中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）
2023年中期报告

2023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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2023年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023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 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7

§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 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 19

§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 39
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 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
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 42

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.....42
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.....42
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.....42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....42
7.12 本报告期投资基金情况.....43
7.13 投资组合报告附注.....46

§8 基金份额持有人信息.....47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....47
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.....48

§9 开放式基金份额变动.....48

§10 重大事件揭示.....48

10.1 基金份额持有人大会决议.....48
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.....49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....49
10.4 基金投资策略的改变.....49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....49
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....49
10.9 其他重大事件.....50

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....52

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.....52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....52

§12 备查文件目录.....52

12.1 备查文件目录.....52
12.2 存放地点.....52
12.3 查阅方式.....52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）	
基金主代码	013763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年1月26日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	197,350,896.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）A	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	013763	013764
报告期末下属分级基金的份额总额	189,381,110.07份	7,969,786.54份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。 战略资产配置策略（SAA）是决定基金长期收益率和波动率的关键，也是基金力争实现将基金投资组合长期波动率控制在合适水平这一投资目标的核心。本基金的战略资产配置策略（SAA）将从国内股票和债券市场的风险收益特征出发，通过综合分析宏观政策、经济周期、行业发展趋势、市场流动性水平，投资人风险收益偏好等因素，以分散投资的方式，锚定长期目标波动率，进行有效的长期资产配置。 本基金的战术资产配置策略（TAA）是指会更多着眼于在充分研究分析诸如细分经济周期、各项经济指标、货币政策变化、利率水平、信用利差变化、突发事件性因素等中短期市场变化的基础上，根据具体不同市场形势的具体转变而对基金各类资产组合既定长期投资比例所进行的动态调整，力争使基金投资组合的长期波动率与目标值不发生重大偏离。通过战术资产配置，本基金将在战略资产配置层面实现对长期资产配置的优化，力争获取超额回报。 2、基金投资策略 对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选，其中：

	对货币型基金，主要从基金规模、流动性、风险、收益率等层面进行评估，以满足流动性管理要求为主。 对于指数基金、ETF、大宗商品基金等被动管理的公募基金，本基金主要通过其配合市场、行业板块轮动等进行优选配置，增强投资回报。本基金使用日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差等指标评估其投资风格、收益情况、波动性以及回撤等并考虑子基金的基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素，选择优质标的进行投资。 对于主动管理的公募非货币型基金，本基金通过基金评价研究机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法，进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的进行定性分析，并做出最终的投资决策。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金还可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。

注：自2023年5月5日起，中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）的业绩比较基准由“中证800指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×20%”，变更为“中证偏股型基金指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*20%”。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	朱广科
	联系电话	021-68609600	0574-87050338
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody-audit@nbcb.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	0574-83895886
传真		021-33830351	0574-89103213
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码		200120	315100
法定代表人		窦玉明	陆华裕

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）A	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）C
本期已实现收益	-13,700,696.11	-614,810.13
本期利润	-7,129,581.08	-315,180.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0356	-0.0361
本期加权平均净值利润率	-4.10%	-4.19%
本期基金份额净值增长率	-4.34%	-4.72%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-32,775,766.21	-1,454,123.63
期末可供分配基金份额利润	-0.1731	-0.1825
期末基金资产净值	156,605,343.86	6,515,662.91
期末基金份额净值	0.8269	0.8175
3.1.3累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.31%	-18.25%

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、所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

中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.45%	0.85%	1.18%	0.71%	0.27%	0.14%
过去三个月	-5.68%	0.74%	-2.53%	0.62%	-3.15%	0.12%
过去六个月	-4.34%	0.73%	1.79%	0.63%	-6.13%	0.10%
过去一年	-18.41%	0.85%	-8.47%	0.75%	-9.94%	0.10%
自基金合同生效起至今	-17.31%	0.93%	-11.35%	0.91%	-5.96%	0.02%

