

中欧中证港股通央企红利指数发起式证券 投资基金（QDII） 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：南京银行股份有限公司

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。

基金托管人南京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	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	40
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	56
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	60
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	60
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	60
7.11 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	64
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）	
基金简称	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)	
基金主代码	021583	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 1 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	296,409,312.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)A	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)C
下属分级基金的交 易代码	021583	021584
报告期末下属分级 基金的份额总额	116,744,143.30 份	179,665,169.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证港股通央企红利指数收益率(经汇率调整后)×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为被动管理的指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特

	征。 本基金投资于境外证券市场，因此还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	--

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	南京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	王峰
	联系电话	021-68609600	021-24198808
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	wangf3@njcb.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95302
传真		021-50190017	025-86776189
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	南京市建邺区江山大街 88 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	南京市建邺区江山大街 88 号
邮政编码		200120	210019
法定代表人		窦玉明	谢宁

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	China Minsheng Banking Corp., Ltd., Hong Kong Branch
	中文	无	中国民生银行股份有限公司香港分行
注册地址		-	香港中环金融街 8 号国际金融中心二期 37F 01-02、12-16/40F
办公地址		-	香港中环金融街 8 号国际金融中心二期 37F 01-02、12-16/40F
邮政编码		-	000000

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII) A	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII) C
本期已实现收益	2, 292, 417. 38	3, 573, 806. 81
本期利润	-17, 437, 850. 89	-23, 297, 417. 37
加权平均基金份额本期利润	-0. 1480	-0. 1162
本期加权平均净值利润率	-12. 35%	-9. 78%
本期基金份额净值增长率	-11. 24%	-11. 20%
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	2, 490, 005. 49	3, 466, 287. 62
期末可供分配基金份额利润	0. 0213	0. 0193
期末基金资产净值	121, 374, 685. 17	184, 985, 428. 79
期末基金份额净值	1. 0397	1. 0296
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	12. 29%	10. 85%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)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	-11.28%	0.78%	-12.81%	0.80%	1.53%	-0.02%
过去六个月	-11.24%	0.87%	-12.42%	0.89%	1.18%	-0.02%
过去一年	-5.46%	0.82%	-7.71%	0.85%	2.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.29%	1.15%	13.05%	1.20%	-0.76%	-0.05%

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

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)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	-11.34%	0.78%	-12.81%	0.80%	1.47%	-0.02%
过去六个月	-11.20%	0.87%	-12.42%	0.89%	1.22%	-0.02%
过去一年	-5.57%	0.83%	-7.71%	0.85%	2.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.85%	1.15%	13.05%	1.20%	-2.20%	-0.05%

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

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

中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）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 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		
FANG SHENSHEN	基金经理 / 基金经理助理	2024-07-01	-	20 年	历任高盛私人财富管理部税务分析师，Cooper Investors 助理基金会计师、交易员、新兴市场组研究员。2019-02-11 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。
张聪	基金经理 / 基金经理助理	2024-09-19	-	5 年	历任友联互通信息技术有限公司高级软件工程师，IDG 资本投资顾问（北京）有限公司分析师，北京联和运通投资有限公司高级分析师，华兴资本新经济基金数据研究副总裁/数据团队负责人，高瓴资本 PE 大消费组副总裁，西部证券研究发展中心另类数据总监。2023-08-21 加入中欧基金管理有限公司。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中 FANG SHENSHEN 担任本基金的基金经理；张聪担任本基金的基金经理助理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截至 6 月 30 日，港股通央企红利指数的 PE 估值为 6.7 倍，位于过去 3 年的 65.5% 分位，年初至今下跌 9.6%，略次于中证红利指数，跑输沪深 300，大幅跑输科创创业 50。2026 上半年的全球市场两极分化：有 AI 和没有 AI，前者如美股费城半导体、韩国和中国台湾股市，以及 A 股科创板与创业板，后者如港股互联网、恒生科技、港股红利和 A 股消费板块。一定意义上，全球市场都是明显的 K 型分化，但中国市场更为极致：A 股内部仅 30% 的公司跑赢指数，全部 A 股收益中位数为 -11.8%。同时，本轮 AI 产业链展现出来的资金虹吸并非平均发生在所有科技行业，而是集中在 GPU、半导体等 AI 上游硬件领域。AI 产业链呈现“上游盈利、下游投入”的利润分配特征，上游硬件盈利持续改善，吸引资金进一步集中。银行、煤炭、公用事业等红利资产则受到交易型资金减仓影响，出现持续调整。但是我们依然需要看到，当前红利资产未必具备短期快速上涨的高赔率，但已经具有较高的中长期配置胜率。我们认为，只有在股息率优势明显消失、股债收益差进入历史极端区间时，才需要认真考虑是否应该卖掉红利资产。本指数当前的股息率为 5.4%，依然非常有吸引力。

