

中庚港股通价值 18 个月封闭运作股票型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:中庚基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 18 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月11日（基金合同生效日）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	7
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金
基金简称	中庚港股通价值18个月封闭股票
基金主代码	017650
基金运作方式	契约型基金。本基金基金合同生效后，前18个月封闭运作。本基金封闭期自基金合同生效之日起至18个月后的对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）的前一日的期间，如该日不存在对应日期的，则延后至下一个工作日。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称变更为"中庚港股通价值股票型证券投资基金"。
基金合同生效日	2023年01月11日
基金管理人	中庚基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,976,905,694.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于香港市场上市公司股票。基金以价值投资策略为基础，重点发掘港股市场基本面良好、价值被低估的公司来构建股票组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>股票投资策略</p> <p>(1) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金重点通过港股通机制投资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。本基金将采用自下而上的个股精选策略，结合香港市场行业及个股估值水平差异等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。本基金的股票投资理念是上市公司的可持续盈利能力和其股票估值具有很强的正相关性，可持续的高盈利能力公司的估值最终会</p>

	<p>比低盈利能力公司的高，因此通过投资低估值、高盈利能力的股票能够为投资者带来中长期的超额收益。</p> <p>(2) A股市场股票投资策略</p> <p>本基金积极寻找A股市场不同于港股市场的行业性投资机遇，通过对A股上市公司可持续盈利能力的评估和其合理估值的判断，自下而上寻找个股投资机会，并重点投资于当前定价低于合理评估价值的上市公司股票。</p> <p>其他策略：资产配置策略、债券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、融资与转融通证券出借交易策略、投资组合的风险管理策略。</p>
业绩比较基准	中证港股通综合指数(人民币)收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中庚基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔远洪	杨军智
	联系电话	021-20639999	010-60834299
	电子邮箱	cuiyuanhong@zgfunds.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		021-53549999	010-60836588
传真		021-20639747	010-60834004
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号420室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层

邮政编码	200120	100125
法定代表人	孟辉	张佑君

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.zgfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中庚基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号 星展银行大厦703-704

§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01月11日(基金合同生效日) - 2023年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	-30,652,243.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0155
本期加权平均净值利润率	-1.55%
本期基金份额净值增长率	-1.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	-30,652,243.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0155
期末基金资产净值	1,946,253,450.19

期末基金份额净值	0.9845
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.55%

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.所述基金业绩指标不包括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.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）。

4.本基金基金合同于2023年1月11日生效，本报告期不是完整报告期。

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

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	9.85%	1.79%	4.71%	1.02%	5.14%	0.77%
过去三个月	-1.60%	1.48%	-0.98%	0.94%	-0.62%	0.54%
自基金合同生效起至今	-1.55%	1.35%	-3.77%	1.01%	2.22%	0.34%

注：本基金的业绩比较基准为中证港股通综合指数（人民币）收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

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

中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1.本基金基金合同于2023年1月11日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2.根据本基金基金合同的规定，本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月，至本报告期末尚处于建仓期。

§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

本基金管理人为中庚基金管理有限公司（以下简称“公司”），于2018年6月经中国证监会核准设立。公司是一家以自然人持股发起设立的公募基金管理公司，注册资本为人民币2亿元，公司注册地为上海。截至报告期末，公司股东及其出资比例为：孟辉先生30.99%，中庚置业集团有限公司25%，闫焯先生14.99%，大连海博教育发展有限公司8%，上海睦菁投资管理合伙企业（有限合伙）4.99%，丘栋荣先生4.99%，福建海龙威投资发展有限公司4%，曹庆先生2.52%，张京女士2.52%，福建瑞闽投资有限公司2%。

截至报告期末，公司共管理6只公募基金产品，分别为中庚价值领航混合型证券投资基金、中庚小盘价值股票型证券投资基金、中庚价值灵动灵活配置混合型证券投资基金、中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金、中庚价值先锋股票型证券投资基金、中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金，管理资产规模371.31亿元。

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		
丘栋荣	本基金的基金经理；中庚价值领航混合基金、中庚小盘价值股票基金、中庚价值灵动灵活配置混合基金、中庚价值品质一年持有期混合基金基金经理；公司副总经理兼首席投资官	2023-01-11	-	15年	丘栋荣先生，副总经理，工商管理硕士，历任群益国际控股有限公司上海代表处研究员、汇丰晋信基金管理有限公司行业研究员、高级研究员、股票投资部总监、总经理助理。现任中庚基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。

