6 月上涨 3.52%，月内经历“先扬后抑再企稳”的 N 字走势：6 月 15 日美伊正式达成停火谅解备忘录，困扰全球市场近半年的中东地缘风险阶段性出清；随后美联储议息会议删除宽松前瞻指引、点阵图转鹰，6 月下旬科技板块遭遇季末集中兑现压力，月末市场逐步消化冲击、指数企稳。

在投资策略方面，本基金作为跟踪中证 A500 指数的场外指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 12.65%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；基金 C 类份额净值增长率为 12.52%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；基金 Y 类份额净值增长率为 12.83%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

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，从周期定位看，国内经济仍处于内生复苏的早中段：PPI 同比自转正以来延续上行、工业企业盈利修复趋势渐明，权益市场的驱动力正处在从“政策博弈”向“盈利驱动”过渡的

窗口。作为覆盖 A 股各行业的核心宽基，中证 A500 的走势与国内经济复苏周期的斜率高度相关，PPI 上行的持续性、工业企业盈利的兑现节奏是最直接的观测变量。外部方面，美国进入加息周期，随着地缘风险出清、油价中枢回落，加息的性质已从“被迫”转向“从容”，但实际利率维持高位仍是外部估值的约束项；后续需跟踪美国通胀与就业数据的边际变化对加息节奏的影响。全年来看，A 股定价始终处在“国内复苏强度”与“海外货币政策节奏”两个周期变量的相互作用中，其中国内基本面是更根本的主导力量。

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

本基金本报告期末进行利润分配，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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关

法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害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

本托管人认为，中欧基金管理有限公司在中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中欧基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,538,937.51	29,994,828.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,273,778,115.16	1,254,752,022.48
其中：股票投资		1,211,405,426.89	1,217,378,454.26
基金投资		-	-
债券投资		62,372,688.27	37,373,568.22
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		3,231,582.44	3,985,525.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,297,548,635.11	1,288,732,375.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		20,000,420.55	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,172,641.99	3,761,976.38
应付管理人报酬		498,988.38	535,044.08
应付托管费		99,797.64	107,008.79
应付销售服务费		169,819.81	136,850.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,695.13	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	127,206.60	65,640.00
负债合计		23,070,570.10	4,606,519.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	924,420,899.39	1,048,702,797.58
未分配利润	6.4.7.8	350,057,165.62	235,423,058.74
净资产合计		1,274,478,065.01	1,284,125,856.32
负债和净资产总计		1,297,548,635.11	1,288,732,375.88

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 924,420,899.39 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.3821 元，基金份额总额 267,538,406.25 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.3764 元，基金份额总额 613,255,887.79 份；下属 Y 类基金份额净值为人民币 1.3888 元，基金份额总额 43,626,605.35 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		156,503,332.43	33,556,396.84
1. 利息收入		11,791.37	45,068.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,791.37	45,068.30
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		82,256,925.66	17,421,836.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	70,980,138.04	-4,981,500.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	400,549.66	441,360.99
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-
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	10,876,237.96	21,961,976.36
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	74,169,101.95	16,039,454.95
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	65,513.45	50,036.89
减：二、营业总支出		4,981,037.59	7,499,786.24
1. 管理人报酬		3,114,309.06	4,769,011.31
2. 托管费		622,861.77	953,802.20
3. 销售服务费		1,068,325.31	1,677,232.83
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		76,655.76	-
其中：卖出回购金融资产 支出		76,655.76	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		625.54	-
8. 其他费用	6.4.7.18	98,260.15	99,739.90

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		151,522,294.84	26,056,610.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		151,522,294.84	26,056,610.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		151,522,294.84	26,056,610.60

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1,048,702,797.58	-	235,423,058.74	1,284,125,856.32
二、本期期初净资产	1,048,702,797.58	-	235,423,058.74	1,284,125,856.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-124,281,898.19	-	114,634,106.88	-9,647,791.31
（一）、综合收益总额	-	-	151,522,294.84	151,522,294.84
（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）	-124,281,898.19	-	-36,888,187.96	-161,170,086.15
其中：1. 基金申购款	295,901,494.03	-	84,642,622.81	380,544,116.84
2. 基金赎回款	-420,183,392.22	-	-121,530,810.77	-541,714,202.99
（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	924,420,899.39	-	350,057,165.62	1,274,478,065.01
项目	上年度可比期间 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	2,132,289,949.01	-	-25,552,417.64	2,106,737,531.37
二、本期期初净资产	2,132,289,949.01	-	-25,552,417.64	2,106,737,531.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-338,399,965.02	-	28,952,097.71	-309,447,867.31
(一)、综合收益总额	-	-	26,056,610.60	26,056,610.60
(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)	-338,399,965.02	-	2,895,487.11	-335,504,477.91
其中：1. 基金申购款	677,969,165.10	-	-7,948,056.67	670,021,108.43
2. 基金赎回款	-1,016,369,130.12	-	10,843,543.78	-1,005,525,586.34
(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	1,793,889,983.99	-	3,399,680.07	1,797,289,664.06

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

中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金（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[2024]1446 号文《关于准予中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证 A500 指数发起式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发起式基金，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 2,387,904,914.68 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70028871_B20 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 4 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 2,388,326,014.99 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 421,100.31 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 682,964,211.94 份，包含认购利息折合 112,441.47 份；C 类基金的基金份额总额为 1,705,361,803.05 份，包含认购利息折合 308,658.84 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 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‰；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；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。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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《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

本基金运作过程中如有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《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《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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	30,001.16
等于：本金	30,000.00
加：应计利息	1.16
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	20,508,936.35
等于：本金	20,507,877.93
加：应计利息	1,058.42
减：坏账准备	-
合计	20,538,937.51

注：其他存款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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		943,322,332.55	-	1,211,405,426.89	268,083,094.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	61,858,339.00	530,768.27	62,372,688.27	-16,419.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	61,858,339.00	530,768.27	62,372,688.27	-16,419.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,005,180,671.55	530,768.27	1,273,778,115.16	268,066,675.34

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 2026 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	29,752.78
其他应付	37,946.45
合计	127,206.60

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证 A500 指数发起 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	306,393,357.07	306,393,357.07
本期申购	86,021,411.26	86,021,411.26
本期赎回（以“-”号填列）	-124,876,362.08	-124,876,362.08
本期末	267,538,406.25	267,538,406.25

中欧中证 A500 指数发起 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	721,476,252.51	721,476,252.51
本期申购	178,371,882.20	178,371,882.20
本期赎回（以“-”号填列）	-286,592,246.92	-286,592,246.92
本期末	613,255,887.79	613,255,887.79

