

中欧量化动力混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：海通证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	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	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
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	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化动力混合型证券投资基金	
基金简称	中欧量化动力混合	
基金主代码	015006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	323,844,392.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
下属分级基金的交易代码	015006	015007
报告期末下属分级基金的份额总额	150,595,777.54 份	173,248,615.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95553
传真	021-33830351	021-63410637
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市广东路 689 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
邮政编码	200120	200011
法定代表人	窦玉明	周杰

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
本期已实现收益	-14,041,302.96	-15,750,604.07
本期利润	-12,833,744.13	-14,592,442.79
加权平均基金份 额本期利润	-0.0744	-0.0771
本期加权平均净 值利润率	-8.99%	-9.43%
本期基金份额净 值增长率	-7.99%	-8.25%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-29,135,496.57	-35,472,155.62
期末可供分配基 金份额利润	-0.1935	-0.2047
期末基金资产净	121,460,280.97	137,776,459.56

值		
期末基金份额净值	0.8065	0.7953
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.69%	-18.83%

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

中欧量化动力混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.02%	0.73%	-4.73%	0.65%	0.71%	0.08%
过去三个月	-3.63%	0.88%	-4.62%	0.85%	0.99%	0.03%
过去六个月	-7.99%	1.21%	-6.51%	1.08%	-1.48%	0.13%
过去一年	-17.61%	1.04%	-13.76%	0.91%	-3.85%	0.13%
自基金合同生效起至今	-17.69%	0.98%	-22.82%	0.96%	5.13%	0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧量化动力混合 C

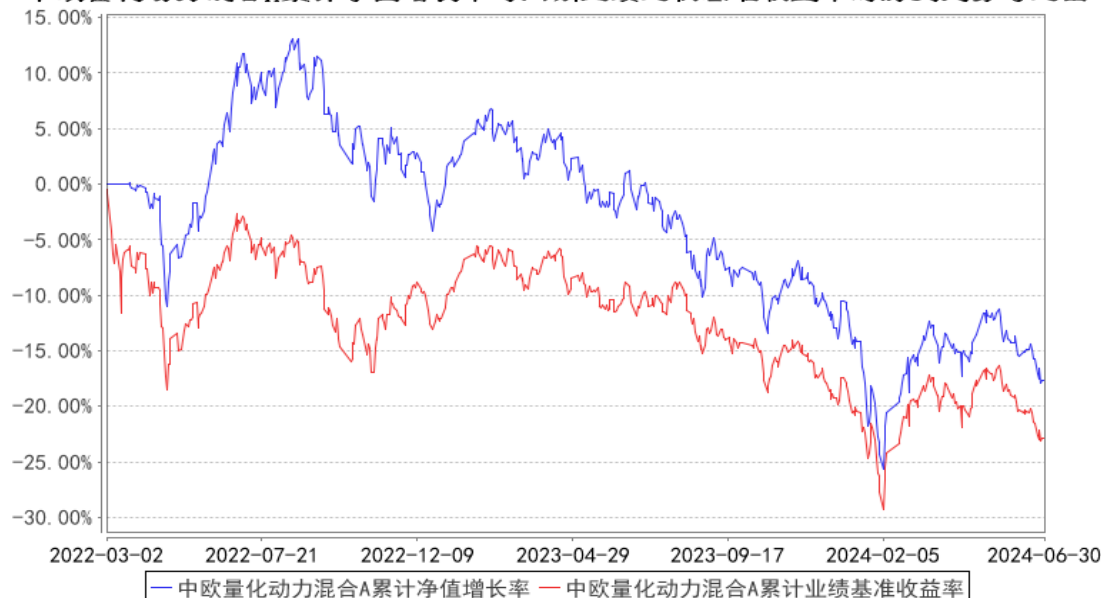
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.07%	0.73%	-4.73%	0.65%	0.66%	0.08%
过去三个月	-3.76%	0.88%	-4.62%	0.85%	0.86%	0.03%

过去六个月	-8.25%	1.21%	-6.51%	1.08%	-1.74%	0.13%
过去一年	-18.09%	1.04%	-13.76%	0.91%	-4.33%	0.13%
自基金合同生效起至今	-18.83%	0.98%	-22.82%	0.96%	3.99%	0.02%

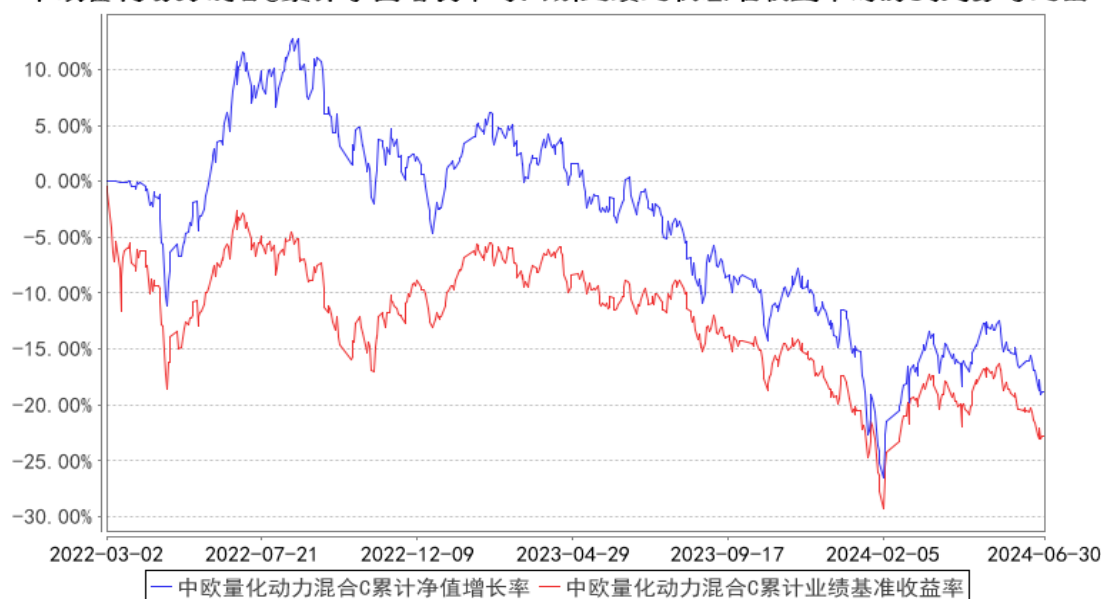
注：本基金业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+活期存款利率(税后)*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧量化动力混合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



中欧量化动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 175 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	2 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2022-03-02	-	17 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	7	2,846,471,063.97	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,620,687,948.78	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,467,159,012.75	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2024-05-31；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无。