4.5.2 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 -11.24%，同期业绩比较基准收益率为 -12.42%；基金 C 类份额净值增长率为 -11.20%，同期业绩比较基准收益率为 -12.42%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，高股息标的多集中于现金流稳定、盈利壁垒深厚的能源、公用事业等板块的优质企业，其业绩的相对确定性成为震荡市中的稀缺资源。同时，无风险收益率持续下行，十年期国债收益率走低，红利指数相较固收资产形成显著的利差优势。另一方面，政策端为红利策略提供了坚实制度支撑，新“国九条”强化上市公司分红约束，将分红与减持、再融资挂钩，央企市值管理考核也将分红率纳入核心指标，大幅提升了红利资产的供给质量与分红持续性。叠加新会计准则下机构投资者可以采用 OCI 账户形式投资配置，保险、养老金等长线资金持续增配，形成正向资金循环，进一步推高了红利策略的市场热度。关于港股的流动性，短期来看，美联储的加息路径可能不会一蹴而就。世界杯相关活动对美国就业的阶段性拉动在赛事结束后可能减弱，后续非农就业数据存在降温的可能，立即加息的必要性可能下降。加息预期后移有望在情绪层面缓解港股的海外流动性压力。投资操作方面，本基金秉承被动化投资理念，力争紧密跟踪基准指数表现，并做好对指数成份调整、申赎和流动性头寸的应对，将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利

润分配情况”。

4.9 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，南京银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的相关规定，切实履行了受托管理职责，未出现任何损害基金份额持有人利益的行为，独立、勤勉尽责地履行了受托管理职责。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作实施了必要的监督。针对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配及基金费用开支等方面，本托管人进行了审慎复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制、经本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（其中“金融工具风险及管理”部分未经本托管人复核）、投资组合报告等内容均真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

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	27,537,505.78	34,610,000.66
结算备付金		2,762,676.44	72.64
存出保证金		674.96	9.85
交易性金融资产	6.4.7.2	280,706,433.95	364,023,668.50
其中：股票投资		280,706,433.95	363,113,628.94
基金投资		-	-

债券投资		-	910,039.56
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		3,993,353.19	4,004,587.47
应收股利		4,177,321.21	1,077,079.10
应收申购款		1,078,311.31	2,982,207.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		320,256,276.84	406,697,625.40
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		621,929.59	-
应付赎回款		12,956,088.55	20,163,297.79
应付管理人报酬		143,636.18	173,198.03
应付托管费		28,727.23	34,639.58
应付销售服务费		43,477.79	60,732.51
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	102,303.54	56,004.90
负债合计		13,896,162.88	20,487,872.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	296,409,312.91	325,346,742.13
未分配利润	6.4.7.8	9,950,801.05	60,863,010.46
净资产合计		306,360,113.96	386,209,752.59
负债和净资产总计		320,256,276.84	406,697,625.40

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 296,409,312.91 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0397 元，基金份额总额 116,744,143.30 份；下属 C 类基金份额净值为人民币

1.0296 元，基金份额总额 179,665,169.61 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-39,197,889.00	12,304,416.78
1. 利息收入		48,090.25	18,959.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	48,090.25	18,959.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		7,361,900.65	3,734,926.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,057.72	-111,538.30
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	9,050.79	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	7,329,792.14	3,846,464.44
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）	6.4.7.16	-46,601,492.45	8,904,148.42
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-38,871.40	-370,172.95
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	32,483.95	16,555.93
减：二、营业总支出		1,537,379.26	448,692.23
1. 管理人报酬		941,164.20	245,416.75
2. 托管费		188,232.87	49,083.40
3. 销售服务费		296,250.04	84,030.63
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. 18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	111, 732. 15	70, 161. 45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40, 735, 268. 26	11, 855, 724. 55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40, 735, 268. 26	11, 855, 724. 55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-40, 735, 268. 26	11, 855, 724. 55

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

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	325, 346, 742. 13	-	60, 863, 010. 46	386, 209, 752. 59
二、本期期初净资产	325, 346, 742. 13	-	60, 863, 010. 46	386, 209, 752. 59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28, 937, 429. 22	-	-50, 912, 209. 41	-79, 849, 638. 63
（一）、综合收益总额	-	-	-40, 735, 268. 26	-40, 735, 268. 26
（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）	-28, 937, 429. 22	-	-2, 456, 715. 49	-31, 394, 144. 71
其中：1. 基金申购款	249, 141, 330. 20	-	50, 405, 484. 38	299, 546, 814. 58
2. 基金赎回款	-278, 078, 759. 42	-	-52, 862, 199. 87	-330, 940, 959. 29
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-7, 720, 225. 66	-7, 720, 225. 66

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	296,409,312.91	-	9,950,801.05	306,360,113.96
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	56,585,166.93	-	4,090,548.33	60,675,715.26
二、本期期初净资产	56,585,166.93	-	4,090,548.33	60,675,715.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	91,212,757.25	-	22,111,509.96	113,324,267.21
（一）、综合收益总额	-	-	11,855,724.55	11,855,724.55
（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）	91,212,757.25	-	10,255,785.41	101,468,542.66
其中：1. 基金申购款	240,678,072.20	-	22,932,335.00	263,610,407.20
2. 基金赎回款	-149,465,314.95	-	-12,676,549.59	-162,141,864.54
（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	147,797,924.18	-	26,202,058.29	173,999,982.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]791号《关于准予中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)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40,550,219.94元,经向中国证监会备案,《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于2024年7月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为40,556,227.31份基金份额,其中包含认购资金利息折合6,007.37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。