中欧中证 A500 指数发起 Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,833,188.00	20,833,188.00
本期申购	31,508,200.57	31,508,200.57
本期赎回（以“-”号填列）	-8,714,783.22	-8,714,783.22
本期末	43,626,605.35	43,626,605.35

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

中欧中证 A500 指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,192,726.15	49,312,974.06	69,505,700.21
本期期初	20,192,726.15	49,312,974.06	69,505,700.21
本期利润	22,704,926.07	21,632,766.67	44,337,692.74
本期基金份额交易产生的变动数	-3,801,414.11	-7,802,958.84	-11,604,372.95
其中：基金申购款	8,068,498.64	16,729,054.17	24,797,552.81
基金赎回款	-11,869,912.75	-24,532,013.01	-36,401,925.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,096,238.11	63,142,781.89	102,239,020.00

中欧中证 A500 指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,246,039.43	115,860,744.10	161,106,783.53
本期期初	45,246,039.43	115,860,744.10	161,106,783.53
本期利润	51,579,286.80	49,827,336.92	101,406,623.72
本期基金份额交易产生的变动数	-10,318,960.23	-21,338,255.13	-31,657,215.36
其中：基金申购款	16,105,571.82	34,608,446.99	50,714,018.81
基金赎回款	-26,424,532.05	-55,946,702.12	-82,371,234.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,506,366.00	144,349,825.89	230,856,191.89

中欧中证 A500 指数发起 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,449,139.40	3,361,435.60	4,810,575.00
本期期初	1,449,139.40	3,361,435.60	4,810,575.00
本期利润	3,068,980.02	2,708,998.36	5,777,978.38

本期基金份额交易产生的变动数	2,115,923.29	4,257,477.06	6,373,400.35
其中：基金申购款	3,077,903.24	6,053,147.95	9,131,051.19
基金赎回款	-961,979.95	-1,795,670.89	-2,757,650.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,634,042.71	10,327,911.02	16,961,953.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	150.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,640.95
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	11,791.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	320,520,681.61
减：卖出股票成本总额	249,258,710.37
减：交易费用	281,833.20
买卖股票差价收入	70,980,138.04

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	401,529.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-980.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	400,549.66

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,506,900.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,000,980.00
减：应计利息总额	506,900.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-980.00

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,876,237.96
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	10,876,237.96

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	74,169,101.95
股票投资	74,195,640.95
债券投资	-26,539.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
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	74,169,101.95

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	64,356.07
基金转换费收入	1,157.38
合计	65,513.45

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
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	98,260.15

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、关联关系

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
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,114,309.06	4,769,011.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,190,546.64	2,189,779.73
应支付基金管理人的净管理费	1,923,762.42	2,579,231.58

注：1、本基金 A 类基金份额的年管理费率为 0.5%，本基金 C 类基金份额的年管理费率为 0.5%，本基金 Y 类基金份额的年管理费率为 0.25%。三类基金份额的管理费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额年管理费率的} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金管理费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	622, 861. 77	953, 802. 20

注：本基金 A 类基金份额的年托管费率为 0.1%，本基金 C 类基金份额的年托管费率为 0.1%，本基金 Y 类基金份额的年托管费率为 0.05%。三类基金份额的托管费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额年托管费率}\div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金托管费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00	0.00
中欧财富	0.00	2, 125. 37	0.00	2, 125. 37
中欧基金	0.00	337, 519. 60	0.00	337, 519. 60
中信银行股份有限公司	0.00	600, 387. 59	0.00	600, 387. 59
合计	0.00	940, 032. 56	0.00	940, 032. 56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y	合计
国都证券	0.00	8. 99	0.00	8. 99
中欧财富	0.00	1, 412. 64	0.00	1, 412. 64
中欧基金	0.00	145, 312. 34	0.00	145, 312. 34
中信银行股份有限公司	0.00	1, 388, 794. 11	0.00	1, 388, 794. 11

合计	0.00	1,535,528.08	0.00	1,535,528.08
----	------	--------------	------	--------------

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 0.25%，本基金 Y 类基金份额不收取销售服务费。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

中欧中证 A500 指数发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.74%	1.95%

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。

3、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 C 类基金份额、Y 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

份额单位：份

中欧中证 A500 指数发起 Y

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	49,651.29	0.11%	—	—

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 A 类基金份额、C 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中信银行股份有限公司	30,001.16	150.42	10,223.88	478.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中信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（2026 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

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	40,780	412,285.80	412,285.80	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	17,476	176,682.36	176,682.36	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

		日								
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

	能	日								
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-

		日								
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,923	37,844.64	272,085.27	-

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	7,302	2,236,933.26	6,422,328.06	-

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 20,000,420.55 元，于 2026 年 7 月 6 日和 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

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 2026 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 2026 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	20,538,937.51	-	-	-	20,538,937.51
交易性金融资产	62,372,688.27	-	-	-1,211,405,426.89	1,273,778,115.16
应收申购款	-	-	-	3,231,582.44	3,231,582.44
资产总计	82,911,625.78	-	-	-1,214,637,009.33	1,297,548,635.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,172,641.99	2,172,641.99
应付管理人报酬	-	-	-	498,988.38	498,988.38
应付托管费	-	-	-	99,797.64	99,797.64
卖出回购金融资产款	20,000,420.55	-	-	-	20,000,420.55
应付销售服务费	-	-	-	169,819.81	169,819.81
应交税费	-	-	-	1,695.13	1,695.13
其他负债	-	-	-	127,206.60	127,206.60
负债总计	20,000,420.55	-	-	3,070,149.55	23,070,570.10
利率敏感度缺口	62,911,205.23	-	-	-1,211,566,859.78	1,274,478,065.01
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	29,994,828.34	-	-	-	29,994,828.34
交易性金融资产	37,373,568.22	-	-	-1,217,378,454.26	1,254,752,022.48
应收申购款	-	-	-	3,985,525.06	3,985,525.06
资产总计	67,368,396.56	-	-	-1,221,363,979.32	1,288,732,375.88
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,761,976.38	3,761,976.38
应付管理人报酬	-	-	-	535,044.08	535,044.08
应付托管费	-	-	-	107,008.79	107,008.79
应付销售服务费	-	-	-	136,850.31	136,850.31
其他负债	-	-	-	65,640.00	65,640.00
负债总计	-	-	-	4,606,519.56	4,606,519.56
利率敏感度缺口	67,368,396.56	-	-	-1,216,757,459.76	1,284,125,856.32

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 2026 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 4.89%（2025 年 12 月 31 日：2.91%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）

交易性金融资产—股票投资	1, 211, 405, 426. 89	95. 05	1, 217, 378, 454. 26	94. 80
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1, 211, 405, 426. 89	95. 05	1, 217, 378, 454. 26	94. 80

