

中欧港股数字经济混合型发起式证券投资  
基金（QDII）  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 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       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>13</b> |
| 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的真实、准确和完整发表意见      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布              | 37        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合                      | 38        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....     | 38        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                   | 42        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 45        |
| 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 .....    | 45        |
| 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 ..... | 45        |
| 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 ..... | 45        |
| 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 .....   | 45        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 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 .....      | 47        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 47        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>48</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>48</b> |
| 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 .....      | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 49        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 49        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 49        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>53</b> |
| 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 .....    | 53        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 53        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 54        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                            |                     |
|-----------------|----------------------------|---------------------|
| 基金名称            | 中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII） |                     |
| 基金简称            | 中欧港股数字经济混合发起（QDII）         |                     |
| 基金主代码           | 015884                     |                     |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式、发起式                |                     |
| 基金合同生效日         | 2022 年 10 月 28 日           |                     |
| 基金管理人           | 中欧基金管理有限公司                 |                     |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司               |                     |
| 报告期末基金份额总额      | 49,104,742.90 份            |                     |
| 基金合同存续期         | 不定期                        |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A        | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C |
| 下属分级基金的交易代码     | 015884                     | 015885              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 19,499,132.08 份            | 29,605,610.82 份     |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要通过投资港股数字经济主题的股票，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | <p>本基金为混合型基金，以股票投资为主，本基金业绩比较基准中股票资产部分以恒生科技指数为基准指数，对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。</p> <p>本基金所定义的港股数字经济主题是指在香港市场上市的且主营业务符合数字经济主题的公司所发行的证券。关于数字经济的定义，本基金参照国务院 2021 年发布的《中华人民共和国国民经济和社会发展第十四个五年规划和 2035 年远景目标纲要》中的表述，即通过充分发挥海量数据和丰富应用场景优势，促进数字技术与实体经济深度融合，赋能传统产业转型升级并催生新产业新业态新模式的经济行为。</p> |
| 业绩比较基准 | 恒生科技指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%  |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>本基金将投资于港股通标的股票，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>此外，本基金主要投资于境外市场，除了需要承担与境内证券投</p>  |

|  |   |
|--|---|
|  | 资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的投资风险。 |
|--|---|

### 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                               | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 黎忆海                                      | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-68609600                             | (010) 66105799      |
|             | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com                       | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-68609700、400-700-9700                | 95588               |
| 传真          |      | 021-33830351                             | (010) 66105798      |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层             | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码        |      | 200120                                   | 100140              |
| 法定代表人       |      | 窦玉明                                      | 陈四清                 |

### 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      | The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited |
|      | 中文 | 无      | 香港上海汇丰银行有限公司  |
| 注册地址 |    | —      | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦                                     |
| 办公地址 |    | —      | 香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼                                    |
| 邮政编码 |    | —      | 999077  |

### 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。    |

### 2.6 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |                     |
|---------------|-------------------------------------|---------------------|
|               | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A                 | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C |
| 本期已实现收益       | 378,857.79                          | 47,798.26           |
| 本期利润          | -731,336.25                         | -987,856.19         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0365                             | -0.0333             |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.31%                              | -3.07%              |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.36%                              | -2.86%              |
| 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      | 466,478.99                          | 537,061.38          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0239                              | 0.0181              |
| 期末基金资产净值      | 21,130,935.10                       | 31,877,620.89       |
| 期末基金份额净值      | 1.0837                              | 1.0767              |
| 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   | 8.37%                               | 7.67%               |

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

中欧港股数字经济混合发起(QDII)A

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

|            | 值增长率①  | 增长率标准差② | 准收益率③  | 收益率标准差④ |         |        |
|------------|--------|---------|--------|---------|---------|--------|
| 过去一个月      | 7.22%  | 1.73%   | 6.31%  | 1.67%   | 0.91%   | 0.06%  |
| 过去三个月      | -4.29% | 1.48%   | -7.21% | 1.40%   | 2.92%   | 0.08%  |
| 过去六个月      | -2.36% | 1.69%   | -3.81% | 1.68%   | 1.45%   | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 8.37%  | 1.79%   | 25.22% | 2.16%   | -16.85% | -0.37% |

注：本基金业绩比较基准为：恒生科技指数收益率\*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。

中欧港股数字经济混合发起(QDII)C

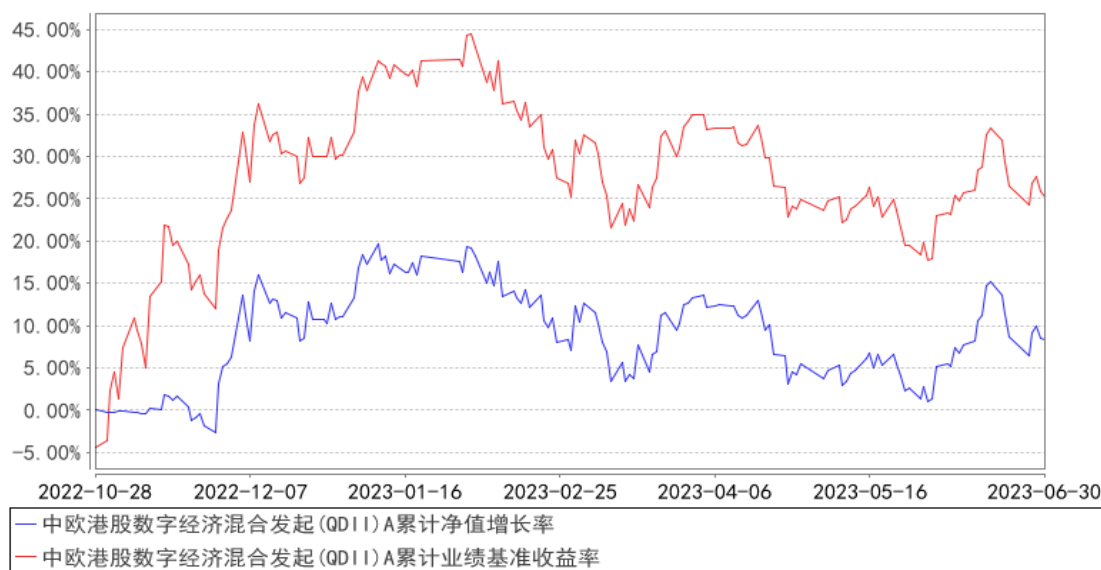
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | 7.03%    | 1.74%       | 6.31%      | 1.67%         | 0.72%   | 0.07%  |
| 过去三个月      | -4.60%   | 1.48%       | -7.21%     | 1.40%         | 2.61%   | 0.08%  |
| 过去六个月      | -2.86%   | 1.69%       | -3.81%     | 1.68%         | 0.95%   | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 7.67%    | 1.79%       | 25.22%     | 2.16%         | -17.55% | -0.37% |