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 14 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

回顾上半年，A 股市场呈现震荡趋势，上证指数于 2 月初下探至 2020 年以来的低点，随后在 3 月至 5 月有所反弹，但在半年末重新跌破 3000 点大关。市场整体表现较为疲软，尤其是消费和医药板块下跌较多，年初的微盘股释放风险，发生较大调整，也加剧了市场风险偏好收缩。对比来看，受益于低风险情绪的高股息板块，如银行、公共事业等，具有明显防守属性，受到资金青睐，成为上半年重要“避风港”。同时，出口占比较高的公司，受益于全球通胀和中国制造的优势，在上半年也有相对较好的表现。

从量化角度来看，基本面因子今年持续强势，有显著的超额收益。基本面因子中，表现最突出的是价值因子，其通常包括低市盈率、低市净率、高股息率等特点，倾向于选择估值便宜的股

票。在宏观经济结构调整的大背景下，投资者更倾向于投资确定性更高的资产，因此低估值、高股息的价值风格表现相对较好。而传统的交易型量价因子在上半年表现不及预期。量价因子的表现与市场的交易活跃度有密切的关联，市场交易越活跃，量价因子就越有效。随着市场风险偏好下降，叠加对高频交易的逐步规范，市场成交量在上半年逐月下降，全 A 的成交量在 6 月底回落到 7000 亿以下，这也解释了量价因子近期表现较弱，而基本面类因子较强的原因。在报告期内，我们以偏股混合型基金的数量特征作为抓手，保持了均衡的风格和行业配置，整体表现为中大盘的成长风格。操作上，高配部分模型预测的景气行业，在行业内采用基本面因子、另类数据因子和量价因子的多维度综合打分，对个股进行配置，构成基金投资组合，力争获取超越基准的回报。

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-7.99%，同期业绩比较基准收益率为-6.51%；基金 C 类份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为-6.51%。

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，市场仍处于修复期，地产政策放开的力度和影响还需观察。在结构调整，经济驱动力从传统行业向“新质生产力”转型的过程中，必然要经历低增速的一段转型期，市场难有一蹴而就的景气趋势投资机会。然而，我们认为依然有不少结构化的投资机会。其中最看好出口链相关的各类企业。海外高通胀环境，叠加二季度库存较低，欧美国家有回补存货的需要，相关公司或将享受较为景气的外部经营环境，受益行业包括部分轻工行业和家用电器；同时由于中国制造的竞争力持续提升，在制造端的低成本和产品端的高竞争力，也为一些企业创造了全球机会，典型行业为整车制造、工程机械、电力设备等。从量化角度来看，我们认为，经过 3 年的估值去化，很多经营稳健的公司进入了低估值、高分红、高增速的区间，呈现出较好的投资机会，基本面类因子今年的强势或将持续。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品

种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。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

本报告期内，本基金托管人在中欧量化动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧量化动力混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化动力混合型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：中欧量化动力混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	31,707,354.48	24,533,269.12
结算备付金		1,989,454.92	737,952.98
存出保证金		484,473.60	420,955.20
交易性金融资产	6.4.7.2	226,119,873.86	327,172,611.13
其中：股票投资		223,682,397.70	324,760,052.23
基金投资		-	-
债券投资		2,437,476.16	2,412,558.90
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		232,178.42	26,974.18
应收申购款		208,288.13	170,427.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		260,741,623.41	353,062,189.94
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,726.38	5.86
应付赎回款		1,035,234.09	298,173.96
应付管理人报酬		267,590.44	363,939.30
应付托管费		33,448.82	45,492.42
应付销售服务费		70,267.29	95,281.50
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	87,615.86	50,000.15
负债合计		1,504,882.88	852,893.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	323,844,392.72	404,174,523.34
未分配利润	6.4.7.8	-64,607,652.19	-51,965,226.59
净资产合计		259,236,740.53	352,209,296.75
负债和净资产总计		260,741,623.41	353,062,189.94

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 323,844,392.72 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8065 元，基金份额总额 150,595,777.54 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.7953 元，基金份额总额 173,248,615.18 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-24,869,354.86	19,270,598.49
1. 利息收入		75,363.59	411,370.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	75,363.59	216,396.60
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		-	194,973.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-27,349,920.27	4,801,213.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-30,447,817.22	79,112.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	19,637.26	102,391.62
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	363,122.81	2,061,764.64
股利收益	6.4.7.14	2,715,136.88	2,557,944.74
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,365,720.11	11,752,621.34
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	39, 481. 71	2, 305, 393. 75
减: 二、营业总支出		2, 556, 832. 06	4, 325, 272. 30
1. 管理人报酬		1, 775, 380. 05	3, 244, 905. 47
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		221, 922. 50	324, 490. 56
3. 销售服务费		461, 402. 41	652, 940. 30
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		3, 563. 17	9, 182. 40
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	94, 563. 93	93, 753. 57
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-27, 426, 186. 92	14, 945, 326. 19
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-27, 426, 186. 92	14, 945, 326. 19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-27, 426, 186. 92	14, 945, 326. 19

6.3 净资产变动表

会计主体: 中欧量化动力混合型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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	404, 174, 523. 34	-	-51, 965, 226. 59	352, 209, 296. 75
二、本期期初净资产	404, 174, 523. 34	-	-51, 965, 226. 59	352, 209, 296. 75
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-80, 330, 130. 62	-	-12, 642, 425. 60	-92, 972, 556. 22
(一)、综合收益总额	-	-	-27, 426, 186. 92	-27, 426, 186. 92
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以	-80, 330, 130. 62	-	14, 783, 761. 32	-65, 546, 369. 30

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	50,438,412.03	-	-8,967,055.67	41,471,356.36
2. 基金赎回款	-130,768,542.65	-	23,750,816.99	-107,017,725.66
(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	323,844,392.72	-	-64,607,652.19	259,236,740.53
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
二、本期期初净资产	213,184,420.57	-	-4,211,719.81	208,972,700.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	496,895,648.05	-	-14,461,972.87	482,433,675.18
(一)、综合收益总额	-	-	14,945,326.19	14,945,326.19
(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)	496,895,648.05	-	-21,867,547.54	475,028,100.51
其中：1. 基金申购款	1,116,988,613.77	-	-4,617,298.23	1,112,371,315.54
2. 基金赎回款	-620,092,965.72	-	-17,250,249.31	-637,343,215.03
(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)	-	-	-7,539,751.52	-7,539,751.52
四、本期期末净资产	710,080,068.62	-	-18,673,692.68	691,406,375.94

