

中欧大盘智选混合型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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 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	58
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧大盘智选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中欧大盘智选混合发起	
基金主代码	024446	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 25 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	158,078,907.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧大盘智选混合发起 A	中欧大盘智选混合发起 C
下属分级基金的交易代码	024446	024447
报告期末下属分级基金的份额总额	81,265,264.26 份	76,813,642.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选股票，在力争控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
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	沪深 300 指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+中债综合指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，还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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)	
	中欧大盘智选混合发起 A	中欧大盘智选混合发起 C
本期已实现收益	26,623,586.21	18,155,168.27
本期利润	22,087,047.88	15,708,980.02
加权平均基金份 额本期利润	0.1700	0.1703
本期加权平均净 值利润率	15.24%	15.28%
本期基金份额净 值增长率	13.05%	12.72%
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	13,907,993.85	12,601,641.27
期末可供分配基 金份额利润	0.1711	0.1641
期末基金资产净 值	95,173,258.11	89,415,284.22

期末基金份额净值	1.1711	1.1641
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	17.11%	16.41%

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

中欧大盘智选混合发起 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	9.20%	1.11%	9.08%	1.04%	0.12%	0.07%
过去六个月	13.05%	1.10%	5.43%	0.95%	7.62%	0.15%
过去一年	17.12%	0.83%	20.34%	0.85%	-3.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.11%	0.82%	21.09%	0.85%	-3.98%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*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。

中欧大盘智选混合发起 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	9.05%	1.11%	9.08%	1.04%	-0.03%	0.07%
过去六个月	12.72%	1.10%	5.43%	0.95%	7.29%	0.15%
过去一年	16.43%	0.83%	20.34%	0.85%	-3.91%	-0.02%

自基金合同生效起 至今	16.41%	0.82%	21.09%	0.85%	-4.68%	-0.03%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*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

中欧大盘智选混合发起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



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 6 月 25 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧大盘智选混合发起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



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 6 月 25 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

§ 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		
沈悦	基金经理	2025-06-25	—	11 年	历任中国建设银行天津市开发分行管培生。2015-05-20 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员、投资助理。

赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2025-06-25	-	4 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
汤旻玮	基金经理	2025-12-09	-	5 年	历任银联智策顾问（上海）有限公司另类数据投资研究部负责人，上海艾悉私募基金管理有限公司量化研究总监、投资经理。2025-04-21 加入中欧基金管理有限公司。
徐熙宁	基金经理 / 基金经理助理	2026-03-09	-	3 年	2022-07-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理；徐熙宁担任本基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年市场较为分化，除红利指数与上证 50 呈现调整，其余各宽基指数均迎来不同程度的上涨，其中上证指数和沪深 300 指数仅个位数上涨；中证 500 指数、中证 1000 指数均有双位数涨幅，创业板指则录得超过 30% 的涨幅。

从风格来看，上半年成长风格全面大幅跑赢价值风格，且分化极为显著。申万高市净率指数涨幅近 60%，申万高市盈率指数涨幅也超过 30%，而申万低市净率指数与申万低市盈率指数均有超过 10% 的调整。大盘成长与小盘成长均录得双位数上涨，对应的大盘价值与小盘价值则全面调整。

从市场整体来看，2026 年上半年呈现 M 型走势。市场在一季度经历了国际形势的影响产生较明显的调整，二季度在科技产业的带动下，市场情绪得到快速修复，风险偏好进一步提升。从行业板块来看，上半年电子、通信及相关科技产业链行业有明显上涨，其他传统行业均呈不同程度的调整，市场短期对科技成长板块表现的非常乐观，同时对传统行业表现出显著悲观。

我们的组合整体布局在大市值企业，且持续高位运行，采用相对基准行业中性的策略，分散持股，结合量化策略，控制行业和风格的偏离程度，力求通过个股选择在不同市场环境中持续获取稳健的超额收益。上半年组合策略稳定，非银金融、有色金属、国防军工、石油石化等板块提供了正向贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 13.05%，同期业绩比较基准收益率为 5.43%；基金 C 类份额净值增长率为 12.72%，同期业绩比较基准收益率为 5.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场从 2024 年 9 月上涨以来，整体的估值水平持续抬升，且结构分化进一步加剧，部分市场板块已走出低估区域，个别市场板块估值快速扩张，已进入历史高位区域，但由于市场分化明显，低估值个股数量还在增加，目前全市场 PE（TTM）估值低于 30 倍的个股数量有近 1400 只，低于 20 倍的也接近 800 只，仍有充足的低估值品种可供发掘选择。

上半年国内外环境复杂多变，但经济基本面整体延续了企稳向好的态势。二季度制造业 PMI 处于持续温和扩张区间，CPI 温和回升至 1% 附近，PPI 受海外冲突推升油价及大宗商品涨价传导影响，从年初的 -1.4% 大幅转正至 6 月的 +4.1%。虽然制造业投资与基建投资均呈现高开低走的谨慎趋势，工业增加值增速有所放缓，但工业企业利润在二季度显著增长。随着中美经贸团队的磋商共识，外贸环境边际改善，二季度出口数据进一步加速。随着经济周期的调整，机械、化工等陆续进入供给出清阶段的行业在需求企稳的情况下开始缓和，经济逐步企稳后，基础民生消费和

情绪价值型消费等领域的投资机会也在逐步显现。

总的来说，当前市场估值分化加剧，传统价值板块估值仍在低位区间。随着各项政策的实施，经济以及企业的盈利企稳回升趋势已较为明确，即使国内外已经发生的变化及未来的潜在变化引发了较大的阶段性市场波动以及不同板块的分化表现，从较长时期的角度来看，我们对我国资本市场稳健资产的长期表现持乐观预期。

当前全球正处于可远程输送按需调用的通用算力载体技术变革早期，新技术标准竞逐，基建狂飙，如同 19 世纪末 20 世纪初的电气革命，可远程输送按需调用的通用能源。在科技周期进程中，时代科技核心最先获得丰厚利润，随之上中游产业链因有限的现存产能与快速扩张的需求缺口而迅速火热直至产能过剩，公共事业层则会出现依靠规模形成护城河的企业获得持久稳定的现金流，而最大的社会价值兑现，则是在新科技进入低成本时代后对既有生产与生活的重构。在此时期，或选择技术变革的新型产业，或选择稳定穿越周期静待技术赋能的稳健资产，全球新一轮技术革命的参与者与进展正逐步夯实本国未来稳健资产的乐观预期。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 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：中欧大盘智选混合型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	13,471,945.17	34,241,192.79
结算备付金		59,081.69	2,056,111.14
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	172,223,067.86	425,044,498.47
其中：股票投资		172,223,067.86	425,044,498.47
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		20,020.12	2,496,147.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		185,774,114.84	463,837,950.19
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		46,398.64	5,554,098.82
应付管理人报酬		155,308.51	555,469.11
应付托管费		32,158.77	80,812.43
应付销售服务费		44,721.84	66,917.59
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	906,984.75	1,122,803.19
负债合计		1,185,572.51	7,380,101.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	158,078,907.21	441,133,766.93
未分配利润	6.4.7.8	26,509,635.12	15,324,082.12
净资产合计		184,588,542.33	456,457,849.05
负债和净资产总计		185,774,114.84	463,837,950.19

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 158,078,907.21 份，其中 A 类基金份额净值（暂估超额管理费前）1.1711 元，基金份额总额 81,265,264.26 份；暂估超额管理费前，基金资产净值为 95,173,258.11 元；暂估超额管理费金额 0 元，考虑暂估超额管理费后，基金资产净值为 95,173,258.11 元。C 类基金份额净值（暂估超额管理费前）1.1641 元，基金份额总额 76,813,642.95 份，暂估超额管理费前，基金资产净值为 89,415,284.22 元，暂估超额管理费金