6.4.4.1 基金的收益分配政策

(1)本基金每月度进行分红评估,在符合有关基金分红条件的前提下,若截至每月第五个交易日,每份基金份额可供分配利润高于0.01元(含)或基金相对业绩比较基准的超额收益率大于0,则基金管理人可在其后30日内提出分配方案进行评估,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;其中,人民币份额的现金分红币种为人民币,美元份额的现金分红币种为美元;不同类

别份额红利再投资适用的净值为该类别基金份额的净值；

(3) 对于人民币份额而言，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的人民币份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值；而对于美元份额，由于汇率因素影响，收益分配后美元份额净值可能低于对应的美元份额面值；

(4) 由于本基金各基金份额类别的 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

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. 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

7. 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	27,537,505.78
等于：本金	27,535,144.67
加：应计利息	2,361.11
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	27,537,505.78

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	322,543,624.07	—	280,706,433.95	-41,837,190.12
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	322,543,624.07	—	280,706,433.95	-41,837,190.12

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	284.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	33,584.78
其中：交易所市场	33,584.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	8,926.92
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	102,303.54

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)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	102,761,325.53	102,761,325.53
本期申购	91,575,722.26	91,575,722.26
本期赎回（以“-”号填列）	-77,592,904.49	-77,592,904.49
本期末	116,744,143.30	116,744,143.30

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)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	222,585,416.60	222,585,416.60
本期申购	157,565,607.94	157,565,607.94
本期赎回（以“-”号填列）	-200,485,854.93	-200,485,854.93
本期末	179,665,169.61	179,665,169.61

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,838,510.30	17,342,943.11	20,181,453.41
本期期初	2,838,510.30	17,342,943.11	20,181,453.41
本期利润	2,292,417.38	-19,730,268.27	-17,437,850.89
本期基金份额交易产生的变动数	292,125.48	4,527,861.54	4,819,987.02
其中：基金申购款	2,138,059.23	17,448,925.37	19,586,984.60
基金赎回款	-1,845,933.75	-12,921,063.83	-14,766,997.58
本期已分配利润	-2,933,047.67	-	-2,933,047.67
本期末	2,490,005.49	2,140,536.38	4,630,541.87

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,668,998.60	35,012,558.45	40,681,557.05
本期期初	5,668,998.60	35,012,558.45	40,681,557.05
本期利润	3,573,806.81	-26,871,224.18	-23,297,417.37
本期基金份额交易产生的变动数	-989,339.80	-6,287,362.71	-7,276,702.51
其中：基金申购款	3,477,355.56	27,341,144.22	30,818,499.78
基金赎回款	-4,466,695.36	-33,628,506.93	-38,095,202.29
本期已分配利润	-4,787,177.99	-	-4,787,177.99
本期末	3,466,287.62	1,853,971.56	5,320,259.18

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	46,162.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,837.27
其他	90.58
合计	48,090.25

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	189,627,663.76
减：卖出股票成本总额	189,095,739.12
减：交易费用	508,866.92

买卖股票差价收入	23,057.72
----------	-----------

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	11,750.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,700.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,050.79

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,559,760.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,502,700.00
减：应计利息总额	59,760.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,700.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 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	7,329,792.14
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	7,329,792.14

6.4.7.16 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	-46,601,492.45
股票投资	-46,601,492.45
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-46,601,492.45

6.4.7.17 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	32,483.95
合计	32,483.95

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 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	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	30,632.00
账户维护费	9,000.00
证券组合费	3,665.86
合计	111,732.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 7 月 15 日宣告 2026 年度的第七次分红，本次收益分配基准日为 2026 年 7 月 7 日的分红，向截至 2026 年 7 月 17 日止在本基金 A 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.036 元；向截至 2026 年 7 月 17 日止在本基金 C 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.036 元。

本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 18 日宣告 2026 年度的第八次分红，本次收益分配基准日为 2026 年 8 月 7 日的分红，向截至 2026 年 8 月 20 日止在本基金 A 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.039 元；向截至 2026 年 8 月 20 日止在本基金 C 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.038 元。

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
中国民生银行股份有限公司香港分行	境外托管人
南京银行股份有限公司	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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	941,164.20	245,416.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	404,864.46	93,830.73
应支付基金管理人的净管理费	536,299.74	151,586.02

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，以人民币支付，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定方式，在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	188,232.87	49,083.40

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，以人民币支付，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定方式，在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证港股通央企 红利指数发起 (QDII) A	中欧中证港股通央企 红利指数发起 (QDII) C	合计
南京银行股份有限公司	0.00	7.12	7.12
中欧财富	0.00	12,790.75	12,790.75
中欧基金	0.00	278.90	278.90
合计	0.00	13,076.77	13,076.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证港股通央企 红利指数发起 (QDII) A	中欧中证港股通央企 红利指数发起 (QDII) C	合计
南京银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
中欧财富	0.00	6,685.29	6,685.29
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	6,685.29	6,685.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.25%。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，以人民币支付，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人指令或者双方约定方式，在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。销售服务费由基金托管人先行支付给基金管理人，由基金管理人支付登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额	8.57%	26.83%

占基金总份额比例		
----------	--	--

- 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

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

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	147,959.48	0.13%	147,959.48	0.14%

份额单位：份

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)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
中欧财富	1,293.29	0.00%	1,156.72	0.00%
自然人股东	1,146,831.93	0.64%	2,975,517.88	1.34%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
南京银行股份有限公司	22,740,539.29	46,148.94	17,291,361.33	17,240.45
中国民生银行股份有限公司香港分行	4,796,966.49	13.46	1,126,828.64	3.91