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	63, 510, 504. 37	64, 265, 071. 98
	业绩比较基准下降 5%	-63, 510, 504. 37	-64, 265, 071. 98

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1, 202, 239, 561. 98	1, 206, 033, 248. 35
第二层次	69, 383, 984. 49	45, 056, 869. 50

第三层次	2, 154, 568. 69	3, 661, 904. 63
合计	1, 273, 778, 115. 16	1, 254, 752, 022. 48

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 2026 年 8 月 27 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	1, 211, 405, 426. 89	93. 36
	其中：股票	1, 211, 405, 426. 89	93. 36
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	62, 372, 688. 27	4. 81
	其中：债券	62, 372, 688. 27	4. 81
	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	20, 538, 937. 51	1. 58
8	其他各项资产	3, 231, 582. 44	0. 25
9	合计	1, 297, 548, 635. 11	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	3,835,555.00	0.30
B	采矿业	49,760,291.00	3.90
C	制造业	853,978,873.64	67.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,434,065.00	2.07
E	建筑业	14,931,149.00	1.17
F	批发和零售业	9,403,426.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	26,937,738.00	2.11
H	住宿和餐饮业	577,353.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,615,201.90	5.31
J	金融业	117,077,115.00	9.19
K	房地产业	6,810,200.00	0.53
L	租赁和商务服务业	8,730,351.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	14,488,649.00	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,132,566.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	422,820.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,375,419.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	942,653.00	0.07
S	综合	2,190,158.00	0.17
	合计	1,208,643,583.54	94.83

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	42,019.42	0.00
C	制造业	2,126,080.01	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	589,683.66	0.05
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00

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	2,476.80	0.00
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	2,761,843.35	0.22

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	300308	中际旭创	40,800	51,816,000.00	4.07
2	300750	宁德时代	96,200	37,807,562.00	2.97
3	300502	新易盛	51,000	30,957,000.00	2.43
4	600519	贵州茅台	22,900	27,147,721.00	2.13
5	603986	兆易创新	24,400	19,886,000.00	1.56
6	601318	中国平安	387,900	18,518,346.00	1.45
7	688256	寒武纪	11,413	18,210,012.15	1.43
8	600036	招商银行	451,300	16,021,150.00	1.26
9	601899	紫金矿业	599,600	15,073,944.00	1.18
10	002371	北方华创	15,700	13,887,592.00	1.09
11	000333	美的集团	177,300	13,391,469.00	1.05
12	002475	立讯精密	186,000	13,094,400.00	1.03
13	688008	澜起科技	41,816	12,958,778.40	1.02
14	688012	中微公司	27,327	12,802,699.50	1.00
15	688041	海光信息	33,992	12,587,237.60	0.99
16	002384	东山精密	46,700	12,251,745.00	0.96
17	688981	中芯国际	74,501	11,832,248.82	0.93

18	600900	长江电力	446,000	11,805,620.00	0.93
19	000725	京东方 A	1,306,600	11,341,288.00	0.89
20	603259	药明康德	90,000	11,205,900.00	0.88
21	600030	中信证券	356,000	10,227,880.00	0.80
22	601166	兴业银行	617,100	10,219,176.00	0.80
23	300059	东方财富	461,800	9,411,484.00	0.74
24	600183	生益科技	53,300	9,242,220.00	0.73
25	600276	恒瑞医药	162,800	8,472,112.00	0.66
26	601398	工商银行	1,179,100	8,336,237.00	0.65
27	300274	阳光电源	52,100	8,284,942.00	0.65
28	300408	三环集团	49,100	8,194,790.00	0.64
29	600487	亨通光电	72,200	7,894,348.00	0.62
30	002594	比亚迪	99,000	7,890,300.00	0.62
31	300476	胜宏科技	22,200	7,690,746.00	0.60
32	601211	国泰海通	411,200	7,483,840.00	0.59
33	002463	沪电股份	48,700	7,441,360.00	0.58
34	300394	天孚通信	24,000	7,264,320.00	0.57
35	688498	源杰科技	3,641	6,866,926.00	0.54
36	688525	佰维存储	13,874	6,863,884.02	0.54
37	000988	华工科技	36,800	6,793,648.00	0.53
38	301308	江波龙	9,200	6,474,960.00	0.51
39	688072	拓荆科技	7,302	6,422,328.06	0.50
40	600176	中国巨石	87,800	6,398,864.00	0.50
41	601288	农业银行	1,045,100	6,343,757.00	0.50
42	601328	交通银行	971,000	6,243,530.00	0.49
43	000651	格力电器	163,100	6,116,250.00	0.48
44	600522	中天科技	99,900	6,061,932.00	0.48
45	603019	中科曙光	53,200	5,704,636.00	0.45
46	688521	芯原股份	15,057	5,588,254.98	0.44
47	603993	洛阳钼业	317,300	5,568,615.00	0.44
48	600150	中国船舶	164,600	5,561,834.00	0.44
49	600887	伊利股份	230,000	5,510,800.00	0.43
50	300604	长川科技	16,100	5,496,862.00	0.43
51	600584	长电科技	51,500	5,332,825.00	0.42
52	000338	潍柴动力	195,400	5,324,650.00	0.42
53	000858	五 粮 液	70,600	5,224,400.00	0.41
54	688347	华虹宏力	14,932	5,021,631.60	0.39
55	601816	京沪高铁	1,067,000	4,833,510.00	0.38
56	600309	万华化学	68,400	4,679,244.00	0.37
57	300124	汇川技术	69,400	4,603,302.00	0.36
58	002415	海康威视	133,200	4,555,440.00	0.36
59	002916	深南电路	9,900	4,533,210.00	0.36
60	002281	光迅科技	17,600	4,522,144.00	0.35