额 0 元，考虑暂估超额管理费后，基金资产净值为 89,415,284.22 元。暂估超额管理费为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提超额管理费前）清算，按照符合基金合同约定估算的超额管理费，实际计提时的超额管理费金额可能会与此处暂估超额管理费金额有差异。该金额是各基金份额持有人的暂估超额管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的超额管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

6.2 利润表

会计主体：中欧大盘智选混合型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 6 月 25 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		39,891,699.23	78,220.19
1. 利息收入		7,714.06	59,795.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,714.06	32,373.05
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		—	27,422.43
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		46,537,794.09	7,456.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	44,467,657.14	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.11	—	7,456.71
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	2,070,136.95	—
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,982,726.58	10,968.00
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	328, 917. 66	-
减：二、营业总支出		2, 095, 671. 33	200, 678. 09
1. 管理人报酬		1, 721, 891. 72	73, 060. 08
2. 托管费		248, 630. 05	24, 353. 36
3. 销售服务费		308, 288. 86	25, 450. 77
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		-	0. 46
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	-183, 139. 30	77, 813. 42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37, 796, 027. 90	-122, 457. 90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37, 796, 027. 90	-122, 457. 90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37, 796, 027. 90	-122, 457. 90

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧大盘智选混合型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	441, 133, 766. 93	-	15, 324, 082. 12	456, 457, 849. 05
二、本期期初净资产	441, 133, 766. 93	-	15, 324, 082. 12	456, 457, 849. 05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-283, 054, 859. 7 2	-	11, 185, 553. 00	-271, 869, 306. 72
（一）、综合收益总额	-	-	37, 796, 027. 90	37, 796, 027. 90
（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）	-283, 054, 859. 7 2	-	-26, 610, 474. 90	-309, 665, 334. 62

其中：1. 基金申购款	66,404,224.36	-	5,322,652.74	71,726,877.10
2. 基金赎回款	-349,459,084.08	-	-31,933,127.64	-381,392,211.72
（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	158,078,907.21	-	26,509,635.12	184,588,542.33
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	888,949,426.95	-	-	888,949,426.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-122,457.90	-122,457.90
（一）、综合收益总额	-	-	-122,457.90	-122,457.90
（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）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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	888,949,426.95	-	-122,457.90	888,826,969.05

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

中欧大盘智选混合型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[2025]1093号《关于准予中欧大盘智选混合型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《中欧大盘智选混合型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 888,558,084.97 元,经向中国证监会备案,《中欧大盘智选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 888,949,426.95 份基金份额,其中包含认购资金利息折合 391,341.98 份基金份额。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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财税[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》、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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复缴纳增值税;取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、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. 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,暂不计缴企业所得税。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	37,136.29
等于：本金	37,118.23
加：应计利息	18.06
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	13,434,808.88
等于：本金	13,434,628.49
加：应计利息	180.39
减：坏账准备	—
合计	13,471,945.17

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 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	177,066,957.53	-	172,223,067.86	-4,843,889.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	177,066,957.53	-	172,223,067.86	-4,843,889.67

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	0.62
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	17,852.03

其他应付	20,032.10
应付或有管理费	809,592.63
合计	906,984.75

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧大盘智选混合发起 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	283,572,141.14	283,572,141.14
本期申购	9,723,008.34	9,723,008.34
本期赎回（以“-”号填列）	-212,029,885.22	-212,029,885.22
本期末	81,265,264.26	81,265,264.26

中欧大盘智选混合发起 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	157,561,625.79	157,561,625.79
本期申购	56,681,216.02	56,681,216.02
本期赎回（以“-”号填列）	-137,429,198.86	-137,429,198.86
本期末	76,813,642.95	76,813,642.95

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

中欧大盘智选混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,974,503.42	201,420.93	10,175,924.35
本期期初	9,974,503.42	201,420.93	10,175,924.35
本期利润	26,623,586.21	-4,536,538.33	22,087,047.88
本期基金份额交易产生的变动数	-18,570,387.09	215,408.71	-18,354,978.38
其中：基金申购款	956,863.61	-41,401.99	915,461.62
基金赎回款	-19,527,250.70	256,810.70	-19,270,440.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,027,702.54	-4,119,708.69	13,907,993.85

中欧大盘智选混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,037,275.51	110,882.26	5,148,157.77
本期期初	5,037,275.51	110,882.26	5,148,157.77
本期利润	18,155,168.27	-2,446,188.25	15,708,980.02
本期基金份额交易产生的变动数	-6,714,661.03	-1,540,835.49	-8,255,496.52

其中：基金申购款	5,375,794.70	-968,603.58	4,407,191.12
基金赎回款	-12,090,455.73	-572,231.91	-12,662,687.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,477,782.75	-3,876,141.48	12,601,641.27

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	634.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,108.61
结算备付金利息收入	2,970.55
其他	-
合计	7,714.06

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	1,659,723,121.35
减：卖出股票成本总额	1,613,820,219.86
减：交易费用	1,435,244.35
买卖股票差价收入	44,467,657.14

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	2,070,136.95
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	2,070,136.95

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	-6,982,726.58
股票投资	-6,982,726.58
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-6,982,726.58

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	328,600.65
基金转换费收入	317.01
合计	328,917.66

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	17,852.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	5,707.61
账户维护费	9,000.00
或有管理费	-275,206.31
合计	-183,139.30

注：当满足本基金合同规定的特定条件时，或有管理费将返还给投资者或确认为应由管理人收取的管理费，该金额可能因期间结转的金额大于本期计提金额而列报为负数。

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
中国工商银行股份有限公司	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 6 月 25 日（基金合 同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,721,891.72	73,060.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	538,119.59	5,632.12
应支付基金管理人的净管理费	1,183,772.13	67,427.96

注：根据本基金合同，支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费包含固定管理费、或有管理费和超额管理费。

(1) 固定管理费

支付基金管理人中欧基金的管理人报酬按前一日 基金资产净值 0.60%的年费率计提。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

固定管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核 对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(2) 或有管理费和超额管理费

本基金根据每一基金份额的持有期限与持有期间年化收益率确定或有管理费和超额管理费。

当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，持有期限不足一年(即 365 天，下同)，则按 1.20%年费率收取管理费；

持有期限达到一年及以上，则根据持有期间年化收益率分为以下三种情况，分别确定对应的管理费率档位：

若持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率(扣除超额管理费后)超过 6%且持有收益率(扣除超额管理费后)为正，按 1.50%年费率确认管理费；若持有期间的年化超额收益率在-3%及以下，按 0.60%年费率确认管理费；其他情形按 1.20%年费率确认管理费。

对于已经确认为管理人收入的或有管理费和超额管理费，由基金托管人根据与基金管理人核

对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	248,630.05	24,353.36

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	中欧大盘智选混合发起 A	中欧大盘智选混合发起 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	63,202.52	63,202.52
中欧财富	0.00	120.52	120.52
中欧基金	0.00	67,226.39	67,226.39
合计	0.00	130,549.43	130,549.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中欧大盘智选混合发起 A	中欧大盘智选混合发起 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	6,896.71	6,896.71
中欧财富	0.00	0.15	0.15
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	6,896.86	6,896.86

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

计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 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

中欧大盘智选混合发起 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 6 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日 (2025 年 6 月 25 日)	-	10,008,750.88

持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	10,008,750.88	—
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,008,750.88	10,008,750.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.32%	1.73%