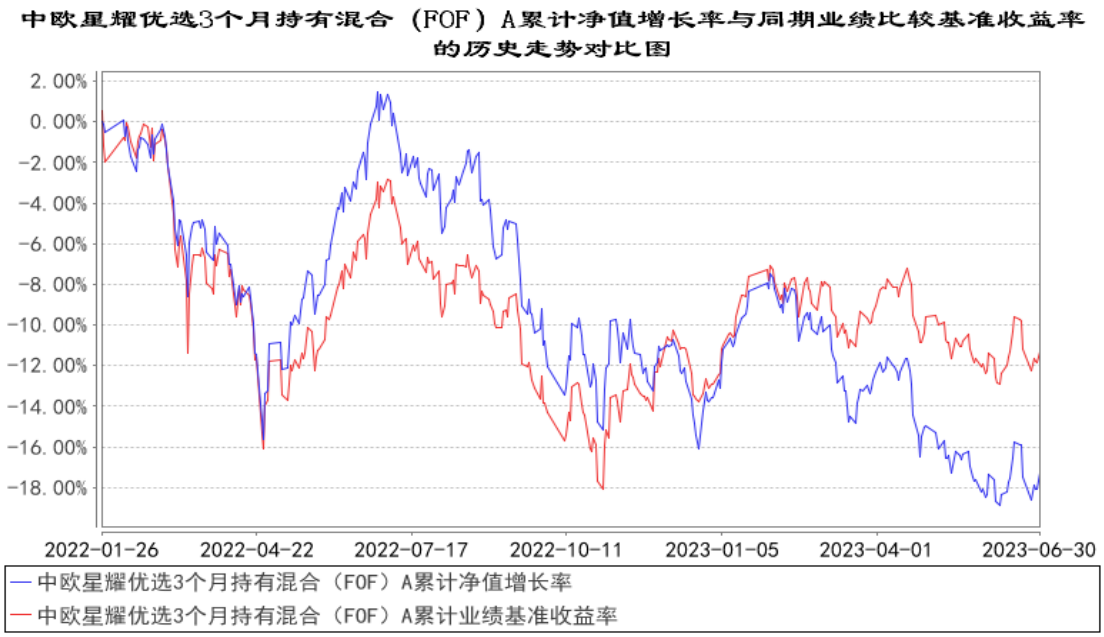
注：本基金业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C

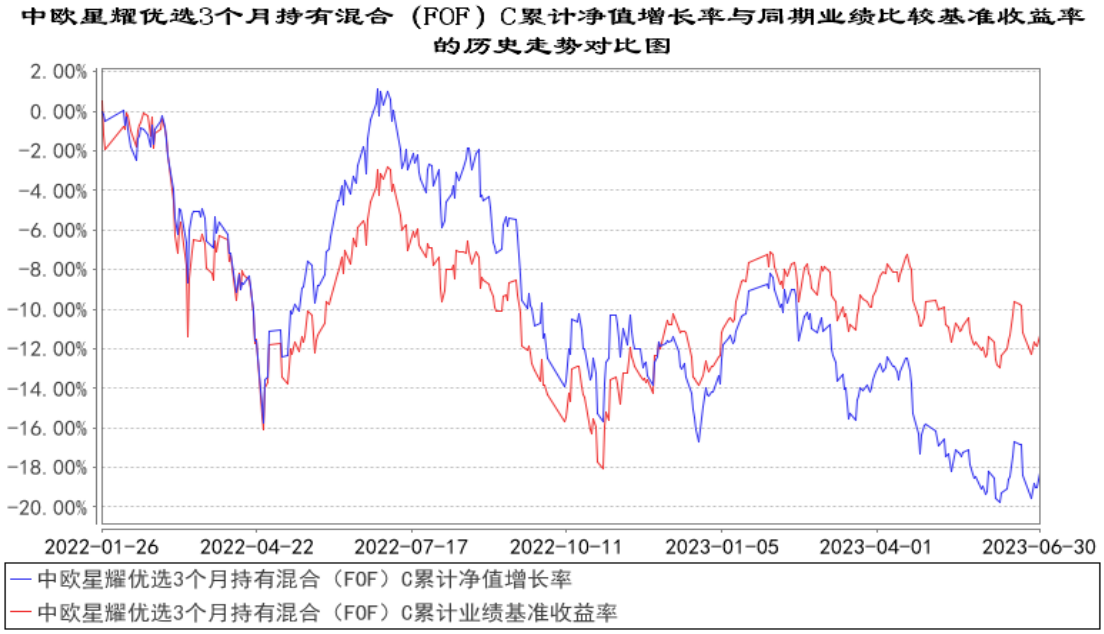
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.38%	0.85%	1.18%	0.71%	0.20%	0.14%
过去三个月	-5.87%	0.74%	-2.53%	0.62%	-3.34%	0.12%
过去六个月	-4.72%	0.72%	1.79%	0.63%	-6.51%	0.09%
过去一年	-19.06%	0.85%	-8.47%	0.75%	-10.59%	0.10%
自基金合同生效起至今	-18.25%	0.93%	-11.35%	0.91%	-6.90%	0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 1 月 26 日，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符合基金合同约定。2023 年 5 月 5 日起组合业绩比较基准变更为中证偏股型基金指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 1 月 26 日，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符合基金合同约定。2023 年 5 月 5 日起组合业绩比较基准变更为中证偏股型基金指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。