注：本基金业绩比较基准为：恒生科技指数收益率\*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。



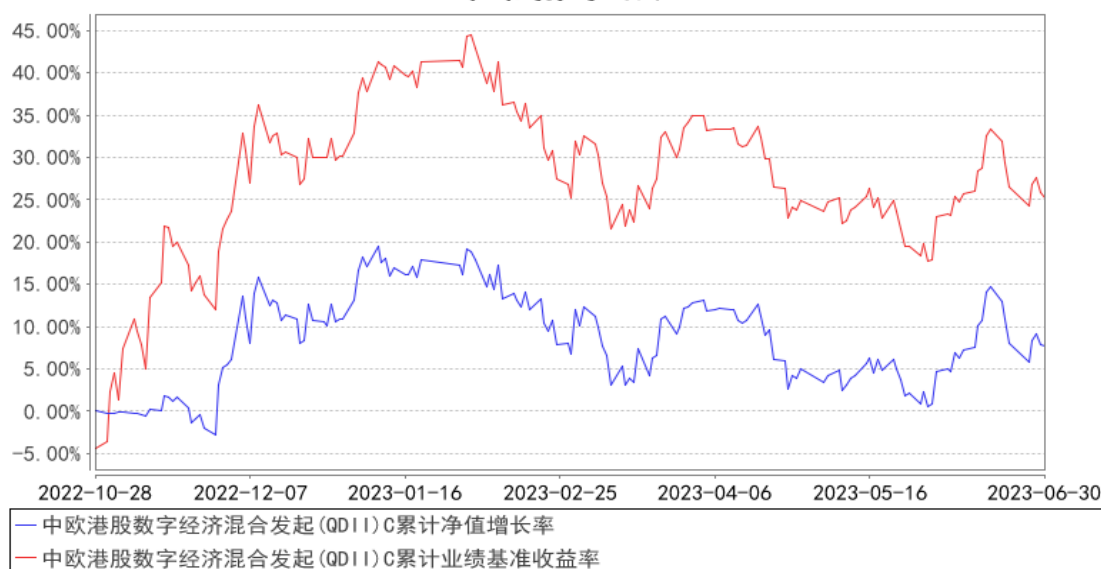
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧港股数字经济混合发起（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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 10 月 28 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

中欧港股数字经济混合发起（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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 10 月 28 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司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 |        |   |
| 曲径 | 量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理 | 2022-10-28      | -    | 16 年   | 中国籍，历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。 |

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

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）          | 任职时间             |
|----|----------|---------|------------------|------------------|
| 曲径 | 公募基金     | 7       | 6,329,179,335.99 | 2016 年 1 月 13 日  |
|    | 私募资产管理计划 | 2       | 245,811,705.77   | 2021 年 12 月 14 日 |
|    | 其他组合     | -       | -                | -                |
|    | 合计       | 9       | 6,574,991,041.76 | -                |

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无；

## 4.2 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 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。

## 4.5 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

今年以来，以恒生科技指数为代表的港股数字经济板块呈现了 N 型走势，在窄幅区间波动。港股数字经济的代表行业为互联网、先进制造和人工智能，在经历了市场调整后，股价均处在价值投资区域，具有良好的投资性价比。互联网相关公司，具有数据、平台和算法的整合能力，通过推出人工智能相关模型及应用，提升自身运营效率，互联网公司有望在合规范围内再次迎来发展机会。先进制造方面，以新能源整车公司为代表，通过在整车销售中持续提升份额，逐步进入了业绩兑现周期，二季度以来表现较优。

报告期内，本基金以恒生科技指数为锚定，遵循基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式，主要配置了 A 股稀缺标的板块，如新能源车，电商、短视频、芯片制造等相关个股。

#### 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-2.36%，同期业绩比较基准收益率为-3.81%；基金 C 类份额净值增长率为-2.86%，同期业绩比较基准收益率为-3.81%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，与人工智能相关的芯片和软件板块，通过人工智能赋能各个行业的经营逻辑，将继续兑现。同时，伴随着中美交流逐渐加深，有利于作为海外投资桥头堡的港股板块。此外，6 月 15 日美联储宣布暂停加息，这是美联储自 2022 年 3 月加息 10 次后的首次暂停，我们预测，强势美元对新兴市场的压力，未来也将有所缓解。对民营企业政策的呵护，强势美元的缓解，叠加前期股价回调深，风险释放充分，都让港股科技类的股票呈现了优质的性价比，我们中长期看好港股数字经济。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）

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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 3,349,152.78           | 2,851,629.39             |
| 结算备付金      |         | 3,418,353.52           | 539,303.66               |
| 存出保证金      |         | 20,265.32              | 77.61                    |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 49,050,874.37          | 30,979,424.84            |
| 其中：股票投资    |         | 47,515,721.36          | 29,460,026.35            |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 1,535,153.01           | 1,519,398.49             |
| 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         |            | -                         | 746,952.75                  |
| 应收股利          |            | 49,161.32                 | -                           |
| 应收申购款         |            | 741,806.27                | 281,749.84                  |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 56,629,613.58             | 35,399,138.09               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 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         |            | 8.77                      | 647,775.85                  |
| 应付赎回款         |            | 3,429,663.50              | 1,283,567.94                |
| 应付管理人报酬       |            | 88,984.95                 | 44,155.92                   |
| 应付托管费         |            | 17,302.62                 | 8,585.90                    |
| 应付销售服务费       |            | 25,506.03                 | 6,702.95                    |
| 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    | 59,591.72                 | 52,535.81                   |
| 负债合计          |            | 3,621,057.59              | 2,043,324.37                |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 49,104,742.90             | 30,067,496.36               |
| 其他综合收益        |            | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 3,903,813.09              | 3,288,317.36                |
| 净资产合计         |            | 53,008,555.99             | 33,355,813.72               |
| 负债和净资产总计      |            | 56,629,613.58             | 35,399,138.09               |