注：1.任职日期为本基金基金合同生效日的日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同》、《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，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，没有发生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，公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中庚基金管理有限公司公平交易制度》等相关监管法规及内部制度，严格规范境内上市证券的一级市场申购和二级市场交易相关的研究分析、投资决策、交易执行、日常监控和报告分析等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化

管理体系。在制度和实际操作层面确保各组合享有同等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过恒生系统的线上流程和标准化的线下审批流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中控制主要包括组合间相同证券的交易方向控制。首先，将主动投资组合的同日反向交易列为禁止行为。其次，对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。

事后评估及反馈主要包括组合间不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估。通过公平交易的事后分析评估系统，对当季度涉及公平性交易的投资行为进行统计分析。若发现异常交易行为，视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报监管机构。

本报告期内，公司旗下各基金产品严格遵守公司的公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与本公司管理的其他投资组合之间有导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，未出现本公司管理的投资组合参与交易所公开竞价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5%的交易。

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

2023年上半年，国内经济基本面前高后低，政策保持定力，聚焦于高质量发展，偏重产业转型和安全。长短期因素交织，居民偏谨慎，企业主动去库存，经济持续回升尚需时日，或需政策推动。海外则聚焦于美国通胀和加息，劳动力市场紧俏、AI浪潮推升股市、财政支出力度强，支撑了美国经济的韧性和利率高位的持续性。

权益市场映射基本面节奏，港股年初快速上行后震荡趋弱，更叠加其流动性受美债利率高位压制，较A股波动更大。港股整体估值水平处于低位，股权风险溢价水平处于较高位，权益资产性价比较高，唯有此时积极布局，才有望提升回报水平。因此，上半年本基金基于低估值价值投资策略，从资产配置、行业配置和个股组合等多方面构建高性价比投资组合。

1、本基金是一个股票型基金，重点投资于港股。港股估值基本处于历史10%-20%分位，存在系统性机会，继续战略性配置，报告期内维持了权益资产的超配。

2、从行业和个股层面持续优化组合，自下而上积极配置低风险、低估值、持续成长的公司，同时行业风险和风格风险相对分散。本基金重点配置了医药、互联网科技、房地产、有色金属、交运、纺织服装、汽车等行业相关个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中庚港股通价值18个月封闭股票基金份额净值为0.9845元，本报告期内，基金份额净值增长率为-1.55%，同期业绩比较基准收益率为-3.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济周期的复苏阶段是居民、企业信心重建的过程，是自身努力、政策推力和内外共振共同作用的结果。疫情放开和政治局会议的转变，确认了政策的双底，政策扬长补短，既有助于经济企稳，更要提升经济的未来空间。因此，在此宏观背景下，应积极评估经济和产业的变化，理解哪些公司具有持续提升竞争力并将此转化为盈利的能力。

从估值来看，港股整体估值水平基本处于历史10%分位左右，港股性价比很高，且部分公司有稀缺性，具有战略性配置价值。随着经济温和修复，企业盈利有望触底回升，而美债利率水平已至高位，加息压力缓释，对港股市场保持积极，持续关注企业的基本面改善和盈利能力提升。

本基金后市投资思路上，我们坚持低估值价值投资理念，通过精选基本面良好、盈利增长积极、价值被低估的个股，构建高性价比的投资组合，力争获得可持续的超额收益。具体而言，本基金重点关注的投资方向包括：

1、估值至低位，业务稳健但成长属性强、未来弹性较大的互联网股和医药科技股。

如港股互联网股兼顾确定性和成长性，1) 供给格局带来确定性。消费继续复苏和用户习惯不可逆，平台的渠道价值有稀缺性，竞争相对可控，互联网产业链平台议价能力凸显，叠加降本增效，大幅度提升利润水平和盈利质量。2) 价值链纵深扩张引领成长性。政策温和，创始人回归有望增强组织创新的信心和活力，AI等新技术手段带来新机遇和调整，进一步夯实核心业务和探索高价值场景。3) 互联网板块呈现出系统性的低估值特征，回购进一步增强股东回报，市场可能过度低估了其收入端的韧性以及高估了非理性竞争带来的利润不确定性。