- 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。

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

中欧大盘智选混合发起 C

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	10.01	0.00%	10.01	0.00%

- 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。

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 6 月 25 日（基金合同生效日）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
中国工商银行股份有限公司	37,136.29	634.90	128,575,942.04	19,263.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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	101	5,379.26	5,932.74	-
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	6,398	64,683.78	64,683.78	-
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	2,741	27,711.51	27,711.51	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,014	7,929.48	21,030.36	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	94	1,727.72	1,577.32	-
001365	天	2026	6 个月	新股	27.19	31.31	249	6,770.31	7,796.19	-

	海电子	年 5 月 11 日		流通受限						
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	175	5,316.50	6,823.25	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,051	10,636.12	29,144.23	-
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	281	3,737.30	14,488.36	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	309	4,298.19	10,033.23	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	384	17,694.72	177,918.72	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	435	3,079.80	12,354.00	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	86	4,988.00	9,645.76	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	233	16,230.78	37,293.98	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	56	4,389.28	6,819.12	-
301687	新	2025	6 个月	新股	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

	广益	年 12 月 24 日		流通受限						
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	303	3,387.54	5,329.77	-
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	47	1,574.03	1,594.71	-
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	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,283	22,478.16	46,085.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	469	10,636.92	22,329.09	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	88	8,111.84	40,757.20	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	81	3,609.36	37,962.27	-
688808	联	2026	6 个月	新股	81.88	1,584.33	61	4,994.68	96,644.13	-

	讯 仪 器	年 4 月 16 日		流通 受限						
688811	有研 复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	6.41	24.13	726	4,653.66	17,518.38	-
688813	泰金 新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.09	185	4,861.80	31,836.65	-
688816	易思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	55.95	57.10	119	6,658.05	6,794.90	-
688818	电科 蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	9.47	70.14	871	8,248.37	61,091.94	-
688820	盛合 晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	19.68	141.49	373	7,340.64	52,775.77	-

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 07 月 13 日	890.99	400	260,950.00	351,812.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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	13,471,945.17	-	-	-	13,471,945.17
结算备付金	59,081.69	-	-	-	59,081.69
交易性金融资产	-	-	-	172,223,067.86	172,223,067.86
应收申购款	-	-	-	20,020.12	20,020.12
资产总计	13,531,026.86	-	-	172,243,087.98	185,774,114.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	46,398.64	46,398.64
应付管理人报酬	-	-	-	155,308.51	155,308.51
应付托管费	-	-	-	32,158.77	32,158.77
应付销售服务费	-	-	-	44,721.84	44,721.84
其他负债	-	-	-	906,984.75	906,984.75
负债总计	-	-	-	1,185,572.51	1,185,572.51
利率敏感度缺口	13,531,026.86	-	-	171,057,515.47	184,588,542.33
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	34,241,192.79	-	-	-	34,241,192.79
结算备付金	2,056,111.14	-	-	-	2,056,111.14
交易性金融资产	-	-	-	425,044,498.47	425,044,498.47
应收申购款	-	-	-	2,496,147.79	2,496,147.79
资产总计	36,297,303.93	-	-	427,540,646.26	463,837,950.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,554,098.82	5,554,098.82
应付管理人报酬	-	-	-	555,469.11	555,469.11

应付托管费	-	-	80,812.43	80,812.43
应付销售服务费	-	-	66,917.59	66,917.59
其他负债	-	-	1,122,803.19	1,122,803.19
负债总计	-	-	7,380,101.14	7,380,101.14
利率敏感度缺口	36,297,303.93	-	-420,160,545.12	456,457,849.05

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 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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	172,223,067.86	93.30	425,044,498.47	93.12
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	172, 223, 067. 86	93. 30	425, 044, 498. 47	93. 12

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%	10, 047, 782. 42	9, 727, 307. 49
	业绩比较基准下降 5%	-10, 047, 782. 42	-9, 727, 307. 49

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	170, 974, 115. 98	423, 356, 564. 21
第二层次	444, 207. 29	726, 425. 60
第三层次	804, 744. 59	961, 508. 66
合计	172, 223, 067. 86	425, 044, 498. 47

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	172,223,067.86	92.71
	其中：股票	172,223,067.86	92.71
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	13,531,026.86	7.28
8	其他各项资产	20,020.12	0.01
9	合计	185,774,114.84	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	126,380.00	0.07
B	采矿业	7,608,849.16	4.12
C	制造业	96,179,801.42	52.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,756,286.29	4.20
E	建筑业	1,582,207.00	0.86
F	批发和零售业	3,585,983.80	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	5,433,903.46	2.94
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,358,002.05	2.90
J	金融业	36,901,266.20	19.99
K	房地产业	832,685.00	0.45
L	租赁和商务服务业	997,559.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	1,907,406.64	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,278,349.84	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	155,000.00	0.08
P	教育	447,984.00	0.24
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,836,344.00	0.99
S	综合	235,060.00	0.13
	合计	172,223,067.86	93.30

7.2.2 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

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	600036	招商银行	133,200	4,728,600.00	2.56
2	300308	中际旭创	3,700	4,699,000.00	2.55
3	600030	中信证券	159,300	4,576,689.00	2.48
4	601166	兴业银行	274,100	4,539,096.00	2.46
5	601688	华泰证券	178,900	3,688,918.00	2.00
6	600999	招商证券	164,400	3,468,840.00	1.88
7	601229	上海银行	380,900	3,306,212.00	1.79
8	600025	华能水电	339,100	3,014,599.00	1.63
9	300750	宁德时代	7,200	2,829,672.00	1.53

10	600000	浦发银行	317,300	2,731,953.00	1.48
11	300502	新易盛	4,500	2,731,500.00	1.48
12	000776	广发证券	93,500	2,187,900.00	1.19
13	600926	杭州银行	144,600	2,089,470.00	1.13
14	600900	长江电力	66,400	1,757,608.00	0.95
15	600519	贵州茅台	1,300	1,541,137.00	0.83
16	688256	寒武纪	903	1,440,781.65	0.78
17	600183	生益科技	8,200	1,421,880.00	0.77
18	603986	兆易创新	1,700	1,385,500.00	0.75
19	601919	中远海控	99,300	1,316,718.00	0.71
20	601211	国泰海通	71,400	1,299,480.00	0.70
21	600968	海油发展	373,900	1,245,087.00	0.67
22	300408	三环集团	7,100	1,184,990.00	0.64
23	600276	恒瑞医药	21,500	1,118,860.00	0.61
24	002049	紫光国微	12,500	1,109,375.00	0.60
25	688041	海光信息	2,867	1,061,650.10	0.58
26	002384	东山精密	3,900	1,023,165.00	0.55
27	300458	全志科技	25,100	990,446.00	0.54
28	600919	江苏银行	91,290	984,106.20	0.53
29	000983	山西焦煤	155,000	899,000.00	0.49
30	688981	中芯国际	5,297	841,269.54	0.46
31	000921	海信家电	30,600	835,992.00	0.45
32	603259	药明康德	6,700	834,217.00	0.45
33	002415	海康威视	24,000	820,800.00	0.44
34	600925	苏能股份	199,900	801,599.00	0.43
35	300274	阳光电源	5,000	795,100.00	0.43
36	688012	中微公司	1,690	791,765.00	0.43
37	601066	中信建投	27,000	784,890.00	0.43
38	002475	立讯精密	11,100	781,440.00	0.42
39	688008	澜起科技	2,477	767,622.30	0.42
40	000100	TCL 科技	130,700	760,674.00	0.41
41	002916	深南电路	1,600	732,640.00	0.40
42	301536	星宸科技	5,600	720,776.00	0.39
43	601985	中国核电	79,700	719,691.00	0.39
44	002371	北方华创	800	707,648.00	0.38
45	601899	紫金矿业	27,100	681,294.00	0.37
46	002028	思源电气	3,900	674,700.00	0.37
47	000425	徐工机械	80,800	653,672.00	0.35
48	600690	海尔智家	31,900	651,079.00	0.35
49	000657	中钨高新	6,800	650,896.00	0.35
50	300033	同花顺	2,680	645,880.00	0.35
51	603939	益丰药房	35,500	638,290.00	0.35
52	601138	工业富联	8,800	634,920.00	0.34