注：本基金的银行存款由基金托管人南京银行股份有限公司和境外资产托管人中国民生银行股份有限公司香港分行保管，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

单位：人民币元

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 20 日	-	2026 年 1 月 20 日	0.0570	387,762.86	181,823.08	569,585.94	-
2	2026 年 2 月 12 日	-	2026 年 2 月 12 日	0.0510	361,512.44	166,064.05	527,576.49	-
3	2026 年 3 月 17 日	-	2026 年 3 月 17 日	0.0490	442,564.94	160,858.96	603,423.90	-
4	2026 年 4 月 16 日	-	2026 年 4 月 16 日	0.0480	427,220.74	173,340.47	600,561.21	-
5	2026 年 5 月 25 日	-	2026 年 5 月 25 日	0.0110	99,463.51	44,410.68	143,874.19	-
6	2026 年 6 月 16 日	-	2026 年 6 月 16 日	0.0400	321,796.34	166,229.60	488,025.94	-
合计	-	-	-	0.2560	2,040,320.83	892,726.84	2,933,047.67	-
中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 20 日	-	2026 年 1 月 20 日	0.0520	754,179.61	317,396.82	1,071,576.43	-
2	2026 年 2 月 12 日	-	2026 年 2 月 12 日	0.0470	652,884.41	317,106.06	969,990.47	-
3	2026 年 3 月 17 日	-	2026 年 3 月 17 日	0.0450	605,570.48	312,594.34	918,164.82	-
4	2026 年 4 月 16 日	-	2026 年 4 月 16 日	0.0440	567,937.75	311,485.67	879,423.42	-
5	2026 年 5 月 25 日	-	2026 年 5 月 25 日	0.0100	125,088.25	72,062.01	197,150.26	-
6	2026 年 6 月 16 日	-	2026 年 6 月 16 日	0.0400	474,812.67	276,059.92	750,872.59	-
合计	-	-	-	0.2380	3,180,473.17	1,606,704.82	4,787,177.99	-

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 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

本基金为国际(QDII)股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结

合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

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 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	27,537,505.78	-	-	-	27,537,505.78
结算备付金	2,762,676.44	-	-	-	2,762,676.44
存出保证金	674.96	-	-	-	674.96
交易性金融资产	-	-	-	280,706,433.95	280,706,433.95
应收股利	-	-	-	4,177,321.21	4,177,321.21
应收申购款	-	-	-	1,078,311.31	1,078,311.31
应收清算款	-	-	-	3,993,353.19	3,993,353.19
资产总计	30,300,857.18	-	-	289,955,419.66	320,256,276.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,956,088.55	12,956,088.55
应付管理人报酬	-	-	-	143,636.18	143,636.18
应付托管费	-	-	-	28,727.23	28,727.23

应付清算款	-	-	-	621,929.59	621,929.59
应付销售服务费	-	-	-	43,477.79	43,477.79
其他负债	-	-	-	102,303.54	102,303.54
负债总计	-	-	-	13,896,162.88	13,896,162.88
利率敏感度缺口	30,300,857.18	-	-	-276,059,256.78	306,360,113.96
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	34,610,000.66	-	-	-	34,610,000.66
结算备付金	72.64	-	-	-	72.64
存出保证金	9.85	-	-	-	9.85
交易性金融资产	910,039.56	-	-	-363,113,628.94	364,023,668.50
应收股利	-	-	-	1,077,079.10	1,077,079.10
应收申购款	-	-	-	2,982,207.18	2,982,207.18
应收清算款	-	-	-	4,004,587.47	4,004,587.47
资产总计	35,520,122.71	-	-	-371,177,502.69	406,697,625.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,163,297.79	20,163,297.79
应付管理人报酬	-	-	-	173,198.03	173,198.03
应付托管费	-	-	-	34,639.58	34,639.58
应付销售服务费	-	-	-	60,732.51	60,732.51
其他负债	-	-	-	56,004.90	56,004.90
负债总计	-	-	-	20,487,872.81	20,487,872.81
利率敏感度缺口	35,520,122.71	-	-	-350,689,629.88	386,209,752.59

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：0.24%），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 2026 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
货币资金	-	4,796,966.58	-	4,796,966.58
交易性金融资产	-	280,706,433.95	-	280,706,433.95
应收股利	-	4,177,321.21	-	4,177,321.21
资产合计	-	289,680,721.74	-	289,680,721.74
以外币计价的负债				
应付清算款	-	621,929.59	-	621,929.59
负债合计	-	621,929.59	-	621,929.59
资产负债表外汇风险敞口净额	-	289,058,792.15	-	289,058,792.15
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	3,350,778.73	-	3,350,778.73
交易性金融资产	-	363,113,628.94	-	363,113,628.94
应收股利	-	1,077,079.10	-	1,077,079.10
资产合计	-	367,541,486.77	-	367,541,486.77
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	-	367,541,486.77	-	367,541,486.77

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 5%	-14,452,939.61	-18,377,074.34
	港币相对人民币升值 5%	14,452,939.61	18,377,074.34

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	280,706,433.95	91.63	363,113,628.94	94.02
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	280,706,433.95	91.63	363,113,628.94	94.02