如港股医药科技股估值回归理性，具有较大的创新可能性，1) 药械产品具全球竞争力，格局正清晰。大量资本涌入到退潮，生物医药产业升级迅猛，培育了一批有国际竞争力的企业和企业家，至今内外压力下重回理性与专注；2) 供给引领需求。医药技术的持续升级，反哺刺激高质量的医疗需求。人口老龄化和人民生活水平提升过程中，需求确定性高，具备消费韧性；3) 低位置高赔率。港股医药行业受海外流动性等因素压制，持续调整，例如一些18A的生物科技公司的市值已经低于净现金，不管从公司还是产品的角度，都具备较好的投资回报率。

2、港股中估值极度便宜，防御属性强、基本面稳健、分红潜力大的地产为代表的价值股。其中地产，1) 房地产需求导致大盘不振，但结构上已确定性利好头部的优质房企，未来需求提振惠及的仍是这些头部企业；2) 土地出让市场热情不高，房企坚守回报要求，新开工数据隐含未来新房供应不足问题，有利于头部企业的优质供给；3) 房地产行业被投资者厌恶，估值水平极低，优质房企具有高回报潜力。

3、估值处于历史低位的价值股，重点关注供给端收缩或刚性行业，及其在需求复苏情况下的潜在弹性，如基本金属为代表的资源类公司，1) 供给端刚性导致价格底部坚实，价格敏感。基本金属总体呈现出的低产能弹性、低库存、相对低价格的三低特征，有利于存量资产价值，一旦需求好转则价格具有弹性。2) 内生需求修复，海外再工业化，需求仍有弹性。3) 估值定价处于历史低位，对应预期回报率高。

4、能源运输公司，1) 供给受限明确，运输船队老化，未来几年供给明显缩量；2) 石油运输需求预计稳中有升，运距拉长仍在持续发生。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为合理、公允地对基金所投资品种进行估值，保护基金份额持有人利益，本公司设立估值委员会，专门负责基金估值工作，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。估值委员会由督察长、首席投资官、基金运营部负责人、投资部负责人、监察稽核部内审经理组成，当发现可能需要对某只证券重新估值的情形，估值委员会成员或基金经理可提请召开估值委员会，讨论估值方法的调整。估值委员会成员均具有10年以上专业工作经验，具备良好的专业知识和专业技能，充分理解各种估值方法和估值技术。估值委员会的职责主要包括有：

(一) 负责建立、健全、落实公司的估值政策、估值程序和金融资产分类及预期信用损失减值的制度；

(二) 负责参照估值模型和行业惯例，选定与市场环境相适应的估值方法；

(三) 负责在经济环境发生重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件等情形下，确定合理的估值方法，组织估值调整；

(四) 负责研究中国证券投资基金业协会估值核算工作小组发布的各类估值指引，评估指引实施后对估值的影响及估值系统改造的可行性；

(五) 对直接选取第三方估值基准服务机构提供的证券估值价格的，负责评估第三方估值基准服务机构的估值质量，对估值价格进行校验，确定更能体现公允价值的估值价格；

(六) 当本公司所管理的证券投资基金出现信用风险或流动性缺失时，召开估值委员会会议讨论确定公允价值或预期信用损失计量结果；

(七) 当发生估值调整时, 负责发布相关公告, 充分披露确定公允价值的依据、方法、估值价格等信息;

(八) 当本公司所管理的证券投资基金前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 负责决定是否暂停基金估值;

(九) 当本公司所管理的证券投资基金发生大额申购或赎回情形时, 负责决定是否启用摆动定价机制, 摆动定价机制的处理原则与操作规范由中国证券投资基金业协会另行制定;

(十) 当本公司所管理的证券投资基金持有存在风险的特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则, 按照《中庚基金管理有限公司运营业务流动性风险管理办法》的操作流程, 负责执行侧袋机制。

参与估值流程的各方还包括托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任, 当存有异议时, 托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释, 通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配, 但符合基金合同规定。

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, 本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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, 中信证券股份有限公司(以下称“本托管人”)在对中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、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的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由中庚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	26,673,364.22
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,913,581,770.42
其中：股票投资		1,913,581,770.42
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		77,218.31

应收股利		8,816,709.95
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,949,149,062.90
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,391,120.50
应付托管费		398,520.09
应付销售服务费		-
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	105,972.12
负债合计		2,895,612.71
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	1,976,905,694.10
未分配利润	6.4.7.8	-30,652,243.91
净资产合计		1,946,253,450.19
负债和净资产总计		1,949,149,062.90