53	301108	洁雅股份	25,900	610,981.00	0.33
54	000878	云南铜业	38,100	605,028.00	0.33
55	000831	中国稀土	10,800	599,292.00	0.32
56	300476	胜宏科技	1,700	588,931.00	0.32
57	002064	华峰化学	61,300	581,737.00	0.32
58	600711	盛屯矿业	52,800	579,216.00	0.31
59	002600	领益智造	32,700	567,018.00	0.31
60	002130	沃尔核材	29,900	566,904.00	0.31
61	300014	亿纬锂能	8,700	565,761.00	0.31
62	600362	江西铜业	13,000	562,900.00	0.30
63	601816	京沪高铁	124,100	562,173.00	0.30
64	002601	龙佰集团	33,100	545,488.00	0.30
65	600176	中国巨石	7,400	539,312.00	0.29
66	600563	法拉电子	2,800	534,240.00	0.29
67	601111	中国国航	87,400	528,770.00	0.29
68	688668	鼎通科技	1,366	509,927.80	0.28
69	600498	烽火通信	6,800	500,480.00	0.27
70	600688	上海石化	170,100	498,393.00	0.27
71	600489	中金黄金	27,600	498,180.00	0.27
72	601598	中国外运	98,800	490,048.00	0.27
73	300748	金力永磁	15,600	481,260.00	0.26
74	600029	南方航空	92,900	481,222.00	0.26
75	601988	中国银行	81,800	467,896.00	0.25
76	000625	长安汽车	64,900	465,333.00	0.25
77	601600	中国铝业	56,100	461,142.00	0.25
78	600801	华新建材	29,500	460,200.00	0.25
79	300418	昆仑万维	11,400	460,104.00	0.25
80	002463	沪电股份	3,000	458,400.00	0.25
81	601799	星宇股份	5,000	453,100.00	0.25
82	301611	珂玛科技	2,500	450,175.00	0.24
83	600455	博通股份	20,400	447,984.00	0.24
84	601336	新华保险	7,500	447,450.00	0.24
85	600356	恒丰纸业	58,500	433,485.00	0.23
86	000725	京东方 A	49,900	433,132.00	0.23
87	601872	招商轮船	24,000	421,680.00	0.23
88	300570	太辰光	1,700	419,407.00	0.23
89	603993	洛阳钼业	23,800	417,690.00	0.23
90	300017	网宿科技	32,100	417,621.00	0.23
91	000651	格力电器	11,100	416,250.00	0.23
92	688469	芯联集成	38,837	412,060.57	0.22
93	002716	湖南白银	50,400	407,736.00	0.22
94	603766	隆鑫通用	34,100	406,813.00	0.22
95	688617	惠泰医疗	2,200	399,432.00	0.22

96	002014	永新股份	37,800	399,168.00	0.22
97	002436	兴森科技	7,800	397,410.00	0.22
98	002353	杰瑞股份	2,600	396,500.00	0.21
99	002913	奥士康	6,200	396,428.00	0.21
100	688582	芯动联科	6,023	391,495.00	0.21
101	600886	国投电力	29,300	389,983.00	0.21
102	601865	福莱特	37,100	389,921.00	0.21
103	000550	江铃汽车	23,900	387,658.00	0.21
104	301297	富乐德	6,300	385,812.00	0.21
105	601000	唐山港	92,500	383,875.00	0.21
106	600392	盛和资源	12,800	381,056.00	0.21
107	601156	东航物流	23,400	377,208.00	0.20
108	002545	东方铁塔	23,100	374,682.00	0.20
109	002414	高德红外	28,200	373,932.00	0.20
110	000513	丽珠集团	12,900	372,681.00	0.20
111	600694	大商股份	28,060	371,233.80	0.20
112	601696	中银证券	29,300	370,645.00	0.20
113	600210	紫江企业	59,700	370,140.00	0.20
114	002518	科士达	6,900	369,771.00	0.20
115	688329	艾隆科技	18,248	368,792.08	0.20
116	600588	用友网络	40,000	367,200.00	0.20
117	603233	大参林	24,300	365,229.00	0.20
118	600741	华域汽车	23,500	364,720.00	0.20
119	000568	泸州老窖	4,700	364,344.00	0.20
120	002884	凌霄泵业	23,800	362,712.00	0.20
121	000333	美的集团	4,800	362,544.00	0.20
122	601886	江河集团	45,100	362,153.00	0.20
123	603999	读者传媒	72,400	362,000.00	0.20
124	600987	航民股份	59,800	361,790.00	0.20
125	300548	长芯博创	1,300	361,400.00	0.20
126	002948	青岛银行	70,900	360,172.00	0.20
127	601766	中国中车	69,200	359,840.00	0.19
128	000708	中信特钢	28,400	358,408.00	0.19
129	000848	承德露露	48,400	358,160.00	0.19
130	601518	吉林高速	127,700	357,560.00	0.19
131	002563	森马服饰	70,900	357,336.00	0.19
132	600398	海澜之家	68,100	356,163.00	0.19
133	688072	拓荆科技	400	351,812.00	0.19
134	600662	外服控股	87,100	351,013.00	0.19
135	600742	富维股份	48,400	350,416.00	0.19
136	603225	新凤鸣	17,800	349,770.00	0.19
137	601900	南方传媒	32,200	349,692.00	0.19
138	601098	中南传媒	35,500	349,320.00	0.19

139	600323	瀚蓝环境	12,700	348,742.00	0.19
140	000858	五 粮 液	4,700	347,800.00	0.19
141	600612	老凤祥	10,800	347,220.00	0.19
142	603920	世运电路	7,200	345,888.00	0.19
143	600941	中国移动	4,000	344,520.00	0.19
144	000719	中原传媒	30,000	342,900.00	0.19
145	605218	伟时电子	20,700	342,171.00	0.19
146	600549	厦门钨业	4,000	340,800.00	0.18
147	002749	国光股份	42,400	338,352.00	0.18
148	601106	中国一重	102,300	337,590.00	0.18
149	300454	深信服	3,500	336,700.00	0.18
150	601686	友发集团	69,400	335,202.00	0.18
151	600861	北京人力	27,400	334,280.00	0.18
152	301205	联特科技	1,000	334,100.00	0.18
153	601811	新华文轩	30,500	333,670.00	0.18
154	002327	富安娜	56,100	333,234.00	0.18
155	603551	奥普科技	36,700	329,933.00	0.18
156	600970	中材国际	46,200	329,406.00	0.18
157	002911	佛燃能源	34,500	327,405.00	0.18
158	688521	芯原股份	869	322,520.66	0.17
159	600348	华阳股份	42,100	322,065.00	0.17
160	600803	新奥股份	20,300	320,740.00	0.17
161	601857	中国石油	36,900	320,292.00	0.17
162	002179	中航光电	6,800	314,160.00	0.17
163	605266	健之佳	21,200	310,368.00	0.17
164	300857	协创数据	900	305,910.00	0.17
165	600132	重庆啤酒	7,400	305,620.00	0.17
166	001979	招商蛇口	47,500	305,425.00	0.17
167	002078	太阳纸业	24,400	304,756.00	0.17
168	600893	航发动力	7,900	302,886.00	0.16
169	603929	亚翔集成	1,100	299,222.00	0.16
170	000962	东方钨业	3,300	298,980.00	0.16
171	300972	万辰集团	1,700	294,797.00	0.16
172	002602	世纪华通	20,900	294,690.00	0.16
173	300136	信维通信	2,400	286,200.00	0.16
174	600703	三安光电	13,400	284,348.00	0.15
175	300939	秋田微	4,100	283,720.00	0.15
176	601069	西部黄金	12,800	281,600.00	0.15
177	600601	方正科技	20,300	280,952.00	0.15
178	003042	中农联合	23,100	280,665.00	0.15
179	002273	水晶光电	7,900	280,292.00	0.15
180	002155	湖南黄金	11,700	279,279.00	0.15
181	301176	逸豪新材	4,100	278,800.00	0.15