§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和中欧基金国际有限公司。截至2023年6月30日，本基金管理人共管理150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		
侯丹琳	基金经理	2022-07-01	-	6年	历任华夏基金管理有限公司研究员。2020-12-08加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
桑磊	基金经理	2022-01-26	2023-03-01	15年	历任平安资产管理公司风险管理、组合投资经理，中国平安人寿保险股份有限公司资产配置管理岗、助理资产配置经理，中国平安保险（集团）股份有限公司首席投资官办公室助理资产策略经理，众安在线财产保险股份有限公司资产管理部负责人，永诚保险资产管理有限公司（筹）组合投资经理。2016-12-01加入中欧基金管理有限公司，历任配置研究员、投资经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有69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

“市场的经济复苏预期围绕现实摆动”这一句话就基本解释了上半年的行情演绎，对经济的乐观预期引领了1月份的大涨，随后市场进入震荡格局，随着对现实的逐步认知，悲观预期加剧，市场在5月、6月进入预期向下修正的时间。在这样一个背景下，市场整体呈现主题投资为主的状态，4月“中特估”和“人工智能”两大主题演绎达到阶段性顶峰，并在5月震荡下跌，5月末“人工智能”主题开始重新上涨延续至6月尾声，其中相对有基本面支撑的通信板块表现最为强势，存量市场下其他板块难以形成趋势性机会。从宽基来看，上半年小盘、红利风格表现突出，国证2000、中证1000、上证红利分别涨7.08%、5.10%、5.03%，创业板指、上证50、恒生科技表现不佳，分别跌-5.61%、-5.43%、-5.27%；中信一级行业涨跌差异较大，表现最好的是通信、传媒、计算机、家电、机械，其中通信涨幅达到45.41%，而消费者服务、房地产、综合跌幅均在10%以上，行业首尾收益率相差73.33%，行业分化程度从历史看也是较高位置。上半年国内债券市场在充足流动性支持及复苏力度担忧下延续牛市格局；美股在人工智能相关标的的支持下延续突出表现，港股跟随国内市场下跌；美元指数继续盘整，中期有向下压力，而人民币相对美元持续贬值；黄金呈现震荡向上，而铜在经济预期扰动下呈震荡格局，原油延续低位震荡，美债收益率震荡向上。

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-4.34%，同期业绩比较基准收益率为1.79%；基金C

类份额净值增长率为-4.72%，同期业绩比较基准收益率为1.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下，市场对经济预期转弱，股债收益差也在一倍标准差外，7月底的政治局会议呵护之意凸显，往后看下半年，随着库存周期见底、政策逐步发力，我们认为权益市场的机会正逐步临近，秉承整体均衡、适度偏离的原则，我们会优选更多偏顺周期的经理逐步配置进组合中，以期在市场向上中获得更多弹性。当然政策底和市场底之间尚有距离，基本面的变化也不是一蹴而就的，我们会做好节奏把握、寻机调整。本基金主要持仓仍然坚持长期资产配置策略，虽然上半年股票市场分化剧烈、行业间冰火两重天，但我们依然坚持以把握基本面为核心，放弃难以把握的主题行情，仅做适度均衡操作。一季度我们逐步减持右侧趋势型选手，逐步增加左侧性价比选手，二季度我们维持主动权益基金仓位稳定，ETF部分做适度轮动增强收益。本基金投资的权益类资产以长期业绩优异的主动权益型基金为主，交易便捷的指数型基金为辅，也直接投资了部分个股、转债作为补充。