61	002008	大族激光	30,100	4,518,311.00	0.35
62	688120	华海清科	13,957	4,496,666.26	0.35
63	000100	TCL 科技	756,600	4,403,412.00	0.35
64	600111	北方稀土	91,500	4,396,575.00	0.34
65	000063	中兴通讯	118,200	4,277,658.00	0.34
66	300857	协创数据	12,500	4,248,750.00	0.33
67	600000	浦发银行	487,900	4,200,819.00	0.33
68	600089	特变电工	184,500	4,151,250.00	0.33
69	300136	信维通信	34,700	4,137,975.00	0.32
70	601857	中国石油	474,200	4,116,056.00	0.32
71	601088	中国神华	100,500	3,923,520.00	0.31
72	002028	思源电气	22,200	3,840,600.00	0.30
73	300433	蓝思科技	70,200	3,766,932.00	0.30
74	600031	三一重工	217,300	3,754,944.00	0.29
75	300014	亿纬锂能	55,600	3,615,668.00	0.28
76	002050	三花智控	82,100	3,598,443.00	0.28
77	601601	中国太保	125,200	3,570,704.00	0.28
78	300475	香农芯创	11,900	3,570,000.00	0.28
79	000001	平安银行	353,900	3,556,695.00	0.28
80	000792	盐湖股份	116,100	3,505,059.00	0.28
81	002714	牧原股份	99,900	3,495,501.00	0.27
82	002156	通富微电	44,300	3,361,041.00	0.26
83	600406	国电南瑞	146,200	3,340,670.00	0.26
84	002353	杰瑞股份	21,900	3,339,750.00	0.26
85	300223	北京君正	13,400	3,335,260.00	0.26
86	600549	厦门钨业	38,900	3,314,280.00	0.26
87	601668	中国建筑	752,800	3,267,152.00	0.26
88	000657	中钨高新	32,500	3,110,900.00	0.24
89	002602	世纪华通	216,200	3,048,420.00	0.24
90	601919	中远海控	229,500	3,043,170.00	0.24
91	300760	迈瑞医疗	22,200	3,015,426.00	0.24
92	601988	中国银行	523,200	2,992,704.00	0.23
93	300054	鼎龙股份	27,900	2,956,563.00	0.23
94	600660	福耀玻璃	58,600	2,955,784.00	0.23
95	601728	中国电信	566,900	2,942,211.00	0.23
96	002436	兴森科技	57,700	2,939,815.00	0.23
97	603501	豪威集团	30,800	2,921,380.00	0.23
98	601012	隆基绿能	220,600	2,894,272.00	0.23
99	601225	陕西煤业	142,100	2,891,735.00	0.23
100	002230	科大讯飞	70,000	2,858,800.00	0.22
101	600941	中国移动	33,000	2,842,290.00	0.22
102	600690	海尔智家	136,700	2,790,047.00	0.22
103	002352	顺丰控股	87,900	2,747,754.00	0.22

104	002460	赣锋锂业	41,600	2,720,640.00	0.21
105	688777	中控技术	23,140	2,718,950.00	0.21
106	601985	中国核电	299,000	2,699,970.00	0.21
107	603799	华友钴业	55,500	2,678,430.00	0.21
108	002938	鹏鼎控股	25,100	2,645,038.00	0.21
109	300033	同花顺	10,900	2,626,900.00	0.21
110	600160	巨化股份	49,400	2,618,694.00	0.21
111	000977	浪潮信息	37,400	2,618,000.00	0.21
112	002709	天赐材料	50,000	2,571,500.00	0.20
113	300442	润泽科技	30,000	2,492,100.00	0.20
114	300757	罗博特科	4,000	2,476,000.00	0.19
115	000425	徐工机械	298,300	2,413,247.00	0.19
116	000938	紫光股份	83,100	2,398,266.00	0.19
117	688126	沪硅产业	60,092	2,397,069.88	0.19
118	002851	麦格米特	14,300	2,390,674.00	0.19
119	601600	中国铝业	290,600	2,388,732.00	0.19
120	002202	金风科技	99,900	2,387,610.00	0.19
121	600028	中国石化	531,900	2,372,274.00	0.19
122	600938	中国海油	87,000	2,362,050.00	0.19
123	002466	天齐锂业	38,000	2,330,160.00	0.18
124	600460	士兰微	42,400	2,317,584.00	0.18
125	300346	南大光电	25,000	2,316,250.00	0.18
126	601766	中国中车	443,100	2,304,120.00	0.18
127	300567	精测电子	7,200	2,286,720.00	0.18
128	600050	中国联通	570,300	2,281,200.00	0.18
129	002600	领益智造	130,400	2,261,136.00	0.18
130	002080	中材科技	24,600	2,214,000.00	0.17
131	002049	紫光国微	24,600	2,183,250.00	0.17
132	002837	英维克	27,300	2,171,988.00	0.17
133	002138	顺络电子	29,700	2,171,070.00	0.17
134	300661	圣邦股份	15,100	2,166,548.00	0.17
135	002407	多氟多	42,700	2,144,821.00	0.17
136	601628	中国人寿	60,500	2,138,675.00	0.17
137	002179	中航光电	46,200	2,134,440.00	0.17
138	002185	华天科技	94,700	2,112,757.00	0.17
139	688002	睿创微纳	13,655	2,112,291.95	0.17
140	601100	恒立液压	19,500	2,097,420.00	0.16
141	000568	泸州老窖	26,800	2,077,536.00	0.16
142	600879	航天电子	95,900	2,041,711.00	0.16
143	002241	歌尔股份	90,500	2,038,965.00	0.16
144	300395	菲利华	15,200	2,032,696.00	0.16
145	603288	海天味业	60,900	2,019,444.00	0.16
146	601006	大秦铁路	433,500	1,998,435.00	0.16

147	000408	藏格矿业	28,800	1,996,416.00	0.16
148	601872	招商轮船	113,300	1,990,681.00	0.16
149	300390	天华新能	21,200	1,982,412.00	0.16
150	601658	邮储银行	401,600	1,979,888.00	0.16
151	605117	德业股份	18,600	1,974,948.00	0.15
152	688017	绿的谐波	4,711	1,968,538.46	0.15
153	600905	三峡能源	522,300	1,937,733.00	0.15
154	688469	芯联集成	181,895	1,929,905.95	0.15
155	601888	中国中免	35,600	1,912,076.00	0.15
156	600489	中金黄金	105,700	1,907,885.00	0.15
157	002625	光启技术	62,600	1,898,032.00	0.15
158	000630	铜陵有色	293,800	1,868,568.00	0.15
159	600673	东阳光	54,900	1,843,542.00	0.14
160	688396	华润微	18,882	1,841,939.10	0.14
161	601127	赛力斯	29,900	1,831,375.00	0.14
162	600010	包钢股份	819,600	1,827,708.00	0.14
163	600893	航发动力	47,600	1,824,984.00	0.14
164	688271	联影医疗	17,996	1,821,735.08	0.14
165	688111	金山办公	8,470	1,804,533.50	0.14
166	600118	中国卫星	21,900	1,796,895.00	0.14
167	300058	蓝色光标	130,500	1,795,680.00	0.14
168	002027	分众传媒	368,800	1,784,992.00	0.14
169	601689	拓普集团	31,600	1,782,872.00	0.14
170	002273	水晶光电	50,100	1,777,548.00	0.14
171	000426	兴业银锡	52,700	1,736,992.00	0.14
172	300037	新宙邦	18,700	1,736,295.00	0.14
173	600019	宝钢股份	318,200	1,727,826.00	0.14
174	300751	迈为股份	6,000	1,694,760.00	0.13
175	600760	中航沈飞	41,200	1,693,320.00	0.13
176	000807	云铝股份	76,200	1,687,068.00	0.13
177	601168	西部矿业	61,000	1,655,540.00	0.13
178	600989	宝丰能源	81,200	1,650,796.00	0.13
179	600362	江西铜业	38,100	1,649,730.00	0.13
180	601727	上海电气	234,000	1,638,000.00	0.13
181	600104	上汽集团	167,100	1,630,896.00	0.13
182	600988	赤峰黄金	61,100	1,608,152.00	0.13
183	002001	新 和 成	56,400	1,602,888.00	0.13
184	600875	东方电气	55,400	1,593,858.00	0.13
185	600667	太极实业	54,100	1,578,638.00	0.12
186	002738	中矿资源	26,700	1,575,033.00	0.12
187	002422	科伦药业	40,600	1,563,912.00	0.12
188	601390	中国中铁	372,500	1,553,325.00	0.12
189	000960	锡业股份	36,300	1,549,647.00	0.12