182	688728	格科微	13,247	278,716.88	0.15
183	603519	立霸股份	18,100	276,930.00	0.15
184	300870	欧陆通	800	276,552.00	0.15
185	300394	天孚通信	900	272,412.00	0.15
186	000811	冰轮环境	4,800	269,856.00	0.15
187	300120	经纬辉开	23,800	269,654.00	0.15
188	301099	雅创电子	2,800	267,400.00	0.14
189	000338	潍柴动力	9,800	267,050.00	0.14
190	300615	欣天科技	26,500	265,795.00	0.14
191	002885	京泉华	6,500	265,590.00	0.14
192	600259	中稀有色	2,600	264,186.00	0.14
193	600299	安迪苏	33,500	262,975.00	0.14
194	688167	炬光科技	735	260,344.35	0.14
195	605180	华生科技	21,900	259,515.00	0.14
196	601058	赛轮轮胎	22,400	258,272.00	0.14
197	601699	潞安环能	17,900	255,612.00	0.14
198	688428	诺诚健华	8,935	254,379.45	0.14
199	002025	航天电器	3,300	251,526.00	0.14
200	000830	鲁西化工	20,900	250,800.00	0.14
201	002245	蔚蓝锂芯	13,272	248,319.12	0.13
202	688183	生益电子	1,865	246,926.00	0.13
203	301177	迪阿股份	8,900	245,373.00	0.13
204	688180	君实生物	7,132	241,204.24	0.13
205	002491	通鼎互联	7,400	239,760.00	0.13
206	605567	春雪食品	29,900	238,901.00	0.13
207	600584	长电科技	2,300	238,165.00	0.13
208	000893	亚钾国际	5,800	237,162.00	0.13
209	600673	东阳光	7,000	235,060.00	0.13
210	600031	三一重工	13,600	235,008.00	0.13
211	603332	苏州龙杰	23,200	234,552.00	0.13
212	300843	胜蓝股份	1,500	234,375.00	0.13
213	688396	华润微	2,395	233,632.25	0.13
214	300620	光库科技	600	226,920.00	0.12
215	002811	郑中设计	20,200	226,038.00	0.12
216	688343	云天励飞	2,767	225,953.22	0.12
217	603341	龙旗科技	5,300	225,197.00	0.12
218	002080	中材科技	2,500	225,000.00	0.12
219	688718	唯赛勃	14,059	224,522.23	0.12
220	600150	中国船舶	6,600	223,014.00	0.12
221	001287	中电港	7,100	221,165.00	0.12
222	002809	红墙股份	29,700	220,968.00	0.12
223	300456	赛微电子	5,200	220,844.00	0.12
224	600352	浙江龙盛	18,200	220,402.00	0.12

225	300124	汇川技术	3,300	218,889.00	0.12
226	002851	麦格米特	1,300	217,334.00	0.12
227	301337	亚华电子	7,800	216,840.00	0.12
228	601666	平煤股份	30,300	216,645.00	0.12
229	001260	坤泰股份	13,800	215,970.00	0.12
230	300661	圣邦股份	1,500	215,220.00	0.12
231	688578	艾力斯	1,966	214,687.20	0.12
232	300903	科翔股份	2,100	212,751.00	0.12
233	300803	指南针	2,300	210,841.00	0.11
234	300475	香农芯创	700	210,000.00	0.11
235	688065	凯赛生物	4,347	208,003.95	0.11
236	300655	晶瑞电材	9,700	207,774.00	0.11
237	600487	亨通光电	1,900	207,746.00	0.11
238	002493	荣盛石化	19,300	207,475.00	0.11
239	600282	南钢股份	45,100	207,009.00	0.11
240	301123	奕东电子	1,700	205,224.00	0.11
241	000060	中金岭南	27,100	205,147.00	0.11
242	002364	中恒电气	3,800	204,440.00	0.11
243	000408	藏格矿业	2,900	201,028.00	0.11
244	002422	科伦药业	5,200	200,304.00	0.11
245	600483	福能股份	19,600	199,724.00	0.11
246	000559	万向钱潮	15,400	199,122.00	0.11
247	600377	宁沪高速	17,200	199,004.00	0.11
248	300763	锦浪科技	2,200	198,770.00	0.11
249	300866	安克创新	1,900	198,550.00	0.11
250	600875	东方电气	6,900	198,513.00	0.11
251	603126	中材节能	31,500	198,450.00	0.11
252	002465	海格通信	15,500	197,935.00	0.11
253	600674	川投能源	13,900	196,963.00	0.11
254	603289	泰瑞机器	24,400	196,908.00	0.11
255	300433	蓝思科技	3,600	193,176.00	0.10
256	301626	苏州天脉	500	191,980.00	0.10
257	601117	中国化学	26,100	191,835.00	0.10
258	000155	川能动力	16,000	191,680.00	0.10
259	002513	蓝丰生化	39,600	189,288.00	0.10
260	301486	致尚科技	900	187,488.00	0.10
261	603308	应流股份	3,100	187,240.00	0.10
262	000630	铜陵有色	28,300	179,988.00	0.10
263	600196	复星医药	8,000	179,760.00	0.10
264	301666	大普微	384	177,918.72	0.10
265	002861	瀛通通讯	7,900	176,012.00	0.10
266	002897	意华股份	2,000	175,960.00	0.10
267	600595	中孚实业	31,200	175,344.00	0.09

268	000032	深桑达 A	7,000	174,650.00	0.09
269	002532	天山铝业	16,200	173,826.00	0.09
270	688368	晶丰明源	793	171,700.36	0.09
271	688701	卓锦股份	22,708	170,991.24	0.09
272	603697	有友食品	17,800	170,702.00	0.09
273	300929	华骐环保	16,100	169,694.00	0.09
274	300894	火星号	13,500	169,560.00	0.09
275	600988	赤峰黄金	6,400	168,448.00	0.09
276	300257	开山股份	5,800	166,344.00	0.09
277	600115	中国东航	43,600	166,116.00	0.09
278	000683	博源化工	28,800	165,888.00	0.09
279	603979	金诚信	2,800	165,284.00	0.09
280	600309	万华化学	2,400	164,184.00	0.09
281	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.09
282	002949	华阳国际	16,500	163,185.00	0.09
283	688629	华丰科技	848	159,008.48	0.09
284	603711	香飘飘	14,100	156,651.00	0.08
285	300736	百邦科技	5,000	155,000.00	0.08
286	601127	赛力斯	2,500	153,125.00	0.08
287	603029	天鹄股份	10,700	150,442.00	0.08
288	002993	奥海科技	2,100	150,381.00	0.08
289	600785	新华百货	15,260	149,548.00	0.08
290	002244	滨江集团	19,200	145,920.00	0.08
291	603326	我乐家居	23,600	145,376.00	0.08
292	002715	登云股份	10,900	144,425.00	0.08
293	603379	三美股份	1,900	144,191.00	0.08
294	000807	云铝股份	6,500	143,910.00	0.08
295	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.08
296	003027	同兴科技	8,000	139,440.00	0.08
297	002824	和胜股份	4,000	138,320.00	0.07
298	600345	长江通信	2,100	137,571.00	0.07
299	600847	万里股份	10,100	136,249.00	0.07
300	002998	优彩资源	20,700	134,757.00	0.07
301	001360	南矿集团	7,600	134,444.00	0.07
302	301018	申菱环境	1,160	134,107.60	0.07
303	002648	卫星化学	5,700	133,893.00	0.07
304	603166	福达股份	10,000	133,700.00	0.07
305	002850	科达利	700	132,510.00	0.07
306	002497	雅化集团	6,500	132,405.00	0.07
307	000932	华菱钢铁	38,100	132,207.00	0.07
308	603738	泰晶科技	2,200	132,110.00	0.07
309	688025	杰普特	280	131,600.00	0.07
310	688599	天合光能	9,278	131,005.36	0.07