作为主要投资权益型基金的FOF产品，本基金致力于解决投资者在权益基金投资中面临的资产配置、基金选择、持有体验等难题，打造投资目标清晰、投资策略多元、投资行为稳健的FOF产品，力争满足投资者的权益投资需求。投资策略上，依托中欧优质的权益型基金，从子基金选择、大类资产配置、行业风格选择等多层面优化投资组合，采取多元的投资策略，综合考虑市场机会、长期投资目标、中短期组合波动性等，在实现长期投资目标的同时力争控制基金收益的波动性，致力于提升持有体验。投资组合构建上，采取核心+卫星的策略，核心策略上，从投资目标、投资策略、投资行为三个维度对子基金进行研究，选择投资目标清晰合理，投资策略和投资行为有效并且持续的子基金，在多变的市场环境中不会集中投资单一市场风格或者行业赛道，而是借鉴田径比赛的理念，在各投资策略的子基金中选择优秀的基金经理构建相对均衡的组合，追求长期好于相应基金品类市场平均水平的表现。在把均衡的核心配置作为压舱石的基础上，根据市场情况，分别立足长期特征、中期基本面、短期机会，把握大类资产配置以及行业风格的投资机会。立足长期特征，把握各大类资产和行业风格的长期收益风险特征，根据各大类资产和行业风格的长期特征进行适当投资。立足中期基本面，将经济、流动性、估值相结合判断各大类资产的中期投资机会，并判断各行业风格的中期景气度。立足短期机会，寻找各大类资产及行业风格的投资机会，提升组合投资收益，降低组合投资风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人在中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下称"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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中

的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、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：中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,791,872.35	5,803,518.05
结算备付金		644,229.74	275,235.87
存出保证金		74,007.61	46,983.94
交易性金融资产	6.4.7.2	159,086,610.25	193,787,316.27
其中：股票投资		3,291,233.00	1,950,123.00
基金投资		142,268,721.53	177,554,259.02
债券投资		13,526,655.72	14,282,934.25
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		1,285.90	1,500,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		12,284.42	1,013.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	19,735.48	34,862.03
资产总计		164,630,025.75	201,448,929.69
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023年6月30日**	**上年度末 2022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		-	8,007,318.35
应付清算款		-	1,905,816.84
应付赎回款		1,222,404.26	706,855.47
应付管理人报酬		104,742.62	113,056.56
应付托管费		26,087.36	31,533.09
应付销售服务费		4,285.38	5,808.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11.20	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	151,488.16	175,401.78
负债合计		1,509,018.98	10,945,790.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	197,350,896.61	220,460,486.32
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-34,229,889.84	-29,957,347.13
净资产合计		163,121,006.77	190,503,139.19
负债和净资产总计		164,630,025.75	201,448,929.69

注： 1.报告截止日2023年06月30日，基金份额总额197,350,896.61份，其中下属A类基金份额净值为人民币0.8269元，基金份额总额189,381,110.07份；下属C类基金份额净值为人民币0.8175元，基金份额总额7,969,786.54份。

2.本基金基金合同于2022年01月26日生效，上年度可比期间自2022年01月26日至2022年06月30日，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日
一、营业总收入		-6,409,336.44	1,354,234.04
1.利息收入		15,759.30	21,185.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,759.30	21,185.04
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		-	-
证券出借利息收		-	-

入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,463,453.09	-3,015,476.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,008,945.36	65,044.67
基金投资收益	6.4.7.11	-13,153,201.19	-3,276,586.32
债券投资收益	6.4.7.12	-211,986.29	177,360.33
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	910,679.75	18,704.93
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	6,870,744.78	3,968,586.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	167,612.57	379,939.16
减：二、营业总支出		1,035,425.02	693,096.80
1．管理人报酬		657,145.16	369,091.01
2．托管费		173,490.53	205,569.41
3．销售服务费		29,931.27	40,021.05
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		81,537.46	-
其中：卖出回购金融资产支出		81,537.46	-
6．信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7．税金及附加		18.04	15.33
8．其他费用	6.4.7.20	93,302.56	78,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,444,761.46	661,137.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,444,761.46	661,137.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,444,761.46	661,137.24

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	220,460,486.32	-	-29,957,347.13	190,503,139.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	220,460,486.32	-	-29,957,347.13	190,503,139.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,109,589.71	-	-4,272,542.71	-27,382,132.42
（一）、综合收益总额	-	-	-7,444,761.46	-7,444,761.46
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-23,109,589.71	-	3,172,218.75	-19,937,370.96
其中：1.基金申购款	831,092.88	-	-101,004.93	730,087.95
2.基金赎回款	-23,940,682.59	-	3,273,223.68	-20,667,458.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	197,350,896.61	-	-34,229,889.84	163,121,006.77
项目	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022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	266,218,393.04	-	-	266,218,393.04