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%	14,893,507.95	18,735,876.14
	业绩比较基准下降 5%	-14,893,507.95	-18,735,876.14

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	280,706,433.95	363,113,628.94
第二层次	—	910,039.56
第三层次	—	—
合计	280,706,433.95	364,023,668.50

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	280,706,433.95	87.65
	其中：普通股	280,706,433.95	87.65
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	30,300,182.22	9.46
8	其他各项资产	9,249,660.67	2.89
9	合计	320,256,276.84	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 31,043,431.85 元，占基金资产净值比例 10.13%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	280,706,433.95	91.63
合计	280,706,433.95	91.63

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
基础材料	5,111,138.81	1.67
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	3,687,567.99	1.20
能源	49,727,180.00	16.23
金融	84,445,110.76	27.56
医疗保健	4,577,501.70	1.49
工业	84,825,476.61	27.69
信息技术	5,005,627.36	1.63
电信服务	24,997,212.08	8.16
公用事业	13,391,911.89	4.37
地产业	4,937,706.75	1.61
合计	280,706,433.95	91.63

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	COSCO Shipp ing Holdi ngs Co., L td.	中远海 运控股 股份有 限公司	1919 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,079,5 00	12,198,172.42	3.98
2	Cssc (Hong Kong) Shipp ing Compa ny	中国船 舶集团 (香港) 航运租 赁有限 公司	3877 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	5,724,0 00	10,738,613.23	3.51

	Limit ed							
2	Cssc (Hong Kong) Shipp ing Compa ny Limit ed	中国船 舶集团 (香港) 航运租 赁有限 公司	03877 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	550,000	1,031,837.40	0.34
3	China Shenh ua Energ y Compa ny Limit ed	中国神 华能源 股份有 限公司	1088 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	236,000	8,223,709.34	2.68
3	China Shenh ua Energ y Compa ny Limit ed	中国神 华能源 股份有 限公司	01088 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	10,500	365,885.37	0.12
4	CN00C Limit ed	中国海 洋石油 有限公 司	883 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	429,000	7,571,393.54	2.47
4	CN00C Limit ed	中国海 洋石油 有限公 司	00883 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	2,000	35,297.87	0.01
5	COSCO SHIPP ING Energ y Trans porta tion	中远海 运能源 运输股 份有限 公司	1138 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	628,000	7,543,565.20	2.46

	Co., Ltd.							
6	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	926,000	6,490,517.81	2.12
6	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	00939 HS	深港通联合市场	中国	143,000	1,002,315.39	0.33
7	Petro China Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港联合交易所	中国香港	1,014,000	7,468,418.26	2.44
8	CITIC Telecom International Holdings Limited	中信国际电讯集团有限公司	1883 HK	香港联合交易所	中国香港	2,607,000	5,592,845.33	1.83
8	CITIC Telecom International Holdings Limited	中信国际电讯集团有限公司	01883 HS	深港通联合市场	中国	842,000	1,806,358.18	0.59
9	China	中国中	1898	香港联	中国香	631,000	5,398,342.24	1.76

	Coal Energy Company Limited	煤能源股份有限公司	HK	合 交 易 所	港			
9	China Coal Energy Company Limited	中国中煤能源股份有限公司	01898 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	221,000	1,890,703.07	0.62
10	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香港	186,500	6,864,906.29	2.24
10	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	02388 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	7,500	276,068.62	0.09
11	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香港	1,071,000	5,981,295.63	1.95
11	Industrial and Commercial Bank	中国工商银行股份有限公司	01398 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	189,000	1,055,522.76	0.34

	of China Limit ed							
12	Bank of Communi- cations Co., Ltd.	交通银 行股份 有限公 司	3328 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	919,000	5,379,850.81	1.76
12	Bank of Communi- cations Co., Ltd.	交通银 行股份 有限公 司	03328 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	172,000	1,006,892.64	0.33
13	Orien- t Overs- eas (Inte- rnati- onal) Limit- ed	东方海 外(国 际)有 限公司	316 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	60,000	6,357,786.00	2.08
14	Sinot- rans Limit- ed	中国外 运股份 有限公 司	598 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,873,000	6,214,353.65	2.03
15	AGRIC- ULTUR- AL BANK OF CHINA LIMIT- ED	中国农 业银行 股份有 限公司	1288 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,303,000	6,043,388.27	1.97
15	AGRIC- ULTUR- AL BANK OF CHINA	中国农 业银行 股份有 限公司	01288 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	26,000	120,589.48	0.04

	LIMIT ED							
16	Bank of China Limit ed	中国银 行股份 有限公 司	3988 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,339,0 00	5,803,312.37	1.89
16	Bank of China Limit ed	中国银 行股份 有限公 司	03988 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	77,000	333,722.97	0.11
17	SINOP EC Engin eerin g (Grou p) Co., Ltd.	中石化 炼化工 程(集 团)股 份有限 公司	2386 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,390,0 00	5,951,912.59	1.94
18	China Petro leum & Chemi cal Corpo ratio n	中国石 油化工 股份有 限公司	386 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,502,0 00	5,218,248.40	1.70
18	China Petro leum & Chemi cal Corpo ratio n	中国石 油化工 股份有 限公司	00386 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	200,000	694,840.00	0.23
19	China Citic Bank Corpo ratio n Limit ed	中信银 行股份 有限公 司	998 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	994,000	5,741,202.36	1.87