190	605589	圣泉集团	24,300	1,544,751.00	0.12
191	000538	云南白药	32,600	1,544,262.00	0.12
192	600885	宏发股份	44,600	1,538,254.00	0.12
193	002126	银轮股份	30,800	1,533,840.00	0.12
194	688099	晶晨股份	14,873	1,530,431.70	0.12
195	600547	山东黄金	65,700	1,517,013.00	0.12
196	600795	国电电力	324,500	1,515,415.00	0.12
197	600585	海螺水泥	89,100	1,510,245.00	0.12
198	601669	中国电建	321,000	1,508,700.00	0.12
199	600392	盛和资源	50,400	1,500,408.00	0.12
200	000831	中国稀土	26,900	1,492,681.00	0.12
201	600418	江淮汽车	57,100	1,474,893.00	0.12
202	300450	先导智能	35,600	1,449,632.00	0.11
203	002129	TCL 中环	120,600	1,449,612.00	0.11
204	002648	卫星化学	61,200	1,437,588.00	0.11
205	300316	晶盛机电	23,800	1,437,520.00	0.11
206	600096	云天化	46,600	1,416,640.00	0.11
207	002812	恩捷股份	21,100	1,411,801.00	0.11
208	300015	爱尔眼科	169,500	1,400,070.00	0.11
209	600141	兴发集团	29,800	1,399,706.00	0.11
210	300782	卓胜微	12,700	1,391,666.00	0.11
211	601179	中国西电	93,200	1,390,544.00	0.11
212	601868	中国能建	520,300	1,389,201.00	0.11
213	301358	湖南裕能	18,000	1,365,660.00	0.11
214	600346	恒力石化	77,100	1,365,441.00	0.11
215	600497	驰宏锌锗	112,300	1,359,953.00	0.11
216	000066	中国长城	71,300	1,358,265.00	0.11
217	002558	巨人网络	49,100	1,353,196.00	0.11
218	600482	中国动力	41,200	1,351,360.00	0.11
219	002195	岩山科技	204,800	1,339,392.00	0.11
220	300418	昆仑万维	32,600	1,315,736.00	0.10
221	600580	卧龙电驱	39,600	1,310,760.00	0.10
222	600066	宇通客车	48,700	1,305,647.00	0.10
223	600157	永泰能源	809,300	1,302,973.00	0.10
224	000625	长安汽车	180,700	1,295,619.00	0.10
225	600426	华鲁恒升	54,000	1,291,680.00	0.10
226	000157	中联重科	183,900	1,281,783.00	0.10
227	002532	天山铝业	118,200	1,268,286.00	0.10
228	600221	海航控股	939,000	1,267,650.00	0.10
229	600711	盛屯矿业	114,900	1,260,453.00	0.10
230	600895	张江高科	33,700	1,255,325.00	0.10
231	688036	传音控股	21,053	1,241,074.35	0.10
232	002340	格林美	187,400	1,238,714.00	0.10

233	600143	金发科技	79,400	1,226,730.00	0.10
234	605499	东鹏饮料	9,900	1,221,957.00	0.10
235	000933	神火股份	57,400	1,216,880.00	0.10
236	600011	华能国际	160,200	1,215,918.00	0.10
237	600438	通威股份	100,400	1,215,844.00	0.10
238	300803	指南针	13,200	1,210,044.00	0.09
239	600048	保利发展	261,200	1,209,356.00	0.09
240	002493	荣盛石化	112,200	1,206,150.00	0.09
241	300017	网宿科技	92,500	1,203,425.00	0.09
242	600886	国投电力	90,000	1,197,900.00	0.09
243	002236	大华股份	72,600	1,197,174.00	0.09
244	600570	恒生电子	56,400	1,195,116.00	0.09
245	600436	片仔癀	10,900	1,191,152.00	0.09
246	002131	利欧股份	249,500	1,185,125.00	0.09
247	600352	浙江龙盛	97,300	1,178,303.00	0.09
248	600115	中国东航	309,000	1,177,290.00	0.09
249	002821	凯莱英	7,200	1,166,400.00	0.09
250	688047	龙芯中科	7,482	1,157,240.94	0.09
251	300339	润和软件	29,500	1,136,045.00	0.09
252	002456	欧菲光	119,800	1,133,308.00	0.09
253	688213	思特威	10,551	1,129,695.57	0.09
254	601360	三六零	129,900	1,128,831.00	0.09
255	601233	桐昆股份	52,100	1,127,965.00	0.09
256	000301	东方盛虹	98,400	1,126,680.00	0.09
257	603659	璞泰来	38,700	1,119,591.00	0.09
258	003816	中国广核	285,600	1,116,696.00	0.09
259	601058	赛轮轮胎	95,700	1,103,421.00	0.09
260	688578	艾力斯	10,072	1,099,862.40	0.09
261	600026	中远海能	61,300	1,099,722.00	0.09
262	300759	康龙化成	37,700	1,090,661.00	0.09
263	688235	百济神州	4,212	1,072,417.32	0.08
264	002074	国轩高科	38,700	1,064,637.00	0.08
265	002555	三七互娱	56,100	1,058,607.00	0.08
266	002472	双环传动	25,400	1,054,354.00	0.08
267	600009	上海机场	45,200	1,044,120.00	0.08
268	688122	西部超导	16,623	1,044,090.63	0.08
269	600196	复星医药	46,400	1,042,608.00	0.08
270	000768	中航西飞	50,800	1,040,384.00	0.08
271	002517	恺英网络	63,900	1,038,375.00	0.08
272	300438	鹏辉能源	12,500	1,035,625.00	0.08
273	601111	中国国航	170,200	1,029,710.00	0.08
274	600674	川投能源	72,500	1,027,325.00	0.08
275	000975	山金国际	60,300	1,025,100.00	0.08