311	603172	万丰股份	7,900	129,797.00	0.07
312	603331	百达精工	12,100	128,986.00	0.07
313	603083	剑桥科技	500	127,435.00	0.07
314	002432	九安医疗	1,800	127,224.00	0.07
315	003031	中瓷电子	700	126,210.00	0.07
316	000002	万科A	42,400	125,504.00	0.07
317	002888	惠威科技	5,700	125,286.00	0.07
318	600714	金瑞矿业	6,100	125,233.00	0.07
319	002159	三特索道	10,100	124,937.00	0.07
320	300438	鹏辉能源	1,500	124,275.00	0.07
321	600050	中国联通	30,700	122,800.00	0.07
322	300432	富临精工	6,100	122,549.00	0.07
323	600359	新农开发	22,400	120,960.00	0.07
324	603799	华友钴业	2,500	120,650.00	0.07
325	688433	华曙高科	1,408	120,524.80	0.07
326	300724	捷佳伟创	1,700	120,020.00	0.07
327	688331	荣昌生物	917	119,448.42	0.06
328	300795	米奥会展	13,900	118,984.00	0.06
329	000070	特发信息	5,700	118,788.00	0.06
330	002429	兆驰股份	11,400	118,446.00	0.06
331	300961	深水海纳	9,200	118,220.00	0.06
332	002738	中矿资源	2,000	117,980.00	0.06
333	002608	江苏国信	16,800	115,920.00	0.06
334	000509	华塑控股	30,400	113,392.00	0.06
335	301185	鸥玛软件	7,600	112,936.00	0.06
336	301189	奥尼电子	1,900	111,967.00	0.06
337	605388	均瑶健康	23,100	111,573.00	0.06
338	002412	汉森制药	20,200	111,100.00	0.06
339	600515	海南机场	40,300	110,422.00	0.06
340	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.06
341	601579	会稽山	7,500	110,175.00	0.06
342	688367	工大高科	3,270	108,891.00	0.06
343	002345	潮宏基	11,800	108,206.00	0.06
344	300688	创业黑马	3,900	105,690.00	0.06
345	600578	京能电力	16,200	104,490.00	0.06
346	300765	石药创新	3,800	103,474.00	0.06
347	600177	雅戈尔	13,700	103,161.00	0.06
348	002012	凯恩股份	15,900	101,919.00	0.06
349	000792	盐湖股份	3,300	99,627.00	0.05
350	002440	闰土股份	9,700	99,425.00	0.05
351	301098	金埔园林	12,100	99,220.00	0.05
352	300623	捷捷微电	2,200	98,978.00	0.05
353	688266	泽璟制药	848	98,927.68	0.05

354	002623	亚玛顿	6,300	98,406.00	0.05
355	003023	彩虹集团	5,000	97,200.00	0.05
356	301287	康力源	3,000	96,870.00	0.05
357	688808	联讯仪器	61	96,644.13	0.05
358	301165	锐捷网络	1,200	96,540.00	0.05
359	688676	金盘科技	1,134	95,981.76	0.05
360	603568	伟明环保	6,200	95,356.00	0.05
361	002766	索菱股份	26,900	94,957.00	0.05
362	002760	凤形股份	5,700	93,594.00	0.05
363	002907	华森制药	7,000	92,890.00	0.05
364	300917	特发服务	3,800	92,644.00	0.05
365	001248	华润新能源	9,139	92,395.29	0.05
366	000988	华工科技	500	92,305.00	0.05
367	600301	华锡有色	1,500	91,980.00	0.05
368	001387	雪祺电气	7,200	91,944.00	0.05
369	002584	西陇科学	9,600	91,008.00	0.05
370	002578	闽发铝业	28,800	90,720.00	0.05
371	300715	凯伦股份	5,500	90,530.00	0.05
372	000068	华控赛格	31,900	90,277.00	0.05
373	002443	金洲管道	9,100	86,723.00	0.05
374	600280	中央商场	32,800	86,264.00	0.05
375	688322	奥比中光	656	85,640.80	0.05
376	002756	永兴材料	1,500	84,960.00	0.05
377	601231	环旭电子	2,600	84,240.00	0.05
378	600863	华能蒙电	17,900	84,130.00	0.05
379	601116	三江购物	8,500	83,895.00	0.05
380	002517	恺英网络	5,100	82,875.00	0.04
381	600018	上港集团	17,300	81,656.00	0.04
382	600602	云赛智联	5,000	80,400.00	0.04
383	605007	五洲特纸	6,000	80,340.00	0.04
384	603057	紫燕食品	3,600	80,280.00	0.04
385	000995	皇台酒业	8,200	77,900.00	0.04
386	002498	汉缆股份	11,400	77,748.00	0.04
387	002645	华宏科技	2,800	77,028.00	0.04
388	688009	中国通号	16,135	76,802.60	0.04
389	600319	亚星化学	12,300	76,629.00	0.04
390	601061	中信金属	7,100	76,467.00	0.04
391	000786	北新建材	4,200	75,978.00	0.04
392	301358	湖南裕能	1,000	75,870.00	0.04
393	601126	四方股份	1,200	75,840.00	0.04
394	301163	宏德股份	3,400	75,412.00	0.04
395	603578	三星新材	6,400	75,200.00	0.04
396	603421	鼎信通讯	12,200	75,030.00	0.04