20	China Mobil e Limit ed	中国移 动有限 公司	941 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	72,000	4,762,085.94	1.55
20	China Mobil e Limit ed	中国移 动有限 公司	00941 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	14,500	959,031.20	0.31
21	First Tract or Compa ny Limit ed	第一拖 拉机股 份有限 公司	38 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	666,000	3,869,859.27	1.26
21	First Tract or Compa ny Limit ed	第一拖 拉机股 份有限 公司	00038 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	270,000	1,568,861.87	0.51
22	China Everb right Envir onmen t Group Limit ed	中国光 大环境 (集团) 有限公 司	257 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,194,000	4,728,942.07	1.54
22	China Everb right Envir onmen t Group Limit ed	中国光 大环境 (集团) 有限公 司	00257 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	166,000	657,457.61	0.21
23	China Everb right	中国光 大银行 股份有	6818 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,861,000	4,735,968.64	1.55

	Bank Compa ny Limit ed	限公司						
23	China Everb right Bank Compa ny Limit ed	中国光 大银行 股份有 限公司	06818 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	239,000	608,219.51	0.20
24	Sinop ec Kanto ns Holdi ngs Limit ed	中石化 冠德控 股有限 公司	934 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,102,0 00	3,359,568.77	1.10
24	Sinop ec Kanto ns Holdi ngs Limit ed	中石化 冠德控 股有限 公司	00934 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	642,000	1,957,207.94	0.64
25	CITIC Limit ed	中国中 信股份 有限公 司	267 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	562,000	5,179,007.31	1.69
25	CITIC Limit ed	中国中 信股份 有限公 司	00267 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	2,000	18,430.63	0.01
26	China Railw ay Const ructi on Corpo ratio	中国铁 建股份 有限公 司	1186 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	790,000	3,135,726.07	1.02

	n Limit ed							
26	China Railw ay Const ructi on Corpo ratio n Limit ed	中国铁 建股份 有限公 司	01186 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	503,500	1,998,529.21	0.65
27	China Natio nal Build ing Mater ial Compa ny Limit ed	中国建 材股份 有限公 司	3323 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,102,000	5,111,138.81	1.67
28	New China Life Insur ance Compa ny Ltd.	新华人 寿保险 股份有 限公司	1336 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	125,400	5,012,322.14	1.64
29	China Railw ay Signa l & Comm unicat ion Corpo ratio n Limit	中国铁 路通信 信号股 份有限 公司	3969 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,511,000	4,199,612.96	1.37

	ed							
29	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	中国铁路通信信号股份有限公司	03969 HS	深港通联合市场	中国	290,000	806,014.40	0.26
30	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	177,500	4,625,028.75	1.51
30	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	01109 HS	深港通联合市场	中国	12,000	312,678.00	0.10
31	Kunlun Energy Company Limited	昆仑能源有限公司	135 HK	香港联合交易所	中国香港	460,000	2,568,997.19	0.84
31	Kunlun Energy Company Limited	昆仑能源有限公司	00135 HS	深港通联合市场	中国	406,000	2,267,419.26	0.74
32	China Resources	华润电力控股有限公司	836 HK	香港联合交易所	中国香港	326,000	4,790,852.32	1.56

	Power Holdings Company Limited	司						
33	Picc Property And Casualty Company Limited	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	香港 联合 交易所	中国香港	384,000	4,776,052.22	1.56
34	China Communications Construction Company Limited	中国交通建设股份有限公司	1800 HK	香港 联合 交易所	中国香港	899,000	2,865,633.07	0.94
34	China Communications Construction Company Limited	中国交通建设股份有限公司	01800 HS	深港 通 联合 市场	中国	566,000	1,804,169.43	0.59
35	Generetec Universal Medical	通用环球医疗集团有限公司	2666 HK	香港 联合 交易所	中国香港	1,103,000	4,253,567.29	1.39

	Group Compa ny Limit ed							
35	Gener tec Unive rsal Medic al Group Compa ny Limit ed	通用环 球医疗 集团有 限公司	02666 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	84,000	323,934.41	0.11
36	China Merch ants Port Holdi ngs Compa ny Limit ed	招商局 港口控 股有限 公司	144 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	360,000	3,858,446.52	1.26
36	China Merch ants Port Holdi ngs Compa ny Limit ed	招商局 港口控 股有限 公司	00144 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	64,000	685,946.05	0.22
37	China Commu nicat ions Servi ces Corpo ratio n	中国通 信服务 股份有 限公司	552 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,128,0 00	3,840,519.65	1.25

	Limit ed							
37	China Communi- cations Services Corporation Limited	中国通 信服务 股份有 限公司	00552 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	200,000	680,943.20	0.22
38	China Merchants Bank Co.,Ltd.	招商银 行股份 有限公 司	3968 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	100,000	3,901,526.60	1.27
38	China Merchants Bank Co.,Ltd.	招商银 行股份 有限公 司	03968 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	13,000	507,198.46	0.17
39	China Telecom Corporation Limited	中国电 信股份 有限公 司	728 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	980,000	3,634,534.33	1.19
39	China Telecom Corporation Limited	中国电 信股份 有限公 司	00728 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	178,000	660,150.11	0.22
40	China Unicom (Hong	中国联 合网络 通信 (香港)	762 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	710,000	3,767,856.76	1.23