276	601186	中国铁建	172,100	1,023,995.00	0.08
277	002595	豪迈科技	21,700	1,011,220.00	0.08
278	600029	南方航空	195,100	1,010,618.00	0.08
279	300207	欣旺达	53,100	1,008,369.00	0.08
280	300001	特锐德	26,600	1,006,278.00	0.08
281	300458	全志科技	25,500	1,006,230.00	0.08
282	600415	小商品城	98,700	1,002,792.00	0.08
283	600219	南山铝业	251,000	1,001,490.00	0.08
284	601877	正泰电器	39,900	1,000,293.00	0.08
285	603129	春风动力	3,900	997,620.00	0.08
286	002601	龙佰集团	60,400	995,392.00	0.08
287	002128	电投能源	43,000	994,160.00	0.08
288	600233	圆通速递	62,200	979,650.00	0.08
289	601117	中国化学	133,100	978,285.00	0.08
290	600372	中航机载	89,800	974,330.00	0.08
291	300115	长盈精密	34,800	972,312.00	0.08
292	301236	软通动力	22,400	950,880.00	0.07
293	600839	四川长虹	134,600	939,508.00	0.07
294	002155	湖南黄金	39,300	938,091.00	0.07
295	002465	海格通信	73,400	937,318.00	0.07
296	000963	华东医药	33,200	933,584.00	0.07
297	300347	泰格医药	19,300	926,400.00	0.07
298	600741	华域汽车	59,400	921,888.00	0.07
299	688506	百利天恒	3,100	911,493.00	0.07
300	000547	航天发展	47,500	909,625.00	0.07
301	002920	德赛西威	11,100	904,650.00	0.07
302	300454	深信服	9,400	904,280.00	0.07
303	300012	华测检测	64,000	887,040.00	0.07
304	300568	星源材质	47,000	879,840.00	0.07
305	002130	沃尔核材	46,000	872,160.00	0.07
306	603650	彤程新材	8,900	872,022.00	0.07
307	000878	云南铜业	54,800	870,224.00	0.07
308	002497	雅化集团	42,700	869,799.00	0.07
309	300024	机器人	44,300	856,319.00	0.07
310	300496	中科创达	13,700	846,523.00	0.07
311	300866	安克创新	8,100	846,450.00	0.07
312	688331	荣昌生物	6,479	843,954.54	0.07
313	001979	招商蛇口	131,200	843,616.00	0.07
314	002444	巨星科技	27,100	842,810.00	0.07
315	300474	景嘉微	13,600	822,528.00	0.06
316	002271	东方雨虹	69,200	821,404.00	0.06
317	002414	高德红外	61,800	819,468.00	0.06
318	300083	创世纪	59,800	814,476.00	0.06

319	000661	长春高新	12,200	812,520.00	0.06
320	601021	春秋航空	17,800	811,324.00	0.06
321	603979	金诚信	13,700	808,711.00	0.06
322	002432	九安医疗	11,400	805,752.00	0.06
323	688266	泽璟制药	6,859	800,170.94	0.06
324	688676	金盘科技	9,451	799,932.64	0.06
325	002078	太阳纸业	63,600	794,364.00	0.06
326	000034	神州数码	28,600	793,650.00	0.06
327	601319	中国人保	115,600	781,456.00	0.06
328	601677	明泰铝业	46,800	776,880.00	0.06
329	603606	东方电缆	18,600	772,086.00	0.06
330	603087	甘李药业	13,600	771,936.00	0.06
331	300142	沃森生物	59,400	771,606.00	0.06
332	600699	均胜电子	35,700	771,477.00	0.06
333	000423	东阿阿胶	17,000	771,120.00	0.06
334	002756	永兴材料	13,600	770,304.00	0.06
335	601800	中国交建	133,900	764,569.00	0.06
336	002252	上海莱士	175,800	762,972.00	0.06
337	601615	明阳智能	65,800	761,306.00	0.06
338	600039	四川路桥	96,900	757,758.00	0.06
339	002025	航天电器	9,900	754,578.00	0.06
340	688169	石头科技	7,900	750,263.00	0.06
341	300763	锦浪科技	8,300	749,905.00	0.06
342	300748	金力永磁	24,200	746,570.00	0.06
343	300432	富临精工	37,000	743,330.00	0.06
344	000733	振华科技	13,100	741,984.00	0.06
345	300073	当升科技	15,400	739,816.00	0.06
346	300919	中伟新材	16,900	739,375.00	0.06
347	000002	万科 A	246,000	728,160.00	0.06
348	688599	天合光能	51,145	722,167.40	0.06
349	300724	捷佳伟创	10,200	720,120.00	0.06
350	688608	恒玄科技	4,300	718,917.00	0.06
351	600588	用友网络	77,900	715,122.00	0.06
352	688223	晶科能源	149,374	709,526.50	0.06
353	601633	长城汽车	46,800	706,212.00	0.06
354	600226	亨通股份	73,300	702,947.00	0.06
355	002064	华峰化学	73,900	701,311.00	0.06
356	688180	君实生物	20,553	695,102.46	0.05
357	000786	北新建材	38,400	694,656.00	0.05
358	002294	信立泰	21,500	685,635.00	0.05
359	002831	裕同科技	19,100	679,196.00	0.05
360	001965	招商公路	73,500	673,260.00	0.05
361	688065	凯赛生物	13,785	659,612.25	0.05