注：1.报告截止日2023年6月30日，基金份额净值0.9845元，基金份额总额1,976,905,694.10份。

2.本基金合同生效日为2023年01月11日，本期财务报表的实际编制期间为2023年01月11

日至2023年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

3.银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.2 利润表

会计主体：中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月11日（基金合同 生效日）至2023年06月30 日
一、营业总收入		-14,432,381.76
1.利息收入		1,883,486.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	346,877.69
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		1,536,608.36
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,852,395.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,706,781.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-72,232.65
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	401,746.84
股利收益	6.4.7.14	22,229,663.05
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-27,168,263.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
减：二、营业总支出		16,219,862.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,810,661.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,301,776.89
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		1,451.54
8. 其他费用	6.4.7.17	105,972.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,652,243.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,652,243.91
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-30,652,243.91

注：本基金合同生效日为2023年01月11日，本期财务报表的实际编制期间为2023年01月11日至2023年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06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）	-	-	-	-
二、本期期初净	1,976,905,694.1	-	-	1,976,905,694.1

资产（基金净值）	0			0
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-30,652,243.91	-30,652,243.91
（一）、综合收益总额	-	-	-30,652,243.91	-30,652,243.91
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,976,905,694.10	-	-30,652,243.91	1,946,253,450.19

注：本基金合同生效日为2023年01月11日，本期财务报表的实际编制期间为2023年01月11日至2023年06月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

孟辉

孟辉

欧晔

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

中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]3104号《关于准予中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金注册的批复》核准,由中庚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《中庚港股通价值 18 个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,976,898,192.67元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同》于2023年1月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,976,905,694.10份基金份额,其中认购资金利息折合7,501.43份基金份额。本基金的基金管理人为中庚基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金基金合同生效后,前18个月封闭运作。本基金封闭期自基金合同生效之日起至18个月后的对应日(遇非工作日顺延至下一个工作日)的前一日的期间,如该日不存在对应日期的,则延后至下一个工作日。在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回,也不上市交易。封闭期届满后,本基金转为开放式运作,基金名称变更为“中庚港股通价值股票型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行或上市 的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通机制下允许投资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、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资,亦可在封闭期内参与转融通证券出借业务。

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,并可依据届时有 效的法律法规实时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比列为:在封闭期内,本基金股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为 85%-100%,其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%,

封闭期到期前一个月不受前述比例限制；封闭期届满转为开放式运作后，本基金股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为85%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%，封闭期到期后的一个月以内不受前述比例限制；封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当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；在封闭期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证港股通综合指数（人民币）收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月11日至2023年6月30日止期间的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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月11日（基金合同生效日）至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》及《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	6,877,435.05
等于：本金	6,875,216.80
加：应计利息	2,218.25
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	19,795,929.17
等于：本金	19,792,225.07
加：应计利息	3,704.10
合计	26,673,364.22

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,940,750,034.09	-	1,913,581,770.42	-27,168,263.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,940,750,034.09	-	1,913,581,770.42	-27,168,263.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	48,168.99
预提费用-信息披露费	57,803.13
合计	105,972.12

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,976,905,694.10	1,976,905,694.10
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,976,905,694.10	1,976,905,694.10

注：1.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。

2. 本基金自2023年1月9日至2023年1月9日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,976,898,192.67元。根据《中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币7,501.43元在本基金成立后，折算为7,501.43份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,483,980.24	-27,168,263.67	-30,652,243.91

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,483,980.24	-27,168,263.67	-30,652,243.91

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
活期存款利息收入	92,390.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	254,487.17
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	346,877.69

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 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01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,112,479,028.92
减：卖出股票成本总额	1,115,466,265.32
减：交易费用	8,719,544.98
买卖股票差价收入	-11,706,781.38

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年 06月30日
债券投资收益——利息收入	102,945.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-175,177.73
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	-72,232.65

6.4.7.11.2 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01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	90,186,319.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	89,802,454.00
减：应计利息总额	522,961.50
减：交易费用	36,081.73
买卖债券差价收入	-175,177.73

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出权证成交总额	415,302.87
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	1,459.83
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	12,096.20
买卖权证差价收入	401,746.84

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无股指期货投资收益等其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	22,229,663.05
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	22,229,663.05

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-27,168,263.67
——股票投资	-27,168,263.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-27,168,263.67

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
审计费用	48,168.99
信息披露费	57,803.13
证券出借违约金	-
合计	105,972.12

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，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
-------	---------