资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	266,218,393.04	-	-	266,218,393.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,989,574.76	-	3,246,799.91	-18,742,774.85
（一）、综合收益总额	-	-	661,137.24	661,137.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-21,989,574.76	-	2,585,662.67	-19,403,912.09
其中：1.基金申购款	218,968.24	-	-10,944.47	208,023.77
2.基金赎回款	-22,208,543.00	-	2,596,607.14	-19,611,935.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	244,228,818.28	-	3,246,799.91	247,475,618.19

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	杨毅	王音然
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

中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2021]2162号《关于准予中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）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《中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集266,187,319.23元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第61362990_B07号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于2022年1月26日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为266,218,393.04份基金份额，其中包含认购资金利息折合31,073.81份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为253,273,462.41份，包含认购利息折合29,665.18份；C类基金的基金份额总额为12,944,930.63份，包含认购利息折合1,408.63份。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧星耀优选3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金、香港互认基金）、股票（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金、香港互认基金）；本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为60%-95%，其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：(1)基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；(2)基金最近4期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于60%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值

的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	4,791,872.35
等于：本金	4,791,004.29
加：应计利息	868.06
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,791,872.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,344,543.79	-	3,291,233.00	-53,310.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,395,523.06	138,898.42	13,526,655.72	-7,765.76
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,395,523.06	138,898.42	13,526,655.72	-7,765.76
资产支持证券		-	-	-	-
基金		151,655,311.60	-	142,268,721.53	-9,386,590.07
其他		-	-	-	-
合计		168,395,378.45	138,898.42	159,086,610.25	-9,447,666.62

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	19,735.48
待摊费用	-
合计	19,735.48

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	67,185.60
其中：交易所市场	67,185.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	151,488.16

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,607,794.03	210,607,794.03
本期申购	751,297.86	751,297.86
本期赎回（以“-”号填列）	-21,977,981.82	-21,977,981.82
本期末	189,381,110.07	189,381,110.07

中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,852,692.29	9,852,692.29
本期申购	79,795.02	79,795.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,962,700.77	-1,962,700.77
本期末	7,969,786.54	7,969,786.54

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

中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,903,780.16	-12,654,409.95	-28,558,190.11
本期利润	-13,700,696.11	6,571,115.03	-7,129,581.08
本期基金份额交易产生的变动数	2,343,762.24	568,242.74	2,912,004.98
其中：基金申购款	-75,731.50	-16,896.49	-92,627.99
基金赎回款	2,419,493.74	585,139.23	3,004,632.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,260,714.03	-5,515,052.18	-32,775,766.21

中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-808,539.18	-590,617.84	-1,399,157.02
本期利润	-614,810.13	299,629.75	-315,180.38
本期基金份额交易产生的变动数	201,833.70	58,380.07	260,213.77
其中：基金申购款	-7,730.73	-646.21	-8,376.94
基金赎回款	209,564.43	59,026.28	268,590.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,221,515.61	-232,608.02	-1,454,123.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	12,476.08
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	2,856.93
其他	426.29
合计	15,759.30

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	54,465,799.24
减：卖出股票成本总额	55,330,287.32
减：交易费用	144,457.28
买卖股票差价收入	-1,008,945.36

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	320,394,622.09
减：卖出/赎回基金成本总额	333,332,585.38
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	215,237.90
基金投资收益	-13,153,201.19

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	107,769.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-319,756.27
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	-211,986.29

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,371,019.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,386,331.87
减：应计利息总额	303,813.10
减：交易费用	630.85
买卖债券差价收入	-319,756.27

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,993.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	859,686.39
合计	910,679.75

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	6,870,744.78
股票投资	39,027.21
债券投资	20,234.24
资产支持证券投资	-
基金投资	6,811,483.33
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	6,870,744.78

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,082.55

销售服务费返还	166,530.02
合计	167,612.57

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	229,779.51
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,089,093.35
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	179,213.61

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费及托管费等进行的估算，上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	93,302.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自2023年5月11日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及7名自然人股东。

2、自2023年6月1日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：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）19名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

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、登记机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	657,145.16	369,091.01
其中：支付销售机构的客户维护费	424,328.96	415,781.52

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0)的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	173,490.53	205,569.41