397	002938	鹏鼎控股	700	73,766.00	0.04
398	688038	中科通达	4,384	73,738.88	0.04
399	000050	深天马 A	7,400	73,334.00	0.04
400	001366	播恩集团	6,700	72,628.00	0.04
401	300987	川网传媒	5,800	71,340.00	0.04
402	301308	江波龙	100	70,380.00	0.04
403	003022	联泓新科	2,700	69,930.00	0.04
404	688273	麦澜德	1,800	69,732.00	0.04
405	000020	深华发 A	6,300	68,670.00	0.04
406	003001	中岩大地	5,300	68,635.00	0.04
407	605177	东亚药业	4,000	68,440.00	0.04
408	600792	云煤能源	21,300	67,521.00	0.04
409	301028	鼎熔岩	4,200	67,032.00	0.04
410	300839	博汇股份	5,700	66,747.00	0.04
411	300263	隆华科技	4,000	65,200.00	0.04
412	001696	宗申动力	3,100	64,511.00	0.03
413	300808	久量股份	2,900	64,264.00	0.03
414	301032	新柴股份	6,900	64,170.00	0.03
415	603968	醋化股份	6,900	63,894.00	0.03
416	605080	浙江自然	3,300	63,558.00	0.03
417	301227	森鹰窗业	2,500	63,025.00	0.03
418	688449	联芸科技	722	62,315.82	0.03
419	301373	凌玮科技	400	62,200.00	0.03
420	688818	电科蓝天	871	61,091.94	0.03
421	603626	科森科技	3,300	61,050.00	0.03
422	301212	联盛化学	2,600	60,710.00	0.03
423	001286	陕西能源	5,800	58,812.00	0.03
424	688061	灿瑞科技	1,150	57,120.50	0.03
425	600039	四川路桥	7,300	57,086.00	0.03
426	002862	实丰文化	4,400	56,452.00	0.03
427	600331	宏达股份	5,100	56,049.00	0.03
428	300606	金太阳	1,300	55,328.00	0.03
429	300481	濮阳惠成	2,900	55,158.00	0.03
430	002056	横店东磁	1,800	54,864.00	0.03
431	688182	灿勤科技	1,272	54,785.04	0.03
432	000519	中兵红箭	2,600	54,782.00	0.03
433	603182	嘉华股份	4,800	54,720.00	0.03
434	600809	山西汾酒	500	54,685.00	0.03
435	600149	廊坊发展	11,900	53,431.00	0.03
436	600547	山东黄金	2,300	53,107.00	0.03
437	600292	电投水电	4,400	52,976.00	0.03
438	688820	盛合晶微	373	52,775.77	0.03
439	002203	海亮股份	2,300	52,555.00	0.03

440	600768	宁波富邦	3,500	52,430.00	0.03
441	603897	长城科技	1,600	51,936.00	0.03
442	600415	小商品城	5,100	51,816.00	0.03
443	002702	海欣食品	11,600	51,620.00	0.03
444	300576	容大感光	1,000	51,220.00	0.03
445	300709	精研科技	900	50,625.00	0.03
446	603755	日辰股份	2,200	49,918.00	0.03
447	601858	中国科传	2,800	48,468.00	0.03
448	600241	时代万恒	7,400	48,026.00	0.03
449	002636	金安国纪	400	47,988.00	0.03
450	002855	捷荣技术	5,000	47,500.00	0.03
451	000952	广济药业	8,700	47,154.00	0.03
452	600298	安琪酵母	1,300	47,060.00	0.03
453	300921	南凌科技	2,300	46,713.00	0.03
454	600642	申能股份	5,300	46,269.00	0.03
455	000695	滨海能源	3,700	46,250.00	0.03
456	688712	北芯生命	1,283	46,085.36	0.02
457	000520	凤凰航运	12,200	45,506.00	0.02
458	301025	读客文化	5,800	45,008.00	0.02
459	300610	晨化股份	4,500	43,875.00	0.02
460	603808	歌力思	5,700	43,149.00	0.02
461	600208	衢州发展	14,900	42,167.00	0.02
462	600961	株冶集团	1,300	42,107.00	0.02
463	603320	迪贝电气	2,400	41,880.00	0.02
464	688793	倍轻松	2,577	41,515.47	0.02
465	688785	恒运昌	88	40,757.20	0.02
466	000729	燕京啤酒	4,000	40,520.00	0.02
467	300977	深圳瑞捷	2,600	40,092.00	0.02
468	688797	臻宝科技	81	37,962.27	0.02
469	600367	红星发展	600	37,758.00	0.02
470	000938	紫光股份	1,300	37,518.00	0.02
471	301682	宏明电子	233	37,293.98	0.02
472	600346	恒力石化	2,100	37,191.00	0.02
473	600353	旭光电子	800	36,480.00	0.02
474	300058	蓝色光标	2,600	35,776.00	0.02
475	603777	来伊份	2,300	35,719.00	0.02
476	688021	奥福科技	1,808	35,002.88	0.02
477	001282	三联锻造	1,700	34,646.00	0.02
478	002590	万安科技	3,400	34,000.00	0.02
479	301203	国泰环保	800	33,800.00	0.02
480	688248	南网科技	488	33,759.84	0.02
481	002942	新农股份	2,300	32,959.00	0.02
482	000679	大连友谊	5,300	32,701.00	0.02

483	300616	尚品宅配	3,100	32,302.00	0.02
484	688813	泰金新能	185	31,836.65	0.02
485	603536	惠发食品	4,000	31,160.00	0.02
486	002015	协鑫能科	1,900	31,008.00	0.02
487	301198	喜悦智行	2,300	30,820.00	0.02
488	603960	克来机电	1,700	29,597.00	0.02
489	001399	惠科股份	1,051	29,144.23	0.02
490	000733	振华科技	500	28,320.00	0.02
491	301088	戎美股份	2,300	26,358.00	0.01
492	002057	中钢天源	2,100	26,103.00	0.01
493	002678	珠江钢琴	6,000	25,380.00	0.01
494	600637	东方明珠	2,900	24,099.00	0.01
495	002442	龙星科技	4,800	23,664.00	0.01
496	002780	三夫户外	1,900	23,066.00	0.01
497	002903	宇环数控	500	22,710.00	0.01
498	688781	视涯科技	469	22,329.09	0.01
499	603296	华勤技术	300	22,281.00	0.01
500	000506	招金黄金	1,900	22,268.00	0.01
501	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.01
502	002972	科安达	1,100	21,516.00	0.01
503	001257	盛龙股份	1,014	21,030.36	0.01
504	300834	星辉环材	500	20,900.00	0.01
505	002800	天顺股份	1,600	20,784.00	0.01
506	603170	宝立食品	1,800	20,340.00	0.01
507	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.01
508	600956	新天绿能	2,800	19,572.00	0.01
509	600232	金鹰股份	3,100	19,530.00	0.01
510	001230	劲旅环境	1,260	19,353.60	0.01
511	000159	国际实业	3,500	18,830.00	0.01
512	603124	江南新材	100	18,698.00	0.01
513	003003	天元股份	1,800	17,910.00	0.01
514	300319	麦捷科技	600	17,778.00	0.01
515	605066	天正电气	2,600	17,654.00	0.01
516	301515	港通医疗	1,000	17,530.00	0.01
517	688811	有研复材	726	17,518.38	0.01
518	002999	天禾股份	3,100	16,492.00	0.01
519	002174	游族网络	1,300	16,393.00	0.01
520	605001	威奥股份	3,000	16,350.00	0.01
521	600989	宝丰能源	800	16,264.00	0.01
522	601016	节能风电	4,100	15,908.00	0.01
523	600219	南山铝业	3,900	15,561.00	0.01
524	600130	波导股份	3,500	15,505.00	0.01
525	301687	新广益	195	15,167.10	0.01