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 49,104,742.90 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0837 元，基金份额总额 19,499,132.08 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0767 元，基金份额总额 29,605,610.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）

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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|---------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |          | -965,892.73                           |
| 1. 利息收入                    |          | 19,625.47                             |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9  | 17,007.40                             |
| 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                 |          | 2,618.07                              |
| 证券出借利息收入                   |          | -                                     |
| 其他利息收入                     |          | -                                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |          | 905,127.77                            |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10 | 743,970.51                            |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.11 | -                                     |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12 | 17,554.52                             |
| 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 | 143,602.74                            |
| 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 | -2,145,848.49                         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | 46,924.81                             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17 | 208,277.71                            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 753,299.71                            |
| 1. 管理人报酬                   |          | 481,133.18                            |
| 2. 托管费                     |          | 93,553.64                             |
| 3. 销售服务费                   |          | 125,942.95                            |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                                     |
| 5. 利息支出                    |          | 300.96                                |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 300.96                                |
| 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 | 52,368.98                             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -1,719,192.44                         |
| 减：所得税费用                    |          | -                                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -1,719,192.44                         |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -1,719,192.44                         |

注：本基金基金合同于 2022 年 10 月 28 日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）

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<br>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）                          | 30,067,496.36                         | -      | 3,288,317.36  | 33,355,813.72  |
| 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）                          | 30,067,496.36                         | -      | 3,288,317.36  | 33,355,813.72  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 19,037,246.54                         | -      | 615,495.73    | 19,652,742.27  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                     | -      | -1,719,192.44 | -1,719,192.44  |
| （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）      | 19,037,246.54                         | -      | 2,334,688.17  | 21,371,934.71  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 75,938,714.03                         | -      | 8,291,743.74  | 84,230,457.77  |
| 2. 基金赎回款                                 | -56,901,467.49                        | -      | -5,957,055.57 | -62,858,523.06 |
| （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）                          | 49,104,742.90                         | -      | 3,903,813.09  | 53,008,555.99  |

报表附注为财务报表的组成部分。



本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧港股数字经济混合型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[2022]1016 号文《关于准予中欧港股数字经济混合型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《中欧港股数字经济混合型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 19,704,295.39 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\_B42 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》于 2022 年 10 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 19,704,658.30 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 362.91 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 13,918,671.93 份，包含认购利息折合 89.19 份；C 类基金的基金份额总额为 5,785,986.37 份，包含认购利息折合 273.72 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基金境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金可投资于境内市场和境外市场依法发行的金融工具。境内市场投资工具包括内地依法发行、上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行、上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、内地依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、货币市场工具（包括债券回购、银行存款、同业存单等）、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、信用衍生品（不含合约类信用衍生品）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证

监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于本基金界定的港股数字经济主题相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于境内外市场，包括境内市场和境外市场，其中境外市场包括但不限于：美国、香港、台湾、新加坡、欧洲和日本等国家或地区。香港市场可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度和港股通机制进行投资。

本基金的业绩比较基准为：恒生科技指数收益率×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 06 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。

#### 6.4.4.1 外币交易

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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<br>2023年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 3,349,152.78      |
| 等于：本金        | 3,348,852.08      |
| 加：应计利息       | 300.70            |
| 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           | 3,349,152.78      |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年6月30日 |              |               |              |           |
|---------------|-------------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
|               | 成本                | 应计利息         | 公允价值          | 公允价值变动       |           |
| 股票            | 47,803,184.57     | -            | 47,515,721.36 | -287,463.21  |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -            | -             | -            |           |
| 债券            | 交易所市场             | 1,502,303.25 | 35,303.01     | 1,535,153.01 | -2,453.25 |
|               | 银行间市场             | -            | -             | -            | -         |

|        |    |               |           |               |             |
|--------|----|---------------|-----------|---------------|-------------|
|        | 合计 | 1,502,303.25  | 35,303.01 | 1,535,153.01  | -2,453.25   |
| 资产支持证券 |    | -             | -         | -             | -           |
| 基金     |    | -             | -         | -             | -           |
| 其他     |    | -             | -         | -             | -           |
|        | 合计 | 49,305,487.82 | 35,303.01 | 49,050,874.37 | -289,916.46 |

#### 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<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 401.88            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 14,558.86         |
| 其中：交易所市场    | 14,558.86         |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用-审计费    | 19,835.79         |
| 预提费用-信息披露费  | 24,795.19         |
| 合计          | 59,591.72         |

##### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧港股数字经济混合发起(QDII)A

| 项目            | 本期<br>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          | 19,077,905.86              | 19,077,905.86 |
| 本期申购          | 10,268,821.40              | 10,268,821.40 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,847,595.18              | -9,847,595.18 |

|     |               |               |
|-----|---------------|---------------|
| 本期末 | 19,499,132.08 | 19,499,132.08 |
|-----|---------------|---------------|

中欧港股数字经济混合发起(QDII)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          | 10,989,590.50        | 10,989,590.50  |
| 本期申购          | 65,669,892.63        | 65,669,892.63  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -47,053,872.31       | -47,053,872.31 |
| 本期末           | 29,605,610.82        | 29,605,610.82  |

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

中欧港股数字经济混合发起(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           | 111,524.49  | 1,985,554.42  | 2,097,078.91  |
| 本期利润           | 378,857.79  | -1,110,194.04 | -731,336.25   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -23,903.29  | 289,963.65    | 266,060.36    |
| 其中：基金申购款       | 203,106.07  | 1,148,367.41  | 1,351,473.48  |
| 基金赎回款          | -227,009.36 | -858,403.76   | -1,085,413.12 |
| 本期已分配利润        | -           | -             | -             |
| 本期末            | 466,478.99  | 1,165,324.03  | 1,631,803.02  |