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

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	本期 2023年1月1日至2023年6月30日

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）A	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）C	合计
宁波银行	-	28,662.31	28,662.31
合计	-	28,662.31	28,662.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）A	中欧星耀优选3个月持有混合（FOF）C	合计
宁波银行	-	39,445.53	39,445.53
合计	-	39,445.53	39,445.53

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.80%÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022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
宁波银行股份有限公司	4,791,872.35	12,476.08	4,831,351.97	20,293.53

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人中欧基金管理有限公司所管理的基金合计人民币34,534,954.94元。占本基金资产净值的比例为21.17%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月26日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	5,051.46	14,647.63
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	166,530.02	330,908.50
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	366,070.30	812,831.81
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	61,011.52	140,660.02

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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（2023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2023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2023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中基金(FOF)，风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金是基金中基金，灵

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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于约定开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资

品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。在开放期，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2023年06月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、公开募集的证券投资基金、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，证券投资基金可在基金销售机构申购、赎回，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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,791,872.35	-	-	-	4,791,872.35
结算备付金	644,229.74	-	-	-	644,229.74
存出保证金	74,007.61	-	-	-	74,007.61
交易性金融资产	12,866,940.07	-	659,715.65	145,559,954.53	159,086,610.25
应收申购款	-	-	-	12,284.42	12,284.42
应收清算款	-	-	-	1,285.90	1,285.90
其他资产	-	-	-	19,735.48	19,735.48
资产总计	18,377,049.77	-	659,715.65	145,593,260.33	164,630,025.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,222,404.26	1,222,404.26
应付管理人报酬	-	-	-	104,742.62	104,742.62
应付托管费	-	-	-	26,087.36	26,087.36
应付销售服务费	-	-	-	4,285.38	4,285.38
应交税费	-	-	-	11.20	11.20
其他负债	-	-	-	151,488.16	151,488.16
负债总计	-	-	-	1,509,018.98	1,509,018.98
利率敏感度缺口	18,377,049.77	-	659,715.65	144,084,241.35	163,121,006.77
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,803,518.05	-	-	-	5,803,518.05
结算备付金	275,235.87	-	-	-	275,235.87
存出保证金	46,983.94	-	-	-	46,983.94
交易性金融资产	14,282,934.25	-	-	179,504,382.02	193,787,316.27
应收清算款	-	-	-	1,500,000.00	1,500,000.00
应收申购款	-	-	-	1,013.53	1,013.53
其他资产	-	-	-	34,862.03	34,862.03
资产总计	20,408,672.11	-	-	181,040,257.58	201,448,929.69
负债					
卖出回购金融资产款	8,007,318.35	-	-	-	8,007,318.35
应付清算款	-	-	-	1,905,816.84	1,905,816.84
应付赎回款	-	-	-	706,855.47	706,855.47
应付管理人报酬	-	-	-	113,056.56	113,056.56
应付托管费	-	-	-	31,533.09	31,533.09
应付销售服务费	-	-	-	5,808.41	5,808.41
其他负债	-	-	-	175,401.78	175,401.78
负债总计	8,007,318.35	-	-	2,938,472.15	10,945,790.50
利率敏感度缺口	12,401,353.76	-	-	178,101,785.43	190,503,139.19

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2023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8.29%（2022年12月31日：7.50%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金及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 2023年6月30日		上年度末 2022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	3,291,233.00	2.02	1,950,123.00	1.02
交易性金融资产－基金投资	142,268,721.53	87.22	177,554,259.02	93.20
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	145,559,954.53	89.23	179,504,382.02	94.22

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 （2023年6月30日）	上年度末 （2022年12月

			31日 ）
	业绩比较基准上升5%	8,571,054.25	9,471,980.59
	业绩比较基准下降5%	-8,571,054.25	-9,471,980.59

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	146,851,179.76	179,504,382.02
第二层次	12,235,430.49	14,282,934.25
第三层次	-	-
合计	159,086,610.25	193,787,316.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。本财务报表已于2023年8月30日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,291,233.00	2.00
	其中：股票	3,291,233.00	2.00
2	基金投资	142,268,721.53	86.42
3	固定收益投资	13,526,655.72	8.22
	其中：债券	13,526,655.72	8.22
	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	5,436,102.09	3.30
8	其他各项资产	107,313.41	0.07
9	合计	164,630,025.75	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	-	-
B	采矿业	1,531,587.00	0.94
C	制造业	1,759,646.00	1.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,291,233.00	2.02