中庚基金管理有限公司("中庚基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
自然人股东	基金管理人的股东

注：下述关联方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 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	2,363,925,539.65	56.77%

6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	130,175.99	31.34%

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购

		成交总额的比例
中信证券	1,265,276,000.00	16.51%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,857,788.00	55.80%	-	-

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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

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 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,810,661.60
其中：支付销售机构的客户维护费	5,860,236.29

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,301,776.89

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

本基金本报告期未发生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。

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

本基金本报告期未发生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。

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**

份额单位：份

项目	本期
	2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

基金合同生效日（2023年01月11日）持有的基金份额	19,999,666.67
报告期初持有的基金份额	-
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	19,999,666.67
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.01%

- 注：1.如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。
2.如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。
3.上述认购交易为2023年1月9日通过直销柜台申请，按照申请金额匹配费率，对应的认购费率为每笔1000元。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	31,227,012.54	1.58%

注：上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

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01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券-托管户	6,877,435.05	92,390.52
中信证券-证券资	13,708,154.98	37,983.74

金户		
----	--	--

注：1.本基金托管户的银行存款由基金托管人中信证券股份有限公司存放在平安银行上海分行，按银行同业活期存款协议约定利率计息。

2.本基金证券资金户的存款为本基金存放于中信证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券	688146	中船特气	公开发行	10,101	365,151.15
中信证券	688581	安杰思	公开发行	1,629	204,928.20

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688369	致远互联	2023-01-19	6个月	大宗交易流通受限	47.60	52.46	573,650	27,308,050.00	30,093,679.00	-

688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新限售	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688603	C天承	2023-06-30	6个交易日	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

				售						
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688603	C天承	2023-06-30	6个月	科创板打新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

注：1.根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，本基金所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2.根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

3.根据《深圳/上海证券交易所首次公开发行股票发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分股票设置不低于6个月的限售期。

4.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

5.基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责评价公司整体合规管理和内控风险管理等；在公司层面设立合规与风控委员会，负责管理和控制日常经营风险、基金投资风险和其他业务风险。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；

监察稽核部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。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的特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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。本基金的活期存款和协议存款全部存放在中信证券股份有限公司指定的平安银行或其他具有基金托管资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以基金证券经纪商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。

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。

于2023年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券。

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上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。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，且无可赎回基金份额，账面余额即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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金

组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。在本基金开放运作期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。在本基金开放运作期内，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%。于2023年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.58%。

于开放运作期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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未来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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,673,364.22	-	-	-	-	-	26,673,364.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,913,581,770.42	1,913,581,770.42
应收清算款	-	-	-	-	-	77,218.31	77,218.31
应收股利	-	-	-	-	-	8,816,709.95	8,816,709.95
资产总计	26,673,364.22	-	-	-	-	1,922,475,698.68	1,949,149,062.90
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,391,120.50	2,391,120.50
应付托管费	-	-	-	-	-	398,520.09	398,520.09
其他负债	-	-	-	-	-	105,972.12	105,972.12
负债总计	-	-	-	-	-	2,895,612.71	2,895,612.71
利率敏感度缺口	26,673,364.22	-	-	-	-	1,919,580,085.97	1,946,253,450.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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 2023年06月30日

	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,858,465,745. 51	-	1,858,465,745. 51
应收股利	-	8,816,709.95	-	8,816,709.95
资产合计	-	1,867,282,455. 46	-	1,867,282,455. 46
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	-	1,867,282,455. 46	-	1,867,282,455. 46

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。	
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06月30日
	1.港币对人民币升值5%	93,364,122.77
	2.港币对人民币贬值5%	-93,364,122.77

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在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出大类资产配置的决定；通过投资组合的分散化降低其他价格风险，本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,913,581,770.42	98.32
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	1,913,581,770.42	98.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2、以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
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06月30日
	1.业绩比较基准上升5%	104,865,980.63
	2.业绩比较基准下降5%	-104,865,980.63

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	1,882,903,353.11
第二层次	76,505.00
第三层次	30,601,912.31
合计	1,913,581,770.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，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资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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。

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	1,913,581,770.42	98.18
	其中：股票	1,913,581,770.42	98.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,673,364.22	1.37
8	其他各项资产	8,893,928.26	0.46
9	合计	1,949,149,062.90	100.00