中欧港股数字经济混合发起(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           | 48,267.41    | 1,142,971.04  | 1,191,238.45  |
| 本期利润           | 47,798.26    | -1,035,654.45 | -987,856.19   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 440,995.71   | 1,627,632.10  | 2,068,627.81  |
| 其中：基金申购款       | 1,206,008.66 | 5,734,261.60  | 6,940,270.26  |
| 基金赎回款          | -765,012.95  | -4,106,629.50 | -4,871,642.45 |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 537,061.38   | 1,734,948.69  | 2,272,010.07  |

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  | 15,197.66            |
| 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 | 1,794.48             |
| 其他        | 15.26                |
| 合计        | 17,007.40            |

### 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   | 34,044,819.96                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 33,126,402.75                   |
| 减：交易费用     | 174,446.70                      |
| 买卖股票差价收入   | 743,970.51                      |

#### 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                              |
|------------------------------|---------------------------------|
|                              | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 17,554.52                       |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | —                               |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | —                               |
| 债券投资收益——申购差价收入               | —                               |
| 合计                           | 17,554.52                       |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 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   | 143,602.74 |
| 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            | 143,602.74 |

#### 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             | -2,145,848.49                   |
| 股票投资                   | -2,144,048.49                   |
| 债券投资                   | -1,800.00                       |
| 资产支持证券投资               | -                               |
| 基金投资                   | -                               |
| 贵金属投资                  | -                               |
| 其他                     | -                               |
| 2. 衍生工具                | -                               |
| 权证投资                   | -                               |
| 3. 其他                  | -                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                               |
| 合计                     | -2,145,848.49                   |

#### 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 | 208,277.71                      |
| 合计      | 208,277.71                      |

#### 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                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 19,835.79                       |
| 信息披露费   | 24,795.19                       |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 汇划手续费   | 354.76                          |
| 账户维护费   | 6,000.00                        |
| 证券组合费   | 1,383.24                        |
| 合计      | 52,368.98                       |



## 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  |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）   | 基金托管人              |
| 国都证券股份有限公司（“国都证券”）     | 基金管理人的股东、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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|---------------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
|       |                                       |                     |

|      |               |       |
|------|---------------|-------|
| 国都证券 | 15,355,072.80 | 17.57 |
|------|---------------|-------|

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                       |
|-------|----------------------------|-----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例（%） |
| 国都证券  | 5,140,000.00               | 100.00                |

#### 6.4.10.1.4 基金交易

#### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                   |              |                     |
|-------|----------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 国都证券  | 7,677.53                   | 22.22             | 2,434.86     | 16.72               |

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 481,133.18                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 169,534.08                 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、本基金合同于 2022 年 10 月 28 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 93,553.64                       |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、本基金合同于 2022 年 10 月 28 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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                              |                     |        |
|----------------|---------------------------------|---------------------|--------|
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                     |        |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                     |        |
|                | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A             | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C | 合计     |
| 中欧财富           | -                               | 577.07              | 577.07 |
| 合计             | -                               | 577.07              | 577.07 |

注：1、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将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、本基金合同于 2022 年 10 月 28 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

中欧港股数字经济混合发起(QDII)A

份额单位：份

| 项目                               | 本期                              |
|----------------------------------|---------------------------------|
|                                  | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2022 年 10 月 28 日）持有的基金份额 | 0.00                            |
| 报告期初持有的基金份额                      | 10,000,000.00                   |
| 报告期间申购/买入总份额                     | 0.00                            |
| 报告期间因拆分变动份额                      | 0.00                            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | 0.00                            |
| 报告期末持有的基金份额                      | 10,000,000.00                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比               | 51.28%                          |

|   |  |
|---|--|
| 例 |  |
|---|--|

中欧港股数字经济混合发起(QDII)C

份额单位：份

| 项目                               | 本期                              |
|----------------------------------|---------------------------------|
|                                  | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2022 年 10 月 28 日）持有的基金份额 | 0.00                            |
| 报告期初持有的基金份额                      | 0.00                            |
| 报告期内申购/买入总份额                     | 0.00                            |
| 报告期内因拆分变动份额                      | 0.00                            |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                   | 0.00                            |
| 报告期末持有的基金份额                      | 0.00                            |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 0.00%                           |

注：申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转出份额。

#### 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

本报告期末，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 |          |
|              | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,743,418.75                    | 9,291.75 |
| 香港上海汇丰银行有限公司 | 1,605,734.03                    | 5,905.91 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外托管人香港上海汇丰银行有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于 2022 年 10 月 28 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

## 6.4.12 期末（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，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要通过投资港股数字经济主题的股票，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得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检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出

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

#### 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 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期

日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 3,349,152.78 | -     | -     | -             | 3,349,152.78  |
| 结算备付金                  | 3,418,353.52 | -     | -     | -             | 3,418,353.52  |
| 存出保证金                  | 20,265.32    | -     | -     | -             | 20,265.32     |
| 交易性金融资产                | 1,535,153.01 | -     | -     | 47,515,721.36 | 49,050,874.37 |
| 应收股利                   | -            | -     | -     | 49,161.32     | 49,161.32     |
| 应收申购款                  | -            | -     | -     | 741,806.27    | 741,806.27    |
| 资产总计                   | 8,322,924.63 | -     | -     | 48,306,688.95 | 56,629,613.58 |
| 负债                     |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                  | -            | -     | -     | 3,429,663.50  | 3,429,663.50  |
| 应付管理人报酬                | -            | -     | -     | 88,984.95     | 88,984.95     |
| 应付托管费                  | -            | -     | -     | 17,302.62     | 17,302.62     |
| 应付清算款                  | -            | -     | -     | 8.77          | 8.77          |
| 应付销售服务费                | -            | -     | -     | 25,506.03     | 25,506.03     |
| 其他负债                   | -            | -     | -     | 59,591.72     | 59,591.72     |
| 负债总计                   | -            | -     | -     | 3,621,057.59  | 3,621,057.59  |