526	301024	霍普股份	400	14,728.00	0.01
527	301531	春光集团	281	14,488.36	0.01
528	002001	新 和 成	500	14,210.00	0.01
529	600499	科达制造	1,000	13,800.00	0.01
530	002782	可立克	600	12,630.00	0.01
531	301669	高特电子	435	12,354.00	0.01
532	300059	东方财富	600	12,228.00	0.01
533	001373	翔腾新材	400	12,060.00	0.01
534	002865	钧达股份	200	11,936.00	0.01
535	603073	彩蝶实业	800	11,928.00	0.01
536	301312	智立方	100	11,601.00	0.01
537	600865	百大集团	1,400	11,466.00	0.01
538	001376	百通能源	1,100	11,440.00	0.01
539	603020	爱普股份	800	11,280.00	0.01
540	002843	泰嘉股份	500	10,735.00	0.01
541	603989	艾华集团	200	10,500.00	0.01
542	001368	通达创智	500	10,285.00	0.01
543	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
544	301599	理奇智能	309	10,033.23	0.01
545	601216	君正集团	2,200	9,812.00	0.01
546	301680	固德电材	86	9,645.76	0.01
547	001280	中国铀业	144	9,604.80	0.01
548	000017	深中华 A	1,500	9,180.00	0.00
549	301168	通灵股份	200	8,982.00	0.00
550	603238	诺邦股份	800	8,800.00	0.00
551	300746	汉嘉数智	800	8,648.00	0.00
552	688058	宝兰德	413	8,639.96	0.00
553	001365	天海电子	249	7,796.19	0.00
554	601633	长城汽车	500	7,545.00	0.00
555	600375	汉马科技	2,000	7,380.00	0.00
556	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
557	000063	中兴通讯	200	7,238.00	0.00
558	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
559	603299	苏盐井神	800	7,032.00	0.00
560	000688	国城矿业	200	6,846.00	0.00
561	001393	维通利	175	6,823.25	0.00
562	301683	慧谷新材	56	6,819.12	0.00
563	688816	易思维	119	6,794.90	0.00
564	002591	恒大高新	1,100	6,732.00	0.00
565	301397	溯联股份	200	6,472.00	0.00
566	600802	福建水泥	1,500	6,180.00	0.00
567	603168	莎普爱思	1,300	6,136.00	0.00
568	300323	华灿光电	300	6,120.00	0.00

569	001237	惠康科技	101	5,932.74	0.00
570	601615	明阳智能	500	5,785.00	0.00
571	301186	超达装备	140	5,740.00	0.00
572	002133	广宇集团	2,400	5,736.00	0.00
573	300755	华致酒行	500	5,695.00	0.00
574	300568	星源材质	300	5,616.00	0.00
575	688387	信科移动	280	5,555.20	0.00
576	002909	集泰股份	1,100	5,434.00	0.00
577	600598	北大荒	500	5,420.00	0.00
578	000151	中成股份	500	5,350.00	0.00
579	601112	振石股份	303	5,329.77	0.00
580	605577	龙版传媒	600	5,286.00	0.00
581	000975	山金国际	300	5,100.00	0.00
582	688208	道通科技	200	5,038.00	0.00
583	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
584	300614	百川畅银	500	4,840.00	0.00
585	600333	长春燃气	900	4,518.00	0.00
586	002752	昇兴股份	800	4,416.00	0.00
587	688597	煜邦电力	623	4,049.50	0.00
588	688681	科汇股份	280	3,914.40	0.00
589	000631	顺发恒能	1,300	3,887.00	0.00
590	601918	新集能源	400	3,436.00	0.00
591	600295	鄂尔多斯	300	3,216.00	0.00
592	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
593	301449	天溯计量	64	2,476.80	0.00
594	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
595	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
596	603293	埃泰克	47	1,594.71	0.00
597	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
598	001312	福恩股份	94	1,577.32	0.00
599	300056	中创环保	200	1,454.00	0.00
600	300838	浙江力诺	100	1,335.00	0.00
601	002188	中天服务	200	980.00	0.00
602	600303	曙光股份	300	747.00	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	600519	贵州茅台	25,974,466.62	5.69
2	600372	中航机载	8,962,439.08	1.96
3	300750	宁德时代	8,359,867.00	1.83
4	300308	中际旭创	7,644,509.00	1.67
5	600584	长电科技	7,240,806.00	1.59

6	601009	南京银行	6,396,263.00	1.40
7	601838	成都银行	6,238,322.00	1.37
8	300394	天孚通信	5,926,869.00	1.30
9	600036	招商银行	5,826,040.00	1.28
10	002648	卫星化学	5,741,120.00	1.26
11	000100	TCL 科技	5,686,234.00	1.25
12	601166	兴业银行	5,646,900.00	1.24
13	603986	兆易创新	5,426,782.03	1.19
14	300502	新易盛	5,388,764.00	1.18
15	688008	澜起科技	5,240,439.61	1.15
16	000977	浪潮信息	5,194,665.00	1.14
17	300274	阳光电源	5,178,358.00	1.13
18	002475	立讯精密	5,163,262.00	1.13
19	600926	杭州银行	5,032,049.00	1.10
20	000878	云南铜业	4,880,829.00	1.07

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	600519	贵州茅台	24,092,918.70	5.28
2	601318	中国平安	15,199,067.00	3.33
3	601899	紫金矿业	12,995,990.00	2.85
4	600372	中航机载	12,210,087.17	2.67
5	600030	中信证券	10,903,490.10	2.39
6	601066	中信建投	9,710,630.00	2.13
7	000100	TCL 科技	9,420,445.00	2.06
8	300750	宁德时代	9,005,738.00	1.97
9	600584	长电科技	8,460,518.00	1.85
10	600522	中天科技	8,345,812.00	1.83
11	300394	天孚通信	7,873,067.00	1.72
12	000786	北新建材	7,772,797.00	1.70
13	600036	招商银行	7,731,506.00	1.69
14	002493	荣盛石化	7,699,157.00	1.69
15	601009	南京银行	7,197,134.24	1.58
16	000725	京东方 A	7,175,696.00	1.57
17	000651	格力电器	7,142,654.00	1.56
18	601838	成都银行	7,134,444.00	1.56
19	600497	驰宏锌锗	7,115,419.00	1.56
20	300502	新易盛	6,876,712.00	1.51

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	1,367,981,515.83
卖出股票收入（成交）总额	1,659,723,121.35

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易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。兴业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。上海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

局上海监管局、中国人民银行的处罚。上海浦东发展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、中国人民银行、中国人民银行上海市分行(国家外汇管理局上海市分局)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	20,020.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,020.12

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)	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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
中欧大盘智选混合发起 A	977	83, 178. 37	10, 028, 513. 73	12. 34%	71, 236, 750. 53	87. 66%
中欧大盘智选混合发起 C	2, 208	34, 788. 79	43, 664, 481. 51	56. 84%	33, 149, 161. 44	43. 16%
合计	3, 185	49, 632. 31	53, 692, 995. 24	33. 97%	104, 385, 911. 97	66. 03%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	95. 22

8.3 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	中欧大盘智选混合发起 A	1, 019. 76	0. 00%
	中欧大盘智选混合发起 C	10, 010. 01	0. 01%
	合计	11, 029. 77	0. 01%

8.4 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	中欧大盘智选混合发起 A	0
	中欧大盘智选混合发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧大盘智选混合发起 A	0
	中欧大盘智选混合发起 C	0
	合计	0

8.5 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, 008, 750. 88	6. 33%	10, 008, 750. 88	6. 33%	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	10,008,750.88	6.33%	10,008,750.88	6.33%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧大盘智选混合发起 A	中欧大盘智选混合发起 C
基金合同生效日 (2025 年 6 月 25 日)		
基金份额总额	579,273,681.50	309,675,745.45
本报告期期初基金份 额总额	283,572,141.14	157,561,625.79
本报告期基金总申购 份额	9,723,008.34	56,681,216.02
减：本报告期基金总 赎回份额	212,029,885.22	137,429,198.86
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	81,265,264.26	76,813,642.95

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

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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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 (%)	
中信建投	3	2,924,687,685.93	96.64	397,466.11	96.64	-
东北证券	3	96,207,059.22	3.18	13,076.27	3.18	-
国泰海通	3	5,523,415.75	0.18	750.93	0.18	-

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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

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	中欧大盘智选混合型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
2	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
3	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
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	中欧大盘智选混合型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
6	中欧大盘智选混合型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
7	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
8	中欧大盘智选混合型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
9	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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)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