注：1.银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

2.本基金本报告期末持有的港股通股票公允价值为1,858,465,745.51，占基金净值比例为95.49%。

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

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	3,540,606.00	0.18
C	制造业	16,621,932.63	0.85
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	30,103,469.68	1.55
J	金融业	854,209.00	0.04
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	3,995,807.60	0.21
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	55,116,024.91	2.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
原材料	210,187,708.23	10.80
非日常生活消费品	378,024,357.36	19.42
日常消费品	7,654,001.37	0.39
能源	136,586,985.25	7.02
金融	52,392,868.81	2.69
医疗保健	413,409,009.35	21.24
工业	121,297,683.96	6.23
通讯业务	294,899,193.76	15.15
房地产	244,013,937.42	12.54
合计	1,858,465,745.51	95.49

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	H06600	赛生药业	19,904,000	193,420,487.76	9.94
2	H03690	美团-W	1,640,200	184,945,924.19	9.50
3	H01024	快手-W	3,640,600	179,743,808.78	9.24
4	H00081	中国海外宏洋集团	46,227,000	156,416,755.92	8.04
5	H01138	中远海能	18,848,000	136,586,985.25	7.02
6	H01378	中国宏桥	20,775,000	121,820,295.42	6.26
7	H06100	同道猎聘	14,505,200	121,297,683.96	6.23
8	H00700	腾讯控股	328,300	100,370,688.87	5.16
9	H09868	小鹏汽车-W	2,084,500	96,093,365.50	4.94
10	H01368	特步国际	12,306,500	90,543,848.02	4.65
11	H02186	绿叶制药	29,559,000	90,206,790.57	4.63
12	H02099	中国黄金国际	2,673,600	73,457,170.69	3.77
13	H01477	欧康维视生物-B	8,302,500	58,329,110.80	3.00
14	H03692	翰森制药	4,616,000	53,623,831.97	2.76
15	H01336	新华保险	2,692,600	51,264,107.14	2.63
16	H00123	越秀地产	6,087,000	51,126,160.49	2.63
17	H00688	中国海外发展	2,316,000	36,471,021.01	1.87
18	688369	致远互联	573,650	30,093,679.00	1.55
19	H01952	云顶新耀-B	812,500	17,828,788.25	0.92
20	H00743	亚洲水泥(中国)	2,934,000	10,468,695.67	0.54
21	002840	华统股份	521,400	8,154,696.00	0.42
22	603529	爱玛科技	244,950	7,892,289.00	0.41
23	H01860	汇量科技	2,457,000	7,792,648.72	0.40
24	H03799	达利食品	2,311,000	7,457,435.23	0.38

25	H00777	网龙	514,500	6,992,047.39	0.36
26	H01361	3 6 1 度	1,873,000	6,441,219.65	0.33
27	H01258	中国有色矿业	1,302,000	4,441,546.45	0.23
28	601827	三峰环境	539,974	3,995,807.60	0.21
29	600497	驰宏锌锗	705,300	3,540,606.00	0.18
30	H01658	邮储银行	254,000	1,128,761.67	0.06
31	603323	苏农银行	202,900	854,209.00	0.04
32	H00151	中国旺旺	41,000	196,566.14	0.01
33	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
34	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
35	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
36	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
37	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
38	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
39	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
40	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
41	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
42	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
43	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
44	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	H03690	美团-W	287,716,692.52	14.78
2	H00700	腾讯控股	222,273,265.94	11.42
3	H01024	快手-W	213,956,869.38	10.99
4	H06600	赛生药业	207,032,144.85	10.64

5	600256	广汇能源	198,537,422.40	10.20
6	H00883	中国海洋石油	189,199,840.23	9.72
7	H01138	中远海能	173,064,509.45	8.89
8	H00081	中国海外宏洋集团	168,500,973.19	8.66
9	H06100	同道猎聘	147,398,009.76	7.57
10	H01378	中国宏桥	139,408,977.96	7.16
11	H00688	中国海外发展	122,834,524.37	6.31
12	600497	驰宏锌锗	118,990,427.00	6.11
13	H00123	越秀地产	106,210,689.81	5.46
14	H01368	特步国际	101,200,551.03	5.20
15	H02186	绿叶制药	96,852,362.33	4.98
16	H02099	中国黄金国际	89,041,014.11	4.57
17	H09868	小鹏汽车-W	71,738,873.62	3.69
18	H01171	兖矿能源	66,954,896.53	3.44
19	H01477	欧康维视生物-B	57,678,226.33	2.96
20	H03692	翰森制药	54,431,991.82	2.80
21	H01336	新华保险	48,148,771.29	2.47