	Kong) Limit ed	股份有 限公司						
40	China Unico m (Hong Kong) Limit ed	中国联 合网络 通信 (香港) 股份有 限公司	00762 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	80,000	424,547.24	0.14
41	China Railw ay Group Limit ed	中国中 铁股份 有限公 司	390 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,232,0 00	3,541,877.42	1.16
41	China Railw ay Group Limit ed	中国中 铁股份 有限公 司	00390 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	183,000	526,106.79	0.17
42	China State Const ructi on Inter natio nal Holdi ngs Limit ed	中国建 筑国际 集团有 限公司	3311 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	342,000	2,070,397.38	0.68
42	China State Const ructi on Inter natio nal Holdi ngs Limit	中国建 筑国际 集团有 限公司	03311 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	318,000	1,925,106.33	0.63

	ed							
43	COSCO SHIPP ING Ports Limit ed	中远海 运港口 有限公 司	1199 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	856,000	3,330,785.02	1.09
43	COSCO SHIPP ING Ports Limit ed	中远海 运港口 有限公 司	01199 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	154,000	599,230.02	0.20
44	Posta l Savin gs Bank Of China Corpo ratio n Limit ed	中国邮 政储蓄 银行股 份有限 公司	1658 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	819,000	3,250,835.00	1.06
44	Posta l Savin gs Bank Of China Corpo ratio n Limit ed	中国邮 政储蓄 银行股 份有限 公司	01658 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	130,000	516,005.56	0.17
45	CGN New Energ y Holdi ngs Co., Ltd.	中国广 核新能 源控股 有限公 司	1811 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	1,820,0 00	3,398,636.15	1.11

45	CGN New Energy Holdings Co., Ltd.	中国广核新能源控股有限公司	01811 HS	深港通 联合市场	中国	196,000	366,006.97	0.12
46	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	1766 HK	香港联合交易所	中国香港	804,000	3,135,430.76	1.02
46	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	01766 HS	深港通 联合市场	中国	142,000	553,770.11	0.18
47	China Foods Ltd.	中国食品有限公司	506 HK	香港联合交易所	中国香港	1,374,000	3,687,567.99	1.20
48	COSCO SHIPPING Development Co., Ltd.	中远海运发展股份有限公司	2866 HK	香港联合交易所	中国香港	4,360,000	3,294,583.86	1.08
48	COSCO SHIPPING Development Co., Ltd.	中远海运发展股份有限公司	02866 HS	深港通 联合市场	中国	309,000	233,492.30	0.08
49	China Tower Corporation Limited	中国铁塔股份有限公司	788 HK	香港联合交易所	中国香港	382,500	2,926,861.50	0.96

	ed							
49	China Tower Corporation Limited	中国铁塔股份有限公司	00788 HS	深港通联合市场	中国	60,500	462,941.49	0.15
50	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	中国人民保险集团股份有限公司	1339 HK	香港联合交易所	中国香港	802,000	3,266,946.60	1.07

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Cssc (Hong Kong) Shipping Company Limited	3877 HK	6,678,540.06	1.73
1	Cssc (Hong Kong) Shipping Company Limited	03877 HS	1,792,060.97	0.46
2	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd.	01138 HS	4,651,274.38	1.20
2	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd.	1138 HK	3,651,818.18	0.95

3	PetroChina Company Limited	00857 HS	4,930,538.99	1.28
3	PetroChina Company Limited	857 HK	2,637,474.68	0.68
4	CNOOC Limited	00883 HS	4,827,914.56	1.25
4	CNOOC Limited	883 HK	2,458,656.98	0.64
5	China Coal Energy Company Limited	01898 HS	3,895,562.93	1.01
5	China Coal Energy Company Limited	1898 HK	2,044,815.95	0.53
6	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	2386 HK	3,805,928.54	0.99
6	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	02386 HS	1,514,039.39	0.39
7	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	01919 HS	2,752,397.66	0.71
7	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	1919 HK	2,069,828.23	0.54
8	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	02388 HS	2,376,151.41	0.62
8	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	2,070,610.74	0.54
9	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	2,460,421.49	0.64
9	China Shenhua Energy Company Limited	01088 HS	1,904,826.45	0.49
10	First Tractor Company Limited	00038 HS	2,167,212.36	0.56
10	First Tractor Company Limited	38 HK	1,717,462.03	0.44
11	China Resources Land Limited	1109 HK	2,118,986.44	0.55
11	China Resources Land Limited	01109 HS	1,634,319.68	0.42
12	China Railway Group Limited	390 HK	2,146,749.14	0.56
12	China Railway Group Limited	00390 HS	1,597,813.69	0.41
13	China National Building Material	3323 HK	2,602,164.89	0.67