|                          |              |       |       |               |               |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 利率敏感度缺口                  | 8,322,924.63 | -     | -     | 44,685,631.36 | 53,008,555.99 |
| 上年度末<br>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                     | 2,851,629.39 | -     | -     | -             | 2,851,629.39  |
| 结算备付金                    | 539,303.66   | -     | -     | -             | 539,303.66    |
| 存出保证金                    | 77.61        | -     | -     | -             | 77.61         |
| 交易性金融资产                  | 1,519,398.49 | -     | -     | 29,460,026.35 | 30,979,424.84 |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 281,749.84    | 281,749.84    |
| 应收清算款                    | -            | -     | -     | 746,952.75    | 746,952.75    |
| 资产总计                     | 4,910,409.15 | -     | -     | 30,488,728.94 | 35,399,138.09 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 1,283,567.94  | 1,283,567.94  |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 44,155.92     | 44,155.92     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 8,585.90      | 8,585.90      |
| 应付清算款                    | -            | -     | -     | 647,775.85    | 647,775.85    |
| 应付销售服务费                  | -            | -     | -     | 6,702.95      | 6,702.95      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 52,535.81     | 52,535.81     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 2,043,324.37  | 2,043,324.37  |
| 利率敏感度缺口                  | 4,910,409.15 | -     | -     | 28,445,404.57 | 33,355,813.72 |

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 2.90%（2022 年 12 月 31 日：4.56%），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<br>2023 年 6 月 30 日 |              |                | 合计 |
|----------|------------------------|--------------|----------------|----|
|          | 美元<br>折合人民币<br>元       | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 |    |
| 以外币计价的资产 |                        |              |                |    |

|               |                          |               |            |               |
|---------------|--------------------------|---------------|------------|---------------|
| 银行存款          | 48,421.96                | 1,557,315.62  | -          | 1,605,737.58  |
| 交易性金融资产       | -                        | 47,515,721.36 | -          | 47,515,721.36 |
| 应收股利          | 17,197.40                | 31,963.92     | -          | 49,161.32     |
| 资产合计          | 65,619.36                | 49,105,000.90 | -          | 49,170,620.26 |
| 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 | 65,619.36                | 49,105,000.90 | -          | 49,170,620.26 |
| 项目            | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |               |            |               |
|               | 美元折合人民币元                 | 港币折合人民币元      | 其他币种折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                          |               |            |               |
| 银行存款          | 3,940.99                 | 1,580,876.71  | -          | 1,584,817.70  |
| 交易性金融资产       | -                        | 29,460,026.35 | -          | 29,460,026.35 |
| 资产合计          | 3,940.99                 | 31,040,903.06 | -          | 31,044,844.05 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |            |               |
| 应付清算款         | -                        | 647,775.74    | -          | 647,775.74    |
| 负债合计          | -                        | 647,775.74    | -          | 647,775.74    |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 3,940.99                 | 30,393,127.32 | -          | 30,397,068.31 |

#### 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汇率风险而可能采取的风险管理活动 |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                     | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |   | 本期末（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 港币相对人民币贬值 5%                                  | -2,375,786.07               | -1,519,656.37          |
|    | 港币相对人民币升值                                     | 2,375,786.07                | 1,519,656.37           |

|  |              |           |         |
|--|--------------|-----------|---------|
|  | 值 5%         |           |         |
|  | 美元相对人民币贬值 5% | -3,280.97 | -197.05 |
|  | 美元相对人民币升值 5% | 3,280.97  | 197.05  |

#### 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<br>2023年6月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 47,515,721.36     | 89.64            | 29,460,026.35       | 88.32            |
| 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            | 47,515,721.36     | 89.64            | 29,460,026.35       | 88.32            |

##### 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             | 2,613,150.94                | 804,969.91        |

|  |          |               |             |
|--|----------|---------------|-------------|
|  | 5%       |               |             |
|  | 业绩比较基准下降 | -2,613,150.94 | -804,969.91 |
|  | 5%       |               |             |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 47,515,721.36          | 29,460,026.35            |
| 第二层次          | 1,535,153.01           | 1,519,398.49             |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 49,050,874.37          | 30,979,424.84            |

###### 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              | 47,515,721.36 | 83.91         |
|    | 其中：普通股            | 47,515,721.36 | 83.91         |
|    | 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            | 1,535,153.01  | 2.71          |
|    | 其中：债券             | 1,535,153.01  | 2.71          |
|    | 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      | 6,767,506.30  | 11.95         |
| 8  | 其他各项资产            | 811,232.91    | 1.43          |
| 9  | 合计                | 56,629,613.58 | 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 36,390,514.17 元，占基金资产净值比例 68.65%。

#### 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   | 47,515,721.36 | 89.64         |
| 合计     | 47,515,721.36 | 89.64         |

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

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    | 113,403.54    | 0.21          |
| 消费者非必需品 | 17,126,781.60 | 32.31         |
| 消费者常用品  | 1,932,398.62  | 3.65          |
| 能源      | -             | -             |
| 金融      | 188,664.77    | 0.36          |
| 医疗保健    | 244,472.22    | 0.46          |
| 工业      | 289,547.82    | 0.55          |
| 信息技术    | 11,441,589.25 | 21.58         |
| 电信服务    | 15,755,656.28 | 29.72         |
| 公用事业    | -             | -             |
| 地产业     | 423,207.26    | 0.80          |
| 合计      | 47,515,721.36 | 89.64         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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