资产				
----	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧量化动力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]77 号文《关于准予中欧量化动力混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 324,023,694.26 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B18 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 324,069,096.67 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 45,402.41 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 115,946,789.67 份，包含认购利息折合 16,331.99 份；C 类基金的基金份额总额为 208,122,307.00 份，包含认购利息折合 29,070.42 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，基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业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、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（不含合约类信用衍生品）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合

约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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暂行条例（2011 年修订）》、《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）及地方教育费附加。

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,152,518.20
等于：本金	1,151,902.68
加：应计利息	615.52
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	30,554,836.28
等于：本金	30,551,726.57
加：应计利息	3,109.71
减：坏账准备	-
合计	31,707,354.48

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 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	229,909,582.89	-	223,682,397.70	-6,227,185.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	36,996.16	2,437,476.16	7,992.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	36,996.16	2,437,476.16	7,992.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	232,302,070.89	36,996.16	226,119,873.86	-6,219,193.19
----	----------------	-----------	----------------	---------------

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,165,658.67	-	-	-
其中：股指期货投资	4,165,658.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,165,658.67	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2409	IF2409	3.00	3,081,240.00	-9,072.00
IM2409	IM2409	1.00	956,040.00	-119,306.67
合计				-128,378.67
减：可抵销期货暂收款				-128,378.67
净额				0.00

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

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2024 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	59,672.34
预提费用-审计费	24,863.02
其他应付	3,080.50
合计	87,615.86

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧量化动力混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,727,270.60	193,727,270.60
本期申购	5,439,771.00	5,439,771.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,571,264.06	-48,571,264.06
本期末	150,595,777.54	150,595,777.54

中欧量化动力混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,447,252.74	210,447,252.74
本期申购	44,998,641.03	44,998,641.03
本期赎回（以“-”号填列）	-82,197,278.59	-82,197,278.59
本期末	173,248,615.18	173,248,615.18

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

中欧量化动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,497,013.34	-12,435,672.69	-23,932,686.03

本期期初	-11,497,013.34	-12,435,672.69	-23,932,686.03
本期利润	-14,041,302.96	1,207,558.83	-12,833,744.13
本期基金份额交易产生的变动数	5,623,024.07	2,007,909.52	7,630,933.59
其中：基金申购款	-683,727.73	-230,761.83	-914,489.56
基金赎回款	6,306,751.80	2,238,671.35	8,545,423.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,915,292.23	-9,220,204.34	-29,135,496.57

中欧量化动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,585,257.98	-13,447,282.58	-28,032,540.56
本期期初	-14,585,257.98	-13,447,282.58	-28,032,540.56
本期利润	-15,750,604.07	1,158,161.28	-14,592,442.79
本期基金份额交易产生的变动数	5,419,066.00	1,733,761.73	7,152,827.73
其中：基金申购款	-5,765,846.33	-2,286,719.78	-8,052,566.11
基金赎回款	11,184,912.33	4,020,481.51	15,205,393.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,916,796.05	-10,555,359.57	-35,472,155.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	8,009.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	53,851.33
结算备付金利息收入	13,503.10
其他	-
合计	75,363.59

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,281,136,424.45
减：卖出股票成本总额	1,309,391,226.22
减：交易费用	2,193,015.45
买卖股票差价收入	-30,447,817.22

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	19,637.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	19,637.26

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	363,122.81

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,715,136.88
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	2,715,136.88

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	2,497,018.78
股票投资	2,491,738.78
债券投资	5,280.00
资产支持证券投资	-

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-131,298.67
权证投资	-
期货投资	-131,298.67
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,365,720.11

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	39,450.38
基金转换费收入	31.33
合计	39,481.71

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
证券组合费	1,016.92
存托服务费	11.65
合计	94,563.93

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

中欧基金管理有限公司已于 2024 年 4 月 9 日正式受让中欧私募基金管理（上海）有限公司全部股权，中欧私募基金管理（上海）有限公司已变更为中欧基金管理有限公司全资子公司。

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

注：下述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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
海通证券	855,103,804.17	34.40	1,338,551,191.91	28.39

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	938,160,000.00	42.16

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 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 (%)
海通证券	452,560.17	34.56	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
海通证券	706,417.51	25.75	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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和市场信息服务等。

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,775,380.05	3,244,905.47
其中：应支付销售机构的客户维护 费	711,831.20	1,201,397.39
应支付基金管理人的净管理费	1,063,548.85	2,043,508.08

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费率由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	221,922.50	324,490.56

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	0.00	193,542.85	193,542.85
中欧财富	0.00	18.71	18.71
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	193,561.56	193,561.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C	合计
海通证券	0.00	170,558.93	170,558.93
中欧财富	0.00	91.63	91.63
中欧基金	0.00	95,514.82	95,514.82
合计	0.00	266,165.38	266,165.38

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。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 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，

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自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自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

份额单位：份

中欧量化动力混合 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	1,086,004.70	0.72%	1,086,004.70	0.56%

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

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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
海通证券股份有限公司	19,506,482.20	23,246.03	48,576,525.69	90,443.42

注：本基金的银行存款由基金托管人海通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（2024 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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

	技	日								
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	40.09	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	170	7,641.50	11,208.10	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	70.49	188.01	711	50,121.55	133,675.11	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	455	7,371.00	7,261.80	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

	份	日								
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	55	3,985.30	3,743.30	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	158	4,108.00	5,923.42	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	119	2,778.65	2,990.47	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	457	10,355.62	7,261.73	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	102	8,869.92	17,842.86	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	572	8,974.68	10,747.88	-

	微	日								
--	---	---	--	--	--	--	--	--	--	--

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2024 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 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查和反馈。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上市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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 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 2024 年 06 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(所有者权益)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 2024 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	31,707,354.48	-	-	-	31,707,354.48
结算备付金	1,989,454.92	-	-	-	1,989,454.92
存出保证金	-	-	-	484,473.60	484,473.60
交易性金融资产	2,437,476.16	-	-	-223,682,397.70	226,119,873.86
应收股利	-	-	-	232,178.42	232,178.42
应收申购款	-	-	-	208,288.13	208,288.13
资产总计	36,134,285.56	-	-	-224,607,337.85	260,741,623.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,035,234.09	1,035,234.09
应付管理人报酬	-	-	-	267,590.44	267,590.44
应付托管费	-	-	-	33,448.82	33,448.82
应付清算款	-	-	-	10,726.38	10,726.38