注：买入金额按买入成交金额（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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	H00883	中国海洋石油	225,061,085.52	11.56
2	600256	广汇能源	165,862,761.17	8.52

3	H00700	腾讯控股	126,918,239.58	6.52
4	600497	驰宏锌锗	111,060,015.28	5.71
5	H00688	中国海外发展	72,267,807.96	3.71
6	H01138	中远海能	67,112,498.67	3.45
7	H01171	兖矿能源	64,626,564.02	3.32
8	H03690	美团-W	58,958,651.62	3.03
9	H00123	越秀地产	45,638,990.93	2.34
10	H06600	赛生药业	42,408,957.67	2.18
11	H02099	中国黄金国际	30,961,809.80	1.59
12	H01024	快手-W	30,507,121.85	1.57
13	603323	苏农银行	18,997,334.00	0.98
14	601827	三峰环境	16,132,728.00	0.83
15	H01658	邮储银行	10,303,754.99	0.53
16	H01378	中国宏桥	5,047,492.74	0.26
17	H00151	中国旺旺	4,369,535.35	0.22
18	H00777	网龙	4,203,758.10	0.22
19	H00189	东岳集团	3,191,650.88	0.16
20	H01361	3 6 1 度	3,020,576.04	0.16

注：卖出金额按卖出成交金额（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	3,056,216,299.41
卖出股票收入（成交）总额	1,112,479,028.92

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，采用流动性好、交易活跃的合约品种，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，以达到降低投资组合整体风险的目的。

本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	77,218.31

3	应收股利	8,816,709.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,893,928.26

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项目之和与合计可能有尾差。

§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

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
22,015	89,798.12	141,378,601.47	7.15%	1,835,527,092.63	92.85%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	97,020,608.65	4.91%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：本基金的基金经理为本公司高级管理人员，上述统计数据有重合部分。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年01月11日)基金份额总额	1,976,905,694.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,976,905,694.10

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

本报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人于 2023 年 4 月 1 日发布《中庚基金管理有限公司关于高级管理人员（财务负责人）任职的公告》，自 2023 年 3 月 30 日起，由孟辉先生担任公司财务负责人职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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为其审计的会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
方正证券	3	1,799,986,410.79	43.23%	1,471,523.63	44.20%	-
中信证券	3	2,363,925,539.65	56.77%	1,857,788.00	55.80%	-

注：1.根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2.本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

3.本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

4.报告期内，本基金通过中信证券、方正证券的专用交易单元进行场内证券交易，无其他新增或停止使用的交易单元。

5.本基金选择的证券经纪商中信证券、方正证券与本公司不存在关联关系。

6.按照本基金分别与中信证券、方正证券签订的经纪服务协议，本基金通过其提供的交易单元进行股票交易的佣金费率为0.08%，进行债券交易的佣金费率为0.02%，实际支付的佣金已扣除由经纪服务商承担的费用，在进行交易结算时逐笔直接扣除。本基金通过

其提供的交易单元进行港股通股票交易的佣金费率为0.08%，在进行交易结算时逐笔直接扣除。

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	占当期基金成交总额的比例
方正证券	180,408,789.92	100.00%	6,398,200.00	83.49%	285,126.88	68.66%	-	-
中信证券	-	-	1,265,276.00	16.51%	130,175.99	31.34%	-	-

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	中庚基金管理有限公司关于中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-01-09
2	中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-01-12
3	中庚基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-01-19
4	中庚基金管理有限公司关于高级管理人员（财务负责人）任职的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-04-01
5	中庚基金管理有限公司关于公司网站升级暂停服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-04-07

6	中庚基金管理有限公司关于中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金关联交易公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-04-14
7	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2023年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-04-14
8	中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2023-04-14
9	中庚基金管理有限公司关于中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金关联交易公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2023-05-13

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过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.中国证监会批准设立中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金的文件
- 2.中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金合同
- 3.中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金招募说明书
- 4.中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金托管协议
- 5.中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金基金产品资料概要
- 6.中庚基金管理有限公司业务资格批复、营业执照和公司章程
- 7.报告期内中庚港股通价值18个月封闭运作股票型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告
- 8.中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服电话：021-53549999

公司网址：www.zgfunds.com.cn

中庚基金管理有限公司

二〇二三年八月十八日