362	688188	柏楚电子	6,160	657,272.00	0.05
363	688390	固德威	6,045	655,942.95	0.05
364	601618	中国中冶	266,500	650,260.00	0.05
365	300677	英科医疗	16,600	650,222.00	0.05
366	600177	雅戈尔	86,100	648,333.00	0.05
367	601607	上海医药	42,000	646,800.00	0.05
368	600516	方大炭素	104,600	645,382.00	0.05
369	000519	中兵红箭	30,500	642,635.00	0.05
370	300972	万辰集团	3,700	641,617.00	0.05
371	302132	中航成飞	10,900	635,688.00	0.05
372	002085	万丰奥威	56,700	628,803.00	0.05
373	000617	中油资本	95,000	626,050.00	0.05
374	000623	吉林敖东	35,200	624,096.00	0.05
375	300832	新产业	14,800	621,600.00	0.05
376	002176	江特电机	61,500	615,615.00	0.05
377	603806	福斯特	36,600	614,514.00	0.05
378	300699	光威复材	21,300	610,245.00	0.05
379	002318	久立特材	25,400	607,060.00	0.05
380	300251	光线传媒	54,300	602,187.00	0.05
381	300558	贝达药业	9,200	598,644.00	0.05
382	002459	晶澳科技	73,900	598,590.00	0.05
383	605090	九丰能源	16,000	594,720.00	0.05
384	600085	同仁堂	25,700	593,927.00	0.05
385	002065	东华软件	82,700	590,478.00	0.05
386	002266	浙富控股	115,700	585,442.00	0.05
387	301550	斯菱智驱	6,400	585,152.00	0.05
388	002223	鱼跃医疗	22,800	585,048.00	0.05
389	600499	科达制造	42,200	582,360.00	0.05
390	603260	合盛硅业	12,000	579,120.00	0.05
391	002044	美年健康	115,100	578,953.00	0.05
392	000032	深桑达 A	23,200	578,840.00	0.05
393	603596	伯特利	23,300	578,772.00	0.05
394	300342	天银机电	12,300	578,100.00	0.05
395	600515	海南机场	210,900	577,866.00	0.05
396	688472	阿特斯	52,922	572,616.04	0.04
397	000039	中集集团	70,500	571,755.00	0.04
398	300003	乐普医疗	48,200	571,170.00	0.04
399	600521	华海药业	39,600	570,240.00	0.04
400	002405	四维图新	87,900	568,713.00	0.04
401	000400	许继电气	26,200	568,540.00	0.04
402	600862	中航高科	31,400	566,142.00	0.04
403	601216	君正集团	126,700	565,082.00	0.04
404	000999	华润三九	25,000	562,250.00	0.04

405	600803	新奥股份	35,500	560,900.00	0.04
406	688617	惠泰医疗	3,084	559,931.04	0.04
407	300409	道氏技术	28,000	558,040.00	0.04
408	600704	物产中大	117,400	554,128.00	0.04
409	000683	博源化工	96,000	552,960.00	0.04
410	000415	渤海租赁	133,600	543,752.00	0.04
411	600018	上港集团	114,800	541,856.00	0.04
412	688005	容百科技	17,650	540,090.00	0.04
413	600312	平高电气	30,300	535,098.00	0.04
414	603605	珀莱雅	8,900	533,288.00	0.04
415	600332	白云山	26,500	531,060.00	0.04
416	603766	隆鑫通用	44,300	528,499.00	0.04
417	600765	中航重机	40,900	528,428.00	0.04
418	000887	中鼎股份	29,300	524,177.00	0.04
419	000967	盈峰环境	49,300	519,129.00	0.04
420	000830	鲁西化工	43,200	518,400.00	0.04
421	600166	福田汽车	178,100	518,271.00	0.04
422	600323	瀚蓝环境	18,800	516,248.00	0.04
423	300122	智飞生物	44,000	514,360.00	0.04
424	002410	广联达	63,000	514,080.00	0.04
425	688116	天奈科技	13,265	506,723.00	0.04
426	600153	建发股份	63,800	505,934.00	0.04
427	002007	华兰生物	41,300	503,447.00	0.04
428	300896	爱美客	5,700	497,040.00	0.04
429	688114	华大智造	9,519	486,230.52	0.04
430	601799	星宇股份	5,300	480,286.00	0.04
431	603568	伟明环保	31,000	476,780.00	0.04
432	600398	海澜之家	90,300	472,269.00	0.04
433	002603	以岭药业	31,400	471,000.00	0.04
434	600486	扬农化工	9,100	461,370.00	0.04
435	601018	宁波港	146,000	459,900.00	0.04
436	601000	唐山港	110,800	459,820.00	0.04
437	002389	航天彩虹	25,500	453,135.00	0.04
438	688009	中国通号	94,886	451,657.36	0.04
439	600529	山东药玻	24,400	450,180.00	0.04
440	600316	洪都航空	16,100	449,834.00	0.04
441	600008	首创环保	165,100	449,072.00	0.04
442	600170	上海建工	201,800	447,996.00	0.04
443	000738	航发控制	24,400	446,276.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	127,600	442,772.00	0.03
445	600998	九州通	94,300	442,267.00	0.03
446	603486	科沃斯	8,600	436,450.00	0.03
447	600820	隧道股份	83,000	432,430.00	0.03

448	603885	吉祥航空	41,600	428,064.00	0.03
449	600161	天坛生物	36,900	427,302.00	0.03
450	600208	衢州发展	150,100	424,783.00	0.03
451	002607	中公教育	234,900	422,820.00	0.03
452	603939	益丰药房	23,400	420,732.00	0.03
453	601238	广汽集团	82,800	420,624.00	0.03
454	603816	顾家家居	18,700	418,132.00	0.03
455	688303	大全能源	23,519	409,936.17	0.03
456	688166	博瑞医药	11,645	407,691.45	0.03
457	300118	东方日升	32,600	405,870.00	0.03
458	600763	通策医疗	11,700	396,396.00	0.03
459	300573	兴齐眼药	9,700	395,372.00	0.03
460	601567	三星电气	26,300	392,922.00	0.03
461	300049	福瑞医科	10,100	392,688.00	0.03
462	600038	中直股份	15,400	389,466.00	0.03
463	601880	辽港股份	279,100	385,158.00	0.03
464	603392	万泰生物	14,100	380,277.00	0.03
465	300676	华大基因	10,800	378,648.00	0.03
466	600535	天士力	28,400	375,732.00	0.03
467	002244	滨江集团	49,000	372,400.00	0.03
468	600511	国药股份	14,100	367,164.00	0.03
469	300100	双林股份	12,800	355,584.00	0.03
470	601155	新城控股	34,500	353,970.00	0.03
471	600816	建元信托	143,900	351,116.00	0.03
472	000833	粤桂股份	14,800	346,616.00	0.03
473	002120	韵达股份	54,400	345,984.00	0.03
474	300144	宋城演艺	58,600	340,466.00	0.03
475	000998	隆平高科	45,100	340,054.00	0.03
476	601866	中远海发	147,600	326,196.00	0.03
477	600064	南京高科	45,700	325,841.00	0.03
478	688063	派能科技	6,078	323,775.06	0.03
479	002544	普天科技	17,100	311,562.00	0.02
480	600754	锦江酒店	17,100	307,629.00	0.02
481	600635	大众公用	71,700	306,876.00	0.02
482	600655	豫园股份	72,500	297,975.00	0.02
483	300457	赢合科技	14,000	295,120.00	0.02
484	000035	中国天楹	60,100	290,283.00	0.02
485	603899	晨光股份	13,900	286,757.00	0.02
486	600004	白云机场	39,100	283,866.00	0.02
487	300601	康泰生物	24,700	280,098.00	0.02
488	600663	陆家嘴	44,600	280,088.00	0.02
489	600859	王府井	29,700	272,646.00	0.02
490	600258	首旅酒店	24,700	269,724.00	0.02