应付销售服务费	-	-	-	70,267.29	70,267.29
其他负债	-	-	-	87,615.86	87,615.86
负债总计	-	-	-	1,504,882.88	1,504,882.88
利率敏感度缺口	36,134,285.56	-	-	-223,102,454.97	259,236,740.53
上年度末 2023 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	24,533,269.12	-	-	-	24,533,269.12
结算备付金	737,952.98	-	-	-	737,952.98
存出保证金	-	-	-	420,955.20	420,955.20
交易性金融资产	2,412,558.90	-	-	-324,760,052.23	327,172,611.13
应收股利	-	-	-	26,974.18	26,974.18
应收申购款	-	-	-	170,427.33	170,427.33
资产总计	27,683,781.00	-	-	-325,378,408.94	353,062,189.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	298,173.96	298,173.96
应付管理人报酬	-	-	-	363,939.30	363,939.30
应付托管费	-	-	-	45,492.42	45,492.42
应付清算款	-	-	-	5.86	5.86
应付销售服务费	-	-	-	95,281.50	95,281.50
其他负债	-	-	-	50,000.15	50,000.15
负债总计	-	-	-	852,893.19	852,893.19
利率敏感度缺口	27,683,781.00	-	-	-324,525,515.75	352,209,296.75

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 2024 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 0.94%（2023 年 12 月 31 日：0.68%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			合计
	美元 折合人民	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	19,041,911.82	-	19,041,911.82
应收股利	-	232,178.42	-	232,178.42
资产合计	-	19,274,090.24	-	19,274,090.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	19,274,090.24	-	19,274,090.24
	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	27,050,947.01	-	27,050,947.01
应收股利	-	26,974.18	-	26,974.18
资产合计	-	27,077,921.19	-	27,077,921.19
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	27,077,921.19	-	27,077,921.19

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬	-963,704.51	-1,353,896.06

	值 5%		
	港币相对人民币升值 5%	963, 704. 51	1, 353, 896. 06

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	223, 682, 397. 70	86. 28	324, 760, 052. 23	92. 21
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	223, 682, 397. 70	86. 28	324, 760, 052. 23	92. 21

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	14, 006, 548. 65	19, 422, 359. 62
	业绩比较基准下降	-14, 006, 548. 65	-19, 422, 359. 62

	5%		
--	----	--	--

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	223,338,428.66	323,635,654.01
第二层次	2,461,478.71	2,641,518.90
第三层次	319,966.49	895,438.22
合计	226,119,873.86	327,172,611.13

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 2024 年 8 月 30 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	223,682,397.70	85.79
	其中：股票	223,682,397.70	85.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,437,476.16	0.93
	其中：债券	2,437,476.16	0.93
	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	33,696,809.40	12.92
8	其他各项资产	924,940.15	0.35
9	合计	260,741,623.41	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 19,041,911.82 元，占基金资产净值比例 7.35%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,682,501.00	1.03
B	采矿业	6,912,754.00	2.67
C	制造业	152,604,314.67	58.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,638,220.00	2.17
E	建筑业	1,637,247.00	0.63
F	批发和零售业	2,335,110.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	5,534,441.40	2.13

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,855,666.21	4.19
J	金融业	8,035,024.00	3.10
K	房地产业	319,035.00	0.12
L	租赁和商务服务业	517,128.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	1,656,909.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	1,693,439.80	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,522.80	0.00
R	文化、体育和娱乐业	4,214,173.00	1.63
S	综合	-	-
	合计	204,640,485.88	78.94

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	9,145.05	0.00
消费者非必需品	6,000,169.15	2.31
消费者常用品	1,171,698.58	0.45
能源	-	-
金融	4,117,067.53	1.59
医疗保健	136,682.96	0.05
工业	-	-
信息技术	2,555,629.03	0.99
电信服务	4,177,172.08	1.61
公用事业	874,347.44	0.34
地产业	-	-
合计	19,041,911.82	7.35

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01211	比亚迪股份	19,500	4,128,964.32	1.59
1	002594	比亚迪	3,200	800,800.00	0.31
2	002371	北方华创	10,100	3,230,889.00	1.25
3	000568	泸州老窖	21,614	3,101,392.86	1.20
4	603198	迎驾贡酒	52,000	2,990,000.00	1.15
5	00700	腾讯控股	8,000	2,719,056.26	1.05
6	603605	珀莱雅	22,800	2,530,572.00	0.98
7	000333	美的集团	34,900	2,251,050.00	0.87
8	002463	沪电股份	61,500	2,244,750.00	0.87

9	000651	格力电器	56,600	2,219,852.00	0.86
10	603899	晨光股份	70,100	2,192,728.00	0.85
11	300760	迈瑞医疗	6,800	1,978,188.00	0.76
12	000598	兴蓉环境	226,000	1,699,520.00	0.66
13	300628	亿联网络	46,000	1,691,420.00	0.65
14	002683	广东宏大	84,000	1,690,920.00	0.65
15	603338	浙江鼎力	27,900	1,685,718.00	0.65
16	01398	工商银行	273,000	1,156,110.01	0.45
16	601398	工商银行	92,400	526,680.00	0.20
17	601019	山东出版	141,100	1,667,802.00	0.64
18	600887	伊利股份	64,500	1,666,680.00	0.64
19	601216	君正集团	449,500	1,658,655.00	0.64
20	601965	中国汽研	98,100	1,656,909.00	0.64
21	002372	伟星新材	107,400	1,656,108.00	0.64
22	600519	贵州茅台	1,100	1,614,129.00	0.62
23	002601	龙佰集团	80,900	1,502,313.00	0.58
24	01810	小米集团-W	98,400	1,480,031.09	0.57
25	01024	快手-W	34,400	1,448,934.26	0.56
26	002475	立讯精密	36,100	1,419,091.00	0.55
27	002028	思源电气	20,900	1,398,210.00	0.54
28	300357	我武生物	67,400	1,362,828.00	0.53
29	002318	久立特材	56,700	1,322,811.00	0.51
30	01288	农业银行	261,000	795,619.66	0.31
30	601288	农业银行	120,400	524,944.00	0.20
31	603816	顾家家居	40,100	1,294,829.00	0.50
32	00939	建设银行	134,000	705,665.92	0.27
32	601939	建设银行	70,900	524,660.00	0.20
33	03328	交通银行	125,000	699,341.05	0.27
33	601328	交通银行	70,200	524,394.00	0.20
34	02367	巨子生物	28,000	1,171,698.58	0.45
35	300413	芒果超媒	55,600	1,162,040.00	0.45
36	601728	中国电信	186,400	1,146,360.00	0.44
37	600809	山西汾酒	5,200	1,096,576.00	0.42
38	03690	美团-W	10,810	1,096,120.47	0.42
39	600161	天坛生物	44,800	1,093,120.00	0.42
40	300750	宁德时代	6,000	1,080,180.00	0.42
41	002130	沃尔核材	63,800	900,856.00	0.35
42	03968	招商银行	23,500	760,330.89	0.29
42	600036	招商银行	3,700	126,503.00	0.05
43	00836	华润电力	40,000	874,347.44	0.34
44	002273	水晶光电	50,900	864,282.00	0.33
45	601298	青岛港	89,400	854,664.00	0.33
46	688100	威胜信息	22,400	854,560.00	0.33