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  | Li Auto Inc.                  | 理想汽车         | 02015 HG | 港股通联合市场 | 中国       | 39,600  | 4,947,160.28 | 9.33          |
| 2  | Meituan                       | 美团           | 03690 HG | 港股通联合市场 | 中国       | 32,610  | 3,677,043.40 | 6.94          |
| 3  | Tencent Holdings Limited      | 腾讯控股有限公司     | 00700 HG | 港股通联合市场 | 中国       | 12,000  | 3,668,742.82 | 6.92          |
| 4  | Kuaishou Technology           | 快手科技         | 01024 HG | 港股通联合市场 | 中国       | 67,700  | 3,342,486.36 | 6.31          |
| 5  | Xiaomi Corporation            | 小米集团         | 01810 HG | 港股通联合市场 | 中国       | 335,600 | 3,316,944.75 | 6.26          |
| 6  | Alibaba Group Holding Limited | 阿里巴巴集团控股有限公司 | 9988 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港     | 37,800  | 2,829,888.53 | 5.34          |
| 7  | NetEase,                      | 网易           | 9999 HK  | 香港联     | 中国       | 20,100  | 2,827,952.37 | 5.33          |

|    |   |                |          |         |      |         |              |      |
|----|---|----------------|----------|---------|------|---------|--------------|------|
|    | Inc.  |                |          | 合交易所    | 香港   |         |              |      |
| 8  | XPeng Inc.  | 小鹏汽车有限公司       | 09868 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 53,100  | 2,447,856.90 | 4.62 |
| 9  | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 中芯国际集成电路制造有限公司 | 00981 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 108,500 | 2,040,710.53 | 3.85 |
| 10 | Bilibili Inc.   | 哔哩哔哩股份有限公司     | 09626 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 15,740  | 1,693,546.34 | 3.19 |
| 10 | Bilibili Inc.   | 哔哩哔哩股份有限公司     | 9626 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 3,060   | 329,240.90   | 0.62 |
| 11 | Haier Smart Home Co., Ltd.                            | 海尔智家股份有限公司     | 06690 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 63,400  | 1,440,879.56 | 2.72 |
| 12 | Lenovo Group Limited                                  | 联想集团有限公司       | 00992 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 190,000 | 1,431,189.55 | 2.70 |
| 13 | JD.com, Inc.  | 京东集团股份有限公司     | 9618 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,250  | 1,373,289.21 | 2.59 |
| 14 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited      | 舜宇光学科技(集团)有限公司 | 02382 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 18,600  | 1,340,180.91 | 2.53 |
| 15 | JD Health International Inc.                          | 京东健康股份有限公司     | 06618 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 29,050  | 1,324,445.01 | 2.50 |
| 16 | Baidu, Inc.   | 百度集团股份有限公司     | 9888 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 10,450  | 1,279,486.96 | 2.41 |

|    |  | 司                 |          |         |      |         |            |      |
|----|--|-------------------|----------|---------|------|---------|------------|------|
| 17 | Tencent Music Entertainment Group                    | 腾讯音乐娱乐集团          | 1698 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 33,100  | 886,534.48 | 1.67 |
| 18 | Kingsoft Corporation Ltd.                            | 金山软件有限公司          | 03888 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 24,800  | 705,388.46 | 1.33 |
| 19 | Kingdee International Software Group Company Limited | 金蝶国际软件集团有限公司      | 00268 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 72,000  | 695,689.23 | 1.31 |
| 20 | Alibaba Health Information Technology Limited        | 阿里健康信息技术有限公司（百慕大） | 00241 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 140,000 | 607,953.61 | 1.15 |
| 21 | Cowell e Holdings Inc.                               | 高伟电子控股有限公司        | 1415 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 39,000  | 520,660.55 | 0.98 |
| 22 | China Telecom Corporation Limited                    | 中国电信股份有限公司        | 00728 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 132,000 | 456,380.10 | 0.86 |
| 23 | BYD Electronic (International) Co., Ltd.             | 比亚迪电子（国际）有限公司     | 00285 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 20,500  | 447,943.98 | 0.85 |
| 24 | KE Holdings Inc.                                     | 贝壳控股公司            | 2423 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 11,800  | 423,207.26 | 0.80 |
| 25 | Hua Hong Semiconductor Limited                       | 华虹半导体有限公司         | 01347 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 17,000  | 401,245.70 | 0.76 |
| 26 | China  | 阅文集               | 00772    | 港股通     | 中国   | 11,800  | 358,475.04 | 0.68 |



|    |   |                    |          |         |      |         |            |      |
|----|---|--------------------|----------|---------|------|---------|------------|------|
|    | Literature Limited                                | 团                  | HG       | 联合市场    |      |         |            |      |
| 27 | AAC Technologies Holdings Inc.                    | 瑞声科技控股有限公司         | 02018 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 18,500  | 314,524.26 | 0.59 |
| 28 | Great Wall Motor Company Limited                  | 长城汽车股份有限公司         | 02333 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 37,500  | 310,131.02 | 0.59 |
| 29 | Kanzhun Limited                                   | 看准科技有限公司           | 2076 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,500   | 289,547.82 | 0.55 |
| 30 | China Unicom (Hong Kong) Limited                  | 中国联通网络通信(香港)股份有限公司 | 00762 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 60,000  | 286,551.38 | 0.54 |
| 31 | China Mobile Limited                              | 中国移动有限公司           | 00941 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 4,500   | 265,737.69 | 0.50 |
| 32 | Weibo Corporation                                 | 微博股份有限公司           | 9898 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 2,800   | 264,866.41 | 0.50 |
| 33 | Ping An Healthcare and Technology Company Limited | 平安健康医疗科技有限公司       | 01833 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 14,000  | 244,472.22 | 0.46 |
| 34 | SenseTime Group Inc.                              | 商汤集团股份有限公司         | 00020 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 119,000 | 227,111.33 | 0.43 |
| 35 | China Pacific Insurance (group) Co., Ltd.         | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司  | 02601 HG | 港股通联合市场 | 中国   | 10,000  | 186,700.95 | 0.35 |
| 36 | CMOC Group  | 洛阳栾川钼业             | 03993 HG | 港股通联合市  | 中国   | 30,000  | 113,403.54 | 0.21 |

|    |  |                                |             |                 |          |       |            |      |
|----|--|--------------------------------|-------------|-----------------|----------|-------|------------|------|
|    | Limited  | 集团股份<br>有限公司                   |             | 场               |          |       |            |      |
| 37 | Trip.com<br>Group<br>Limited                       | 携程集<br>团有限<br>公司               | 9961 HK     | 香港联<br>合交易<br>所 | 中国<br>香港 | 400   | 100,532.70 | 0.19 |
| 38 | Cloud<br>Music<br>Inc.                             | 云音乐<br>股份有<br>限公司              | 09899<br>HG | 港股通<br>联合市<br>场 | 中国       | 1,250 | 95,655.43  | 0.18 |
| 39 | Zhongan<br>Online<br>P&c<br>Insurance<br>Co., Ltd. | 众安在<br>线财产<br>保险股<br>份有限<br>公司 | 06060<br>HG | 港股通<br>联合市<br>场 | 中国       | 100   | 1,963.82   | 0.00 |