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	300750	宁德时代	3,800	869,402.00	0.53
2	600938	中国海油	45,300	820,836.00	0.50
3	600031	三一重工	26,000	432,380.00	0.27
4	601857	中国石油	51,300	383,211.00	0.23
5	000063	中兴通讯	7,500	341,550.00	0.21
6	600028	XD中国石化	51,500	327,540.00	0.20
7	300973	立高食品	1,700	116,314.00	0.07

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	300750	宁德时代	4,417,491.00	2.32
2	002567	唐人神	4,000,258.00	2.10
3	601857	中国石油	3,990,628.00	2.09
4	001979	招商蛇口	3,845,891.00	2.02
5	603477	巨星农牧	3,156,490.00	1.66
6	601800	中国交建	2,131,998.00	1.12
7	600011	华能国际	2,073,384.81	1.09
8	600547	山东黄金	2,064,317.00	1.08
9	000063	中兴通讯	1,977,436.00	1.04

10	601601	中国太保	1,808,831.00	0.95
11	600975	新五丰	1,782,025.00	0.94
12	601390	中国中铁	1,750,899.54	0.92
13	002174	游族网络	1,746,000.00	0.92
14	002555	三七互娱	1,744,546.00	0.92
15	600938	中国海油	1,731,974.00	0.91
16	600489	中金黄金	1,644,330.08	0.86
17	601111	中国国航	1,239,591.00	0.65
18	002714	牧原股份	1,239,073.10	0.65
19	688981	中芯国际	1,062,101.98	0.56
20	600031	三一重工	907,731.00	0.48

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,114,863.00	2.16
2	001979	招商蛇口	3,819,754.00	2.01
3	601857	中国石油	3,603,693.00	1.89
4	002567	唐人神	3,572,549.00	1.88
5	603477	巨星农牧	3,081,901.00	1.62
6	600011	华能国际	2,177,088.00	1.14
7	601800	中国交建	1,983,485.00	1.04
8	601601	中国太保	1,883,363.00	0.99
9	600547	山东黄金	1,877,717.00	0.99
10	002174	游族网络	1,853,368.00	0.97
11	000063	中兴通讯	1,701,752.00	0.89
12	600975	新五丰	1,686,778.00	0.89
13	002555	三七互娱	1,669,381.00	0.88
14	600489	中金黄金	1,641,557.20	0.86
15	601390	中国中铁	1,513,123.00	0.79
16	002714	牧原股份	1,294,257.00	0.68
17	601111	中国国航	1,194,858.00	0.63
18	688981	中芯国际	1,051,978.41	0.55
19	600938	中国海油	939,300.00	0.49
20	601633	长城汽车	881,593.00	0.46

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	56,632,370.11
卖出股票收入（成交）总额	54,465,799.24

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,235,430.49	7.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,291,225.23	0.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,526,655.72	8.29

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22国债23	121,000	12,235,430.49	7.50
2	110090	爱迪转债	4,730	659,715.65	0.40
3	127036	三花转债	4,410	631,509.58	0.39

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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000756	建信潜力新蓝筹股票A	契约型开放式	3,423,902.23	11,452,952.96	7.02	否
2	013280	宏利睿智稳健混合C	契约型开放式	10,007,960.67	11,015,762.31	6.75	否
3	015561	长城双动力混合C	契约型开放式	6,524,018.99	9,993,492.29	6.13	否
4	090013	大成竞争优势混合A	契约型开放式	5,510,683.80	8,802,766.30	5.40	否
5	004235	中欧价值智选混合C	契约型开放式	1,814,542.48	7,014,476.86	4.30	是
6	002685	中欧丰泓沪港深灵活配置混合A	契约型开放式	6,214,524.59	6,961,510.45	4.27	是
7	005765	中欧明睿新常态混合C	契约型开放式	2,633,324.11	6,128,008.54	3.76	是

8	515790	华泰柏瑞中证光伏产业ETF	交易型开放式	4,907,269.00	6,099,735.37	3.74	否
9	004232	中欧价值发现混合C	契约型开放式	2,618,015.00	5,690,255.60	3.49	是
10	001018	易方达新经济混合	契约型开放式	1,544,187.26	5,616,209.06	3.44	否
11	006567	中泰星元灵活配置混合A	契约型开放式	2,050,787.91	4,883,336.17	2.99	否
12	159974	富国央企创新ETF	交易型开放式	3,290,100.00	4,869,348.00	2.99	否
13	001856	易方达环保主题混合	契约型开放式	1,206,870.14	4,485,936.31	2.75	否
14	012778	中欧养老混合C	契约型开放式	1,332,615.94	4,244,515.03	2.60	是
15	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	1,709,104.14	4,185,596.04	2.57	否
16	515250	富国中证智能汽车主题ETF	交易型开放式	4,060,300.00	3,662,390.60	2.25	否
17	014349	银华鑫锐灵活配置混合(LOF)C	契约型开放式	2,110,062.01	3,437,291.01	2.11	否
18	512880	国泰中	交易	3,673,700.00	3,229,182.30	1.98	否