47	601000	唐山港	181,600	853,520.00	0.33
48	600323	瀚蓝环境	40,700	850,630.00	0.33
49	002415	海康威视	27,500	850,025.00	0.33
50	600582	天地科技	123,100	848,159.00	0.33
51	601985	中国核电	79,500	847,470.00	0.33
52	002138	顺络电子	30,800	845,768.00	0.33
53	001872	招商港口	43,900	845,075.00	0.33
54	600398	海澜之家	91,400	844,536.00	0.33
55	600885	宏发股份	30,500	844,240.00	0.33
56	001289	龙源电力	48,900	843,525.00	0.33
57	002001	新和成	43,900	842,880.00	0.33
58	300014	亿纬锂能	21,100	842,312.00	0.32
59	601018	宁波港	247,400	841,160.00	0.32
60	600660	福耀玻璃	17,500	838,250.00	0.32
61	300394	天孚通信	9,480	838,221.60	0.32
62	002832	比音勒芬	34,600	836,282.00	0.32
63	000582	北部湾港	112,360	835,958.40	0.32
64	603568	伟明环保	40,600	835,548.00	0.32
65	300699	光威复材	33,600	834,288.00	0.32
66	688016	心脉医疗	8,500	833,425.00	0.32
67	002698	博实股份	67,800	831,906.00	0.32
68	600845	宝信软件	26,040	831,457.20	0.32
69	603288	海天味业	24,035	828,486.45	0.32
70	300529	健帆生物	30,400	827,184.00	0.32
71	002507	涪陵榨菜	67,500	826,875.00	0.32
72	600867	通化东宝	98,700	826,119.00	0.32
73	603658	安图生物	17,900	824,653.00	0.32
74	600566	济川药业	26,000	824,460.00	0.32
75	002320	海峡股份	159,700	824,052.00	0.32
76	600600	青岛啤酒	11,300	822,301.00	0.32
77	002422	科伦药业	27,100	821,943.00	0.32
78	600933	爱柯迪	55,500	820,845.00	0.32
79	002557	洽洽食品	29,100	820,329.00	0.32
80	000786	北新建材	27,600	818,616.00	0.32
81	300595	欧普康视	52,100	816,928.00	0.32
82	600779	水井坊	21,700	816,571.00	0.31
83	300661	圣邦股份	9,800	811,244.00	0.31
84	603659	璞泰来	57,400	811,062.00	0.31
85	600183	生益科技	38,500	810,810.00	0.31
86	603369	今世缘	17,500	808,500.00	0.31
87	601899	紫金矿业	46,000	808,220.00	0.31
88	601811	新华文轩	57,200	801,372.00	0.31
89	603939	益丰药房	32,600	800,330.00	0.31

90	603883	老百姓	43,400	796,824.00	0.31
91	603195	公牛集团	10,275	792,408.00	0.31
92	600970	中材国际	63,700	768,222.00	0.30
93	600436	片仔癀	3,700	766,529.00	0.30
94	600989	宝丰能源	44,100	764,253.00	0.29
95	603383	顶点软件	23,820	763,907.40	0.29
96	688408	中信博	8,131	748,702.48	0.29
97	600435	北方导航	85,300	735,286.00	0.28
98	300693	盛弘股份	34,700	726,618.00	0.28
99	688772	珠海冠宇	48,700	725,630.00	0.28
100	601233	桐昆股份	45,300	722,988.00	0.28
101	600938	中国海油	21,900	722,700.00	0.28
102	300502	新易盛	6,800	717,740.00	0.28
103	002182	宝武镁业	62,700	707,256.00	0.27
104	600426	华鲁恒升	26,500	705,960.00	0.27
105	688111	金山办公	3,100	705,250.00	0.27
106	09992	泡泡玛特	20,000	698,200.20	0.27
107	600316	洪都航空	41,800	695,134.00	0.27
108	601601	中国太保	24,600	685,356.00	0.26
109	000425	徐工机械	95,100	679,965.00	0.26
110	688012	中微公司	4,794	677,200.44	0.26
111	000596	古井贡酒	3,200	675,424.00	0.26
112	000729	燕京啤酒	76,100	671,963.00	0.26
113	688120	华海清科	3,500	663,530.00	0.26
114	300395	菲利华	21,500	661,125.00	0.26
115	603228	景旺电子	20,200	642,360.00	0.25
116	300003	乐普医疗	43,000	638,120.00	0.25
117	00992	联想集团	62,000	623,579.48	0.24
118	600801	华新水泥	45,200	621,500.00	0.24
119	688008	澜起科技	10,844	619,843.04	0.24
120	000550	江铃汽车	28,000	607,880.00	0.23
121	601137	博威合金	39,800	606,552.00	0.23
122	688278	特宝生物	11,178	598,581.90	0.23
123	600150	中国船舶	14,700	598,437.00	0.23
124	000951	中国重汽	41,700	597,144.00	0.23
125	600761	安徽合力	27,000	584,280.00	0.23
126	600489	中金黄金	39,400	583,120.00	0.22
127	002643	万润股份	58,300	583,000.00	0.22
128	601882	海天精工	25,400	581,914.00	0.22
129	601717	郑煤机	39,300	581,640.00	0.22
130	601058	赛轮轮胎	41,500	581,000.00	0.22
131	688188	柏楚电子	3,147	580,778.85	0.22
132	600482	中国动力	29,800	580,504.00	0.22