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 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<br>值比例（%） |
|----|--|----------|--------------|--------------------|
| 1  | Meituan  | 03690 HG | 3,423,967.76 | 10.26              |
| 2  | Li Auto Inc.   | 02015 HG | 3,064,833.33 | 9.19               |
| 3  | JD.com, Inc.   | 9618 HK  | 3,036,543.99 | 9.10               |
| 4  | Xiaomi Corporation   | 01810 HG | 3,011,007.25 | 9.03               |
| 5  | Kuaishou<br>Technology   | 01024 HG | 2,982,190.55 | 8.94               |
| 6  | Tencent Holdings<br>Limited                                    | 00700 HG | 2,933,506.37 | 8.79               |
| 7  | Semiconductor<br>Manufacturing<br>International<br>Corporation | 00981 HG | 2,589,803.71 | 7.76               |
| 8  | XPeng Inc.   | 09868 HG | 2,297,687.24 | 6.89               |
| 9  | Bilibili Inc.  | 09626 HG | 2,001,642.91 | 6.00               |
| 9  | Bilibili Inc.  | 9626 HK  | 112,423.86   | 0.34               |
| 10 | Picc Property And<br>Casualty Company<br>Limited               | 02328 HG | 2,059,963.58 | 6.18               |
| 11 | Baidu, Inc.  | 9888 HK  | 2,058,803.16 | 6.17               |
| 12 | Alibaba Group<br>Holding Limited                               | 9988 HK  | 1,840,611.38 | 5.52               |
| 13 | NetEase, Inc.  | 9999 HK  | 1,607,914.15 | 4.82               |
| 14 | ZTE Corporation  | 00763 HG | 1,469,113.11 | 4.40               |

|    |  |          |              |      |
|----|--|----------|--------------|------|
| 15 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited     | 02382 HG | 1,352,917.21 | 4.06 |
| 16 | China Telecom Corporation Limited                    | 00728 HG | 1,271,230.56 | 3.81 |
| 17 | Kingsoft Corporation Ltd.                            | 03888 HG | 1,194,355.46 | 3.58 |
| 18 | JD Health International Inc.                         | 06618 HG | 1,190,357.17 | 3.57 |
| 19 | Cowell e Holdings Inc.                               | 01415 HG | 586,079.57   | 1.76 |
| 19 | Cowell e Holdings Inc.                               | 1415 HK  | 544,567.17   | 1.63 |
| 20 | Kingdee International Software Group Company Limited | 00268 HG | 1,095,907.30 | 3.29 |
| 21 | China Mobile Limited                                 | 00941 HG | 966,136.71   | 2.90 |
| 22 | Alibaba Health Information Technology Limited        | 00241 HG | 844,796.84   | 2.53 |
| 23 | Lenovo Group Limited                                 | 00992 HG | 774,938.88   | 2.32 |
| 24 | Hua Hong Semiconductor Limited                       | 01347 HG | 757,315.47   | 2.27 |
| 25 | Sinotruk (Hong Kong) Ltd.                            | 03808 HG | 700,796.50   | 2.10 |

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  | Tencent Holdings Limited                   | 00700 HG | 2,618,545.65 | 7.85           |
| 2  | Meituan                                    | 03690 HG | 2,286,456.43 | 6.85           |
| 3  | Bilibili Inc.                              | 9626 HK  | 2,175,353.01 | 6.52           |
| 4  | Picc Property And Casualty Company Limited | 02328 HG | 2,108,707.35 | 6.32           |

|    |   |          |              |      |
|----|---|----------|--------------|------|
| 5  | Kuaishou Technology                                   | 01024 HG | 2,055,726.48 | 6.16 |
| 6  | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 00981 HG | 2,011,153.83 | 6.03 |
| 7  | JD.com, Inc.  | 9618 HK  | 1,751,008.96 | 5.25 |
| 8  | Alibaba Group Holding Limited                         | 9988 HK  | 1,614,314.75 | 4.84 |
| 9  | Baidu, Inc.   | 9888 HK  | 1,518,924.57 | 4.55 |
| 10 | ZTE Corporation                                       | 00763 HG | 1,517,230.22 | 4.55 |
| 11 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited      | 02382 HG | 1,455,460.60 | 4.36 |
| 12 | Kingsoft Corporation Ltd.                             | 03888 HG | 1,337,334.78 | 4.01 |
| 13 | Hua Hong Semiconductor Limited                        | 01347 HG | 983,601.47   | 2.95 |
| 14 | China Mobile Limited                                  | 00941 HG | 860,630.55   | 2.58 |
| 15 | China Telecom Corporation Limited                     | 00728 HG | 781,831.53   | 2.34 |
| 16 | Sinotruk (Hong Kong) Ltd.                             | 03808 HG | 706,544.48   | 2.12 |
| 17 | Galaxy Entertainment Group Limited                    | 00027 HG | 609,633.05   | 1.83 |
| 18 | Cowell e Holdings Inc.                                | 01415 HG | 604,870.48   | 1.81 |
| 19 | JD Health International Inc.                          | 06618 HG | 591,293.56   | 1.77 |
| 20 | Lenovo Group Limited                                  | 00992 HG | 567,155.70   | 1.70 |

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。

### 7.5.3 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 | 53,326,146.25 |
| 卖出收入（成交）总额 | 34,044,819.96 |

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。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级     | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|------------|--------------|--------------|
| AAA-至 AAA+ | -            | 0.00         |
| AA-至 AA+   | -            | 0.00         |
| A-至 A+     | -            | 0.00         |
| BBB-至 BBB+ | -            | 0.00         |
| BB-至 BB+   | -            | 0.00         |
| B-至 B+     | -            | 0.00         |
| D 至 CCC+   | -            | 0.00         |
| 未评级        | 1,535,153.01 | 2.90         |