		证全指证券公司ETF	型开放式				
19	512170	华宝中证医疗ETF	交易型开放式	7,512,900.00	3,177,956.70	1.95	否
20	012930	中庚价值先锋股票	契约型开放式	2,630,878.75	3,014,723.96	1.85	否
21	003166	鹏华弘嘉混合C	契约型开放式	1,197,055.47	2,881,911.04	1.77	否
22	013142	华商乐享互联灵活配置混合C	契约型开放式	1,081,200.50	2,468,380.74	1.51	否
23	004815	中欧红利优享灵活配置混合C	契约型开放式	1,838,799.13	2,403,862.10	1.47	是
24	011431	宏利消费服务混合A	契约型开放式	2,900,733.18	2,206,007.58	1.35	否
25	006229	中欧医疗创新股票C	契约型开放式	1,596,342.69	2,092,326.36	1.28	是
26	010655	天弘医药创新混合C	契约型开放式	2,518,430.76	2,063,602.16	1.27	否
27	001473	建信大安全战略精选股票	契约型开放式	669,217.82	1,837,471.37	1.13	否
28	161834	银华鑫	契约	1,105,567.58	1,816,447.53	1.11	否

		锐灵活配置混合(LOF)A	型开放式				
29	515030	华夏中证新能源汽车ETF	交易型开放式	1,083,000.00	1,666,737.00	1.02	否
30	005535	泰信竞争优选混合	契约型开放式	958,153.41	1,646,299.19	1.01	否
31	512480	国联安中证全指半导体ETF	交易型开放式	1,814,400.00	1,622,073.60	0.99	否
32	159997	天弘中证电子ETF	交易型开放式	1,614,300.00	1,598,157.00	0.98	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名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。

7.13.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.13.3 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	74,007.61
2	应收清算款	1,285.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,284.42
6	其他应收款	19,735.48
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,313.41

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110090	爱迪转债	659,715.65	0.40
2	127036	三花转债	631,509.58	0.39

7.13.5 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。

7.13.6 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
中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A	1,744	108,590.09	0.00	0.00%	189,381,110.07	100.00%
中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C	139	57,336.59	0.00	0.00%	7,969,786.54	100.00%
合计	1,883	104,806.64	0.00	0.00%	197,350,896.61	100.00%

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	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A	396,289.79	0.21%
	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C	-	-
	合计	396,289.79	0.20%

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	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A	-
	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A	10~50
	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C	-
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）A	中欧星耀优选 3 个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日（2022 年 1 月 26 日）基金份额总额	253,273,462.41	12,944,930.63
本报告期期初基金份额总额	210,607,794.03	9,852,692.29
本报告期基金总申购份额	751,297.86	79,795.02
减：本报告期基金总赎回份额	21,977,981.82	1,962,700.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	189,381,110.07	7,969,786.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券	1	67,498,414.45	60.76	49,361.21	60.76	-
中金公司	1	43,599,754.90	39.24	31,884.20	39.24	-
安信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

						1 个

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

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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(%)
招商证券	24,155,626.68	86.61	86,000,000.00	100.00	-	-	326,956,584.44	80.47
中金公司	3,732,938.70	13.39	-	-	-	-	79,338,876.30	19.53
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办	中国证监会指定媒介	2023-02-17

	公地址变更公告		
4	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2023-03-02
5	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)更新招募说明书（2023 年 3 月）	中国证监会指定媒介	2023-03-03
6	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-03-03
7	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
10	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
11	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2023-05-05
12	中欧基金管理有限公司关于修改中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）业绩比较基准的公告	中国证监会指定媒介	2023-05-05
13	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)更新招募说明书（2023 年 5 月）	中国证监会指定媒介	2023-05-05
14	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-05-05
15	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
16	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）相关批准文件

2、《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》

3、《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》

4、《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日