133	002984	森麒麟	24,000	578,160.00	0.22
134	688256	寒武纪	2,900	576,143.00	0.22
135	600038	中直股份	14,000	575,540.00	0.22
136	601857	中国石油	55,600	573,792.00	0.22
137	605116	奥锐特	22,900	573,187.00	0.22
138	688037	芯源微	6,437	572,893.00	0.22
139	605166	聚合顺	54,500	571,705.00	0.22
140	605090	九丰能源	19,700	571,300.00	0.22
141	002179	中航光电	15,000	570,750.00	0.22
142	000063	中兴通讯	20,400	570,588.00	0.22
143	601009	南京银行	54,700	568,333.00	0.22
144	002452	长高电新	68,600	568,008.00	0.22
145	300853	申昊科技	39,000	567,060.00	0.22
146	600066	宇通客车	21,900	565,020.00	0.22
147	688639	华恒生物	7,394	564,827.66	0.22
148	688180	君实生物	19,400	563,570.00	0.22
149	002558	巨人网络	59,600	562,624.00	0.22
150	600536	中国软件	18,800	562,496.00	0.22
151	002572	索菲亚	36,600	561,078.00	0.22
152	300418	昆仑万维	17,400	560,976.00	0.22
153	605499	东鹏饮料	2,600	560,950.00	0.22
154	300105	龙源技术	86,800	560,728.00	0.22
155	002432	九安医疗	13,800	559,452.00	0.22
156	300636	同和药业	54,900	558,333.00	0.22
157	600559	老白干酒	30,700	558,126.00	0.22
158	002714	牧原股份	12,800	558,080.00	0.22
159	603040	新坐标	28,000	558,040.00	0.22
160	600309	万华化学	6,900	557,934.00	0.22
161	600418	江淮汽车	35,200	557,568.00	0.22
162	300408	三环集团	19,100	557,529.00	0.22
163	603606	东方电缆	11,400	556,434.00	0.21
164	600694	大商股份	33,100	556,411.00	0.21
165	600378	昊华科技	19,200	554,880.00	0.21
166	600176	中国巨石	50,200	554,710.00	0.21
167	000768	中航西飞	23,000	552,690.00	0.21
168	600160	巨化股份	22,900	552,577.00	0.21
169	300729	乐歌股份	35,600	551,444.00	0.21
170	000423	东阿阿胶	8,800	550,880.00	0.21
171	300458	全志科技	23,400	550,134.00	0.21
172	001389	广合科技	12,322	549,389.32	0.21
173	600975	新五丰	77,500	547,925.00	0.21
174	603556	海兴电力	11,700	547,911.00	0.21
175	000700	模塑科技	104,300	547,575.00	0.21

176	600486	扬农化工	9,700	547,565.00	0.21
177	002048	宁波华翔	42,300	547,362.00	0.21
178	002755	奥赛康	56,700	547,155.00	0.21
179	300498	温氏股份	27,600	547,032.00	0.21
180	002738	中矿资源	20,400	546,720.00	0.21
181	000895	双汇发展	23,000	546,710.00	0.21
182	300251	光线传媒	65,000	546,650.00	0.21
183	002444	巨星科技	22,100	545,870.00	0.21
184	000682	东方电子	49,400	545,376.00	0.21
185	300373	扬杰科技	14,000	544,600.00	0.21
186	300415	伊之密	26,200	544,436.00	0.21
187	300124	汇川技术	10,600	543,780.00	0.21
188	688349	三一重能	21,871	543,275.64	0.21
189	601595	上海电影	27,400	541,972.00	0.21
190	002472	双环传动	24,600	541,692.00	0.21
191	603055	台华新材	53,400	540,942.00	0.21
192	300285	国瓷材料	30,300	540,855.00	0.21
193	688676	金盘科技	10,366	540,586.90	0.21
194	601336	新华保险	18,000	540,540.00	0.21
195	002487	大金重工	23,600	539,968.00	0.21
196	688981	中芯国际	11,700	539,370.00	0.21
197	000426	兴业银锡	39,600	537,768.00	0.21
198	000529	广弘控股	91,300	536,844.00	0.21
199	605117	德业股份	7,220	536,734.80	0.21
200	603229	奥翔药业	53,400	536,670.00	0.21
201	603979	金诚信	10,600	535,618.00	0.21
202	601688	华泰证券	43,200	535,248.00	0.21
203	002752	昇兴股份	105,600	534,336.00	0.21
204	600733	北汽蓝谷	66,100	534,088.00	0.21
205	603179	新泉股份	13,600	533,664.00	0.21
206	300702	天宇股份	29,900	533,117.00	0.21
207	600031	三一重工	32,300	532,950.00	0.21
208	002790	瑞尔特	59,000	532,770.00	0.21
209	601169	北京银行	91,200	532,608.00	0.21
210	688698	伟创电气	19,737	532,306.89	0.21
211	600276	恒瑞医药	13,800	530,748.00	0.20
212	300633	开立医疗	13,400	530,372.00	0.20
213	002254	泰和新材	59,900	530,115.00	0.20
214	603225	新凤鸣	34,000	530,060.00	0.20
215	000719	中原传媒	52,300	528,753.00	0.20
216	688369	致远互联	33,600	528,528.00	0.20
217	300274	阳光电源	8,520	528,495.60	0.20
218	600900	长江电力	18,200	526,344.00	0.20

219	600483	福能股份	45,100	525,866.00	0.20
220	603296	华勤技术	9,480	523,580.40	0.20
221	688361	中科飞测	11,054	522,854.20	0.20
222	300973	立高食品	18,600	522,474.00	0.20
223	002271	东方雨虹	42,300	521,982.00	0.20
224	002230	科大讯飞	12,100	519,695.00	0.20
225	300033	同花顺	5,000	518,500.00	0.20
226	688331	荣昌生物	11,992	518,054.40	0.20
227	600000	浦发银行	62,900	517,667.00	0.20
228	300482	万孚生物	21,200	517,280.00	0.20
229	601168	西部矿业	28,800	516,960.00	0.20
230	601881	中国银河	47,600	516,936.00	0.20
231	603477	巨星农牧	18,000	516,600.00	0.20
232	600919	江苏银行	69,500	516,385.00	0.20
233	601636	旗滨集团	79,800	514,710.00	0.20
234	603087	甘李药业	11,100	514,152.00	0.20
235	688728	格科微	42,400	513,464.00	0.20
236	002299	圣农发展	37,600	512,864.00	0.20
237	603596	伯特利	13,160	511,924.00	0.20
238	300979	华利集团	8,400	511,140.00	0.20
239	002142	宁波银行	23,100	509,586.00	0.20
240	688235	百济神州	4,399	509,580.16	0.20
241	002648	卫星化学	28,100	505,238.00	0.19
242	688308	欧科亿	26,000	504,920.00	0.19
243	002850	科达利	6,600	504,108.00	0.19
244	002064	华峰化学	69,900	501,183.00	0.19
245	300454	深信服	9,900	500,247.00	0.19
246	600521	华海药业	29,300	499,565.00	0.19
247	600096	云天化	25,600	497,152.00	0.19
248	688575	亚辉龙	21,300	496,716.00	0.19
249	002050	三花智控	26,000	496,080.00	0.19
250	603538	美诺华	44,300	494,831.00	0.19
251	002353	杰瑞股份	14,100	494,628.00	0.19
252	000921	海信家电	15,200	490,048.00	0.19
253	301358	湖南裕能	15,200	478,192.00	0.18
254	00268	金蝶国际	67,000	447,614.78	0.17
255	000960	锡业股份	26,300	407,387.00	0.16
256	600547	山东黄金	14,600	399,748.00	0.15
257	688018	乐鑫科技	3,895	384,358.60	0.15
258	600941	中国移动	2,500	268,750.00	0.10
259	300308	中际旭创	1,820	250,941.60	0.10
260	601668	中国建筑	40,800	216,648.00	0.08
261	600820	隧道股份	32,000	208,960.00	0.08