注：本债券投资组合采用国际权威机构发布的债项评级。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量        | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 019638 | 20 国债 09 | 1,500,000 | 1,535,153.01 | 2.90         |

注：1. 债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2. 数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折算为人民币，四舍五入保留整数。

## 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收到公开谴责、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规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 | 20,265.32 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 2 | 应收清算款 | -          |
| 3 | 应收股利  | 49,161.32  |
| 4 | 应收利息  | -          |
| 5 | 应收申购款 | 741,806.27 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 811,232.91 |

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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  |
| 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A | 1,456    | 13,392.26 | 10,000,000.00 | 51.28% | 9,499,132.08  | 48.72%  |
| 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C | 11,145   | 2,656.40  | 0.00          | 0.00%  | 29,605,610.82 | 100.00% |
| 合计                  | 12,601   | 3,896.89  | 10,000,000.00 | 20.36% | 39,104,742.90 | 79.64%  |

### 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 | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A | 2,240.74  | 0.01%    |
|                  | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C | 10,842.54 | 0.04%    |

|  |    |           |       |
|--|----|-----------|-------|
|  | 合计 | 13,083.28 | 0.03% |
|--|----|-----------|-------|

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A | 0                 |
|                                | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C | 0                 |
|                                | 合计                  | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A | 0                 |
|                                | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C | 0                 |
|                                | 合计                  | 0                 |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 20.36%       | 10,000,000.00 | 20.36%       | 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 | 20.36%       | 10,000,000.00 | 20.36%       | 三年         |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)A | 中欧港股数字经济混合发起(QDII)C |
|----------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2022年10月28日）基金份额总额 | 13,918,671.93       | 5,785,986.37        |
| 本报告期期初基金份额总额               | 19,077,905.86       | 10,989,590.50       |
| 本报告期基金总申购份额                | 10,268,821.40       | 65,669,892.63       |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 9,847,595.18  | 47,053,872.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | -             |
| 本报告期末基金份额总额   | 19,499,132.08 | 29,605,610.82 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。



## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 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 (%) |          |
| 民生证券  | 2      | 17,714,924.24 | 20.28            | 8,857.42  | 21.82          | -        |
| 国都证券  | 3      | 15,355,072.80 | 17.57            | 7,677.53  | 18.92          | -        |
| 中金公司  | 1      | 14,954,045.99 | 17.12            | 7,477.00  | 18.42          | -        |
| 东北证券  | 2      | 13,338,426.97 | 15.27            | 6,669.22  | 16.43          | -        |
| 中信证券  | 2      | 6,565,633.06  | 7.51             | 3,282.81  | 8.09           | 本报告期新增1个 |
| Haitong International Securities Co Ltd       | 2      | 6,544,587.51  | 7.49             | 1,963.38  | 4.84           | -        |
| CLSA Limited                                  | 2      | 4,082,679.13  | 4.67             | 1,224.80  | 3.02           | -        |
| J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited | 2      | 4,082,485.91  | 4.67             | 1,633.00  | 4.02           | -        |
| China International Capital Corp HK Sec Ltd   | 2      | 3,070,797.37  | 3.51             | 921.24    | 2.27           | -        |
| 华创证券  | 1      | 760,118.79    | 0.87             | 380.01    | 0.94           | -        |
| UBS SECURITIES ASIA LTD.                      | 2      | 484,556.00    | 0.55             | 290.73    | 0.72           | -        |

|            |   |            |      |        |      |                  |
|------------|---|------------|------|--------|------|------------------|
| 申万宏源<br>证券 | 1 | 417,638.44 | 0.48 | 208.81 | 0.51 | -                |
| 安信证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 财通证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 长江证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 川财证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 德邦证券       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 东方财富       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 东方证券       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 东吴证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 东兴证券       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 光大证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 广发证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 国海证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | 本报告期<br>新增<br>1个 |
| 国金证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 国泰君安       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 国信证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 海通证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 华泰证券       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 平安证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 天风证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 西部证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 西南证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 兴业证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 浙商证券       | 1 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 中泰证券       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |
| 中信建投       | 2 | -          | -    | -      | -    | -                |

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                  | 债券回购交易 |                    | 权证交易 |                  | 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<br>额<br>的<br>比<br>例<br>(%) |
|---|---|---|--------------|--------|---|---|---|------------------------------|
| 民生证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 国都证券  | - | - | 5,140,000.00 | 100.00 | - | - | - | -                            |
| 中金公司  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 东北证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 中信证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| Haitong<br>International<br>Securities Co<br>Ltd          | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| CLSA Limited  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| J.P. Morgan<br>Securities<br>(Asia<br>Pacific)<br>Limited | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| China<br>International<br>Capital Corp<br>HK Sec Ltd      | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 华创证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| UBS<br>SECURITIES<br>ASIA LTD.                            | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 申万宏源证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 安信证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 财通证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 长江证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 川财证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 德邦证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 东方财富  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 东方证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 东吴证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 东兴证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 光大证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |
| 广发证券  | - | - | -            | -      | - | - | - | -                            |

|      |   |   |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|---|-----------|------------|
| 1  | 中欧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  | 中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）2022 年第 4 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公地址变更公告                                      | 中国证监会指定媒介 | 2023-02-17 |
| 4  | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2023-03-24 |
| 5  | 中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）2022 年年度报告                        | 中国证监会指定媒介 | 2023-03-31 |
| 6  | 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 |
| 7  | 中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）2023 年第 1 季度报告                    | 中国证监会指定媒介 | 2023-04-22 |
| 8  | 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 |
| 9  | 中欧基金管理有限公司关于公司股   | 中国证监会指定媒介 | 2023-06-03 |

|    |                                      |           |            |
|----|--------------------------------------|-----------|------------|
|    | 权变更的公告                               |           |            |
| 10 | 中欧港股数字经济混合型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 | 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |   |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|---|---------------|------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间   | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2023 年 01 月 03 日至 2023 年 03 月 03 日;2023 年 06 月 26 日至 2023 年 06 月 30 日 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 20.36% |

#### 产品特有风险

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

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）相关批准文件
- 2、《中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》
- 3、《中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》
- 4、《中欧港股数字经济混合型发起式证券投资基金（QDII）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](http://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