	Company Limited			
13	China National Building Material Company Limited	03323 HS	1,095,687.94	0.28
14	Picc Property And Casualty Company Limited	02328 HS	1,762,771.58	0.46
14	Picc Property And Casualty Company Limited	2328 HK	1,474,950.67	0.38
15	Sinotrans Limited	598 HK	1,807,953.24	0.47
15	Sinotrans Limited	00598 HS	1,363,332.22	0.35
16	CITIC Limited	00267 HS	1,823,450.00	0.47
16	CITIC Limited	267 HK	1,223,917.19	0.32
17	China Construction Bank Corporation	939 HK	1,591,962.06	0.41
17	China Construction Bank Corporation	00939 HS	1,406,064.82	0.36
18	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	1,929,518.71	0.50
18	China Petroleum & Chemical Corporation	00386 HS	1,067,387.35	0.28
19	China Everbright Environment Group Limited	257 HK	1,618,887.32	0.42
19	China Everbright Environment Group Limited	00257 HS	1,339,636.58	0.35
20	New China Life Insurance Company Ltd.	01336 HS	1,576,528.60	0.41
20	New China Life Insurance Company Ltd.	1336 HK	1,317,734.01	0.34

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	COSCO SHIPPING	01138 HS	8,346,212.67	2.16

	Energy Transportation Co., Ltd.			
1	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co., Ltd.	1138 HK	150,409.66	0.04
2	PetroChina Company Limited	00857 HS	6,971,377.72	1.81
2	PetroChina Company Limited	857 HK	1,507,686.20	0.39
3	CNOOC Limited	00883 HS	8,407,001.14	2.18
4	China Coal Energy Company Limited	01898 HS	7,174,897.03	1.86
5	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	1919 HK	3,828,074.07	0.99
5	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	01919 HS	2,724,419.93	0.71
6	China Shenhua Energy Company Limited	01088 HS	5,587,979.38	1.45
7	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	02388 HS	5,448,129.17	1.41
8	Cssc (Hong Kong) Shipping Company Limited	03877 HS	4,842,810.05	1.25
9	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	02386 HS	4,572,178.30	1.18
9	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	2386 HK	136,285.27	0.04
10	First Tractor Company Limited	00038 HS	4,675,021.10	1.21
11	Bank of China Limited	03988 HS	4,647,062.55	1.20
12	China Citic Bank Corporation Limited	00998 HS	3,919,192.20	1.01
12	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	707,319.28	0.18
13	China Resources Land Limited	01109 HS	4,406,882.47	1.14

14	China Railway Group Limited	00390 HS	4,277,976.98	1.11
15	China National Building Material Company Limited	03323 HS	2,608,639.34	0.68
15	China National Building Material Company Limited	3323 HK	1,525,629.92	0.40
16	Sinotrans Limited	00598 HS	3,635,956.77	0.94
16	Sinotrans Limited	598 HK	431,598.79	0.11
17	China Construction Bank Corporation	00939 HS	3,928,478.14	1.02
18	China Petroleum & Chemical Corporation	00386 HS	3,842,601.13	0.99
19	China Everbright Environment Group Limited	00257 HS	3,813,981.02	0.99
20	CITIC Limited	00267 HS	3,797,613.50	0.98

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	153,290,036.58
卖出收入（成交）总额	189,627,663.76

注：买入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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中远海运能源运输股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国营口海事局、中华人民共和国舟山海事局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	674.96
2	应收清算款	3,993,353.19
3	应收股利	4,177,321.21
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,078,311.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,249,660.67

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	9,431	12,378.77	10,000,000.96	8.57%	106,744,142.34	91.43%
中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C	39,344	4,566.52	2,594,753.87	1.44%	177,070,415.74	98.56%
合计	48,775	6,077.07	12,594,754.83	4.25%	283,814,558.08	95.75%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	403,986.40	0.35%
	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C	1,163,943.08	0.65%
	合计	1,567,929.48	0.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	0
	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	0~10
	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	3.37%	10,000,000.00	3.37%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	3.37%	10,000,000.00	3.37%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C
基金合同生效日（2024 年 7 月 1 日） 基金份额总额	16,591,528.35	23,964,698.96
本报告期期初基金份额总额	102,761,325.53	222,585,416.60
本报告期基金总申购份额	91,575,722.26	157,565,607.94
减：本报告期基金总赎回份额	77,592,904.49	200,485,854.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	116,744,143.30	179,665,169.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月，朱群力同志不再担任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务，由王艳同志接任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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，本基金托管人的托管业务部门未出现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，本基金托管人的相关从业人员未出现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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
申万宏源证券	1	251,203,753.42	73.25	62,800.69	69.29	—
CLSA Limited	2	34,079,921.32	9.94	10,224.07	11.28	—
Haitong International Securities Co Ltd	2	24,021,082.41	7.00	7,206.36	7.95	—
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	2	21,564,809.88	6.29	6,469.44	7.14	本报告期新增 2 个
China International Capital Corp HK Sec Ltd	2	10,984,820.51	3.20	3,295.43	3.64	—
UBS SECURITIES ASIA LTD.	2	1,063,312.78	0.31	637.99	0.70	—
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	2	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	本报告期新增 1 个

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corp HK Sec Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES ASIA LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	3,640,669.65	100.00	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-13
2	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-01-16
3	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-19
4	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
5	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
6	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-02-10
7	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-02-11
8	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-02-11
9	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-10
10	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-03-13
11	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-16
12	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

13	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
14	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
15	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-04-14
16	中欧基金管理有限公司关于调整中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）收益分配原则并相应修订基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2026-04-21
17	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）更新招募说明书（2026 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2026-04-21
18	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2026-04-21
19	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2026-04-21
20	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
21	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
22	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
23	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-05-21
24	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
25	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）分红公告	中国证监会指定媒介	2026-06-12

§ 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