262	002311	海大集团	4,400	207,020.00	0.08
263	002027	分众传媒	34,100	206,646.00	0.08
264	002154	报喜鸟	37,600	204,544.00	0.08
265	600346	恒力石化	14,400	200,880.00	0.08
266	603501	韦尔股份	2,000	198,740.00	0.08
267	002993	奥海科技	5,200	193,440.00	0.07
268	000938	紫光股份	8,200	183,270.00	0.07
269	601156	东航物流	9,000	183,150.00	0.07
270	601607	上海医药	9,500	181,545.00	0.07
271	000528	柳工	16,200	181,278.00	0.07
272	600522	中天科技	11,400	180,690.00	0.07
273	600487	亨通光电	11,400	179,778.00	0.07
274	003031	中瓷电子	3,800	175,712.00	0.07
275	688036	传音控股	2,295	175,659.30	0.07
276	600011	华能国际	17,900	172,198.00	0.07
277	300687	赛意信息	12,300	171,216.00	0.07
278	601800	中国交建	19,000	169,860.00	0.07
279	688498	源杰科技	1,294	169,501.06	0.07
280	002139	拓邦股份	15,700	166,734.00	0.06
281	000858	五粮液	1,300	166,452.00	0.06
282	601138	工业富联	6,000	164,400.00	0.06
283	688301	奕瑞科技	1,420	163,626.60	0.06
284	688443	智翔金泰	5,500	163,570.00	0.06
285	688658	悦康药业	9,154	163,307.36	0.06
286	603393	新天然气	4,700	163,278.00	0.06
287	000338	潍柴动力	10,000	162,400.00	0.06
288	601608	中信重工	42,600	162,306.00	0.06
289	000807	云铝股份	12,000	162,120.00	0.06
290	000400	许继电气	4,700	161,727.00	0.06
291	688366	昊海生科	2,608	160,861.44	0.06
292	603558	健盛集团	16,000	159,200.00	0.06
293	601669	中国电建	28,300	158,197.00	0.06
294	603300	华铁应急	28,500	155,610.00	0.06
295	601872	招商轮船	18,400	155,480.00	0.06
296	600755	厦门国贸	21,600	154,872.00	0.06
297	000975	山金国际	9,500	154,755.00	0.06
298	605016	百龙创园	7,480	152,367.60	0.06
299	300401	花园生物	10,600	152,004.00	0.06
300	300303	聚飞光电	31,200	151,632.00	0.06
301	002063	远光软件	28,500	149,340.00	0.06
302	601100	恒立液压	3,200	149,056.00	0.06
303	600572	康恩贝	33,300	148,851.00	0.06
304	600875	东方电气	8,000	147,600.00	0.06

305	002831	裕同科技	5,700	145,863.00	0.06
306	002928	华夏航空	22,300	141,382.00	0.05
307	300542	新晨科技	11,400	140,106.00	0.05
308	001979	招商蛇口	15,900	139,761.00	0.05
309	600550	保变电气	26,600	138,586.00	0.05
310	300487	蓝晓科技	3,300	137,808.00	0.05
311	01548	金斯瑞生物科技	18,000	136,682.96	0.05
312	688266	泽璟制药	2,514	136,309.08	0.05
313	601966	玲珑轮胎	7,300	134,101.00	0.05
314	301589	诺瓦星云	711	133,675.11	0.05
315	601702	华峰铝业	7,300	133,298.00	0.05
316	601838	成都银行	8,700	132,153.00	0.05
317	600546	山煤国际	9,000	131,580.00	0.05
318	601225	陕西煤业	5,000	128,850.00	0.05
319	601699	潞安环能	7,100	128,723.00	0.05
320	002605	姚记科技	6,300	128,646.00	0.05
321	600373	中文传媒	8,600	127,624.00	0.05
322	600873	梅花生物	12,700	127,254.00	0.05
323	600879	航天电子	16,300	126,651.00	0.05
324	603267	鸿远电子	3,700	126,170.00	0.05
325	688072	拓荆科技	1,045	125,514.95	0.05
326	688029	南微医学	2,037	125,397.72	0.05
327	603019	中科曙光	3,000	124,500.00	0.05
328	300552	万集科技	3,300	123,354.00	0.05
329	000519	中兵红箭	8,400	123,228.00	0.05
330	000887	中鼎股份	10,000	122,400.00	0.05
331	600499	科达制造	14,400	121,392.00	0.05
332	601628	中国人寿	3,900	121,095.00	0.05
333	002833	弘亚数控	6,600	120,384.00	0.05
334	000977	浪潮信息	3,300	120,021.00	0.05
335	600529	山东药玻	4,700	119,098.00	0.05
336	688409	富创精密	3,203	118,318.82	0.05
337	300194	福安药业	31,400	117,436.00	0.05
338	600690	海尔智家	4,100	116,358.00	0.04
339	002151	北斗星通	4,800	116,064.00	0.04
340	601117	中国化学	14,000	115,360.00	0.04
341	000933	神火股份	5,700	115,311.00	0.04
342	601916	浙商银行	41,100	113,436.00	0.04
343	600866	星湖科技	20,400	112,608.00	0.04
344	688019	安集科技	890	111,962.00	0.04
345	600298	安琪酵母	3,900	108,927.00	0.04
346	603486	科沃斯	2,300	108,514.00	0.04
347	003000	劲仔食品	8,900	107,245.00	0.04