491	300070	碧水源	82,700	263,813.00	0.02
492	002091	江苏国泰	34,100	246,543.00	0.02
493	000069	华侨城 A	149,100	244,524.00	0.02
494	600864	哈投股份	45,600	236,664.00	0.02
495	002292	奥飞娱乐	33,600	220,416.00	0.02
496	301078	孩子王	32,000	216,320.00	0.02
497	603833	欧派家居	6,900	207,759.00	0.02
498	002891	中宠股份	7,400	197,728.00	0.02
499	600325	华发股份	84,100	194,271.00	0.02
500	002572	索菲亚	21,400	156,220.00	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	001248	华润新能源	58,256	588,968.16	0.05
2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
3	688820	盛合晶微	1,923	272,085.27	0.02
4	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
5	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
6	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
7	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
8	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
9	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
10	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
11	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
12	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
13	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
14	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
15	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
16	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
17	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
18	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
19	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
20	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
21	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
22	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
23	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
24	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
25	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
26	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
27	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
28	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
29	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
30	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00

31	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
32	001280	中国铀业	88	5,869.60	0.00
33	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
34	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
35	301449	天溯计量	64	2,476.80	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
38	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
39	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
40	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
41	600930	华电新能	150	715.50	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	688498	源杰科技	5,320,022.89	0.41
2	300750	宁德时代	5,147,223.00	0.40
3	301308	江波龙	4,784,765.00	0.37
4	688525	佰维存储	4,385,433.42	0.34
5	601899	紫金矿业	4,062,237.00	0.32
6	688347	华虹宏力	3,370,330.84	0.26
7	300502	新易盛	3,361,967.00	0.26
8	002602	世纪华通	3,341,443.00	0.26
9	688256	寒武纪	3,060,607.85	0.24
10	300308	中际旭创	2,904,594.00	0.23
11	600519	贵州茅台	2,848,833.00	0.22
12	300857	协创数据	2,813,224.00	0.22
13	000657	中钨高新	2,457,343.00	0.19
14	300475	香农芯创	2,146,674.00	0.17
15	600183	生益科技	1,930,282.00	0.15
16	002600	领益智造	1,918,231.00	0.15
17	601318	中国平安	1,915,851.00	0.15
18	603993	洛阳钼业	1,870,024.00	0.15
19	603986	兆易创新	1,854,129.30	0.14
20	600875	东方电气	1,730,151.00	0.13

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	300750	宁德时代	11,512,927.40	0.90
2	300308	中际旭创	8,727,750.00	0.68
3	600519	贵州茅台	7,759,625.00	0.60

4	601899	紫金矿业	7,165,981.00	0.56
5	300502	新易盛	6,504,880.20	0.51
6	601318	中国平安	5,602,097.00	0.44
7	688256	寒武纪	5,341,495.66	0.42
8	600036	招商银行	4,211,769.00	0.33
9	000333	美的集团	3,969,948.00	0.31
10	603986	兆易创新	3,133,901.00	0.24
11	600900	长江电力	3,118,703.00	0.24
12	002475	立讯精密	3,114,991.00	0.24
13	603993	洛阳钼业	2,807,304.00	0.22
14	601166	兴业银行	2,754,821.00	0.21
15	603259	药明康德	2,603,355.00	0.20
16	688041	海光信息	2,579,793.08	0.20
17	688981	中芯国际	2,494,328.36	0.19
18	002371	北方华创	2,442,207.00	0.19
19	601088	中国神华	2,410,545.00	0.19
20	002594	比亚迪	2,330,745.00	0.18

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	169,090,042.05
卖出股票收入（成交）总额	320,520,681.61

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	62,372,688.27	4.89
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	62,372,688.27	4.89

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	019827	26 国债 01	258,000	25,967,233.48	2.04
2	019792	25 国债 19	230,000	23,241,323.56	1.82
3	019785	25 国债 13	130,000	13,164,131.23	1.03

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，适度参与国债期货交易。

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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约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	3,231,582.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,231,582.44

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	001248	华润新能源	412,285.80	0.03	新股流通受限
1	001248	华润新能源	176,682.36	0.01	新股未上市
2	301666	大普微	565,262.60	0.04	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	272,085.27	0.02	新股流通受限
4	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	新股流通受限
5	001399	惠科股份	179,912.24	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
中欧中证 A500 指数	6,211	43,074.93	11,098,909.99	4.15%	256,439,496.26	95.85%

发起 A						
中欧中证 A500 指数发起 C	9,111	67,309.39	212,101,689.97	34.59%	401,154,197.82	65.41%
中欧中证 A500 指数发起 Y	5,867	7,435.93	0.00	0.00%	43,626,605.35	100.00%
合计	21,189	43,627.40	223,200,599.96	24.14%	701,220,299.43	75.86%

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	中欧中证 A500 指数发起 A	50,498.66	0.02%
	中欧中证 A500 指数发起 C	0.00	0.00%
	中欧中证 A500 指数发起 Y	222,644.07	0.51%
	合计	273,142.73	0.03%

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	中欧中证 A500 指数发起 A	0
	中欧中证 A500 指数发起 C	0
	中欧中证 A500 指数发起 Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证 A500 指数发起 A	0
	中欧中证 A500 指数发起 C	0
	中欧中证 A500 指数发起 Y	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.08%	10,000,000.00	1.08%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—

合计	10,000,000.00	1.08%	10,000,000.00	1.08%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
基金合同生效 日（2024 年 11 月 4 日）基金 份额总额	682,964,211.94	1,705,361,803.05	—
本报告期期初 基金份额总额	306,393,357.07	721,476,252.51	20,833,188.00
本报告期基金 总申购份额	86,021,411.26	178,371,882.20	31,508,200.57
减：本报告期 基金总赎回份 额	124,876,362.08	286,592,246.92	8,714,783.22
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末 基金份额总额	267,538,406.25	613,255,887.79	43,626,605.35

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

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
方正证券	3	486,178,694.95	100.00	90,326.22	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 基金租用或者通过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(%)
方正证券	62,126,796.77	100.00	358,553,000.00	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 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“赤峰黄金”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-21
4	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（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
7	中欧中证 A500 指数发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
9	中欧中证 A500 指数发起式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	2026-05-20
10	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06

§ 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	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	212,098,880.74	0.00	0.00	212,098,880.74	22.94 %
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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

2026 年 8 月 29 日