348	600764	中国海防	5,400	106,002.00	0.04
349	603589	口子窖	2,700	105,813.00	0.04
350	603995	甬金股份	5,900	103,368.00	0.04
351	300896	爱美客	600	103,260.00	0.04
352	002430	杭氧股份	4,600	102,350.00	0.04
353	000883	湖北能源	16,700	100,367.00	0.04
354	600021	上海电力	10,000	98,900.00	0.04
355	603365	水星家纺	6,300	98,595.00	0.04
356	600048	保利发展	11,100	97,236.00	0.04
357	300596	利安隆	3,400	92,242.00	0.04
358	000893	亚钾国际	5,700	92,112.00	0.04
359	601208	东材科技	12,500	90,750.00	0.04
360	300435	中泰股份	7,600	89,452.00	0.03
361	603737	三棵树	2,400	87,048.00	0.03
362	002244	滨江集团	11,300	82,038.00	0.03
363	06862	海底捞	6,000	76,884.16	0.03
364	603725	天安新材	10,880	67,564.80	0.03
365	300253	卫宁健康	7,400	43,660.00	0.02
366	002847	盐津铺子	900	38,493.00	0.01
367	688472	XD阿特斯	3,514	35,772.52	0.01
368	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
369	688692	达梦数据	102	17,842.86	0.01
370	300573	兴齐眼药	100	16,400.00	0.01
371	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01
372	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
373	688617	惠泰医疗	29	13,226.90	0.01
374	301580	爱迪特	170	11,208.10	0.00
375	688709	成都华微	572	10,747.88	0.00
376	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
377	00772	阅文集团	400	9,181.56	0.00
378	02099	中国黄金国际	200	9,145.05	0.00
379	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
380	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
381	301277	新天地	619	8,034.62	0.00
382	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
383	601033	永兴股份	455	7,261.80	0.00
384	688584	上海合晶	457	7,261.73	0.00
385	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
386	301367	怡和嘉业	100	6,220.00	0.00
387	603341	龙旗科技	158	5,923.42	0.00
388	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
389	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
390	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00

391	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
392	688800	瑞可达	176	4,942.08	0.00
393	301293	三博脑科	120	4,522.80	0.00
394	02382	舜宇光学科技	100	4,403.68	0.00
395	688520	神州细胞	100	3,935.00	0.00
396	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
397	603325	博隆技术	55	3,743.30	0.00
398	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
399	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
400	603381	永臻股份	119	2,990.47	0.00
401	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
402	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
403	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
404	300926	博俊科技	130	2,602.60	0.00
405	002728	特一药业	56	434.00	0.00
406	688187	时代电气	8	395.04	0.00
407	603878	武进不锈	52	340.08	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	01024	快手-W	7,300,689.93	2.07
2	01211	比亚迪股份	4,579,641.81	1.30
2	002594	比亚迪	2,249,481.00	0.64
3	000568	泸州老窖	6,666,563.00	1.89
4	002371	北方华创	5,635,322.00	1.60
5	000651	格力电器	5,114,568.00	1.45
6	03690	美团-W	5,106,802.63	1.45
7	002463	沪电股份	5,067,815.00	1.44
8	601398	工商银行	2,898,965.00	0.82
8	01398	工商银行	1,715,829.59	0.49
9	688617	惠泰医疗	4,560,708.75	1.29
10	300413	芒果超媒	4,559,262.00	1.29
11	601939	建设银行	3,240,227.00	0.92
11	00939	建设银行	1,130,308.67	0.32
12	601288	农业银行	2,610,140.00	0.74
12	01288	农业银行	1,428,625.27	0.41
13	601328	交通银行	2,870,584.00	0.82
13	03328	交通银行	1,134,326.06	0.32
14	01810	小米集团-W	3,951,662.40	1.12
15	06862	海底捞	3,908,700.73	1.11
16	600123	兰花科创	3,803,929.30	1.08

17	688012	中微公司	3,749,613.75	1.06
18	688072	拓荆科技	3,713,722.63	1.05
19	603338	浙江鼎力	3,580,222.00	1.02
20	300729	乐歌股份	3,560,456.00	1.01

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01024	快手-W	8,796,863.31	2.50
2	600039	四川路桥	5,326,928.00	1.51
3	603516	淳中科技	5,125,862.00	1.46
4	03993	洛阳钼业	3,992,524.05	1.13
4	603993	洛阳钼业	752,083.00	0.21
5	688617	惠泰医疗	4,633,164.03	1.32
6	03690	美团-W	4,500,210.68	1.28
7	000568	泸州老窖	4,475,047.00	1.27
8	688072	拓荆科技	4,388,848.55	1.25
9	000932	华菱钢铁	4,246,763.00	1.21
10	601088	中国神华	4,137,641.00	1.17
11	600755	厦门国贸	4,102,159.00	1.16
12	601398	工商银行	3,320,812.00	0.94
12	01398	工商银行	753,352.31	0.21
13	688012	中微公司	4,040,911.74	1.15
14	600674	川投能源	4,023,683.36	1.14
15	06862	海底捞	3,917,289.54	1.11
16	600123	兰花科创	3,787,447.00	1.08
17	601288	农业银行	3,109,631.00	0.88
17	01288	农业银行	534,017.02	0.15
18	002463	沪电股份	3,576,513.60	1.02
19	601328	交通银行	3,057,817.00	0.87
19	03328	交通银行	470,493.13	0.13
20	601009	南京银行	3,516,352.49	1.00

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

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	1,205,821,832.91
卖出股票收入（成交）总额	1,281,136,424.45

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	2,437,476.16	0.94
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	2,437,476.16	0.94

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	019709	23 国债 16	24,000	2,437,476.16	0.94

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，安徽迎驾贡酒股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到英山县市场监管局的处罚。

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	484,473.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	232,178.42
4	应收利息	-
5	应收申购款	208,288.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	924,940.15

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧量化 动力混合 A	4,218	35,703.12	1,037,290.81	0.69%	149,558,486.73	99.31%
中欧量化 动力混合 C	3,701	46,811.30	5,649,498.42	3.26%	167,599,116.76	96.74%
合计	7,919	40,894.61	6,686,789.23	2.06%	317,157,603.49	97.94%

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	中欧量化动力混合 A	1,113,913.13	0.74%
	中欧量化动力混合 C	0.00	0.00%
	合计	1,113,913.13	0.34%

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	中欧量化动力混合 A	>100
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧量化动力混合 A	>100
	中欧量化动力混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧量化动力混合 A	中欧量化动力混合 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 2 日) 基金份额总额	115,946,789.67	208,122,307.00
本报告期期初基金份 额总额	193,727,270.60	210,447,252.74
本报告期基金总申购 份额	5,439,771.00	44,998,641.03
减：本报告期基金总	48,571,264.06	82,197,278.59

赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	150,595,777.54	173,248,615.18

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

本报告期内，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

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	904,124,744.01	36.37	478,552.44	36.55	-
海通证券	3	855,103,804.17	34.40	452,560.17	34.56	-
方正证券	3	726,390,333.40	29.22	378,358.25	28.89	-

注：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、研究能力的基础上，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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注：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、研究能力的基础上，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	中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	中欧量化动力混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧量化动力混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧量化动力混合型证券投资基金更	中国证监会指定媒介	2024-06-15

	新招募说明书（2024 年 6 月）		
8	中欧量化动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-25

§ 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、中欧量化动力混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化动力混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化动力混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化动力混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、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

2024 年 8 月 31 日