

中欧中证港股通央企红利指数发起式证券
投资基金（QDII）
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36
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	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	56
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	64

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	64
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	64
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	64
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	64
7.11 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）	
基金简称	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)	
基金主代码	021583	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 1 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	147,797,924.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)A	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)C
下属分级基金的交 易代码	021583	021584
报告期末下属分级 基金的份额总额	37,277,860.80 份	110,520,063.38 份

2.2 基金产品说明

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

	金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金投资于境外证券市场，因此还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	南京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	王峰
	联系电话	021-68609600	021-24198808
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	wangf3@njcb.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95302
传真		021-50190017	025-86776189
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	南京市建邺区江山大街 88 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	南京市建邺区江山大街 88 号
邮政编码		200120	210019
法定代表人		窦玉明	谢宁

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	China Minsheng Banking Corp., Ltd., Hong Kong Branch
	中文	无	中国民生银行股份有限公司香港分行
注册地址		-	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		-	香港中西区中环金融街 8 号国际金融中心二期 40 楼
邮政编码		-	000000

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)A	中欧中证港股通央企红利指数发起 (QDII)C
本期已实现收益	838, 129. 09	2, 113, 447. 04
本期利润	3, 616, 822. 34	8, 238, 902. 21
加权平均基金份 额本期利润	0. 1258	0. 1308
本期加权平均净 值利润率	11. 51%	12. 04%
本期基金份额净 值增长率	10. 04%	9. 91%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1, 936, 207. 98	5, 386, 191. 47
期末可供分配基 金份额利润	0. 0519	0. 0487
期末基金资产净 值	44, 273, 610. 73	129, 726, 371. 74
期末基金份额净 值	1. 1877	1. 1738
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	18. 77%	17. 38%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.99%	0.79%	3.75%	0.86%	1.24%	-0.07%
过去三个月	9.98%	1.53%	7.75%	1.60%	2.23%	-0.07%
过去六个月	10.04%	1.26%	8.55%	1.31%	1.49%	-0.05%
过去一年	18.77%	1.41%	22.49%	1.46%	-3.72%	-0.05%
自基金合同生效起至今	18.77%	1.41%	22.49%	1.46%	-3.72%	-0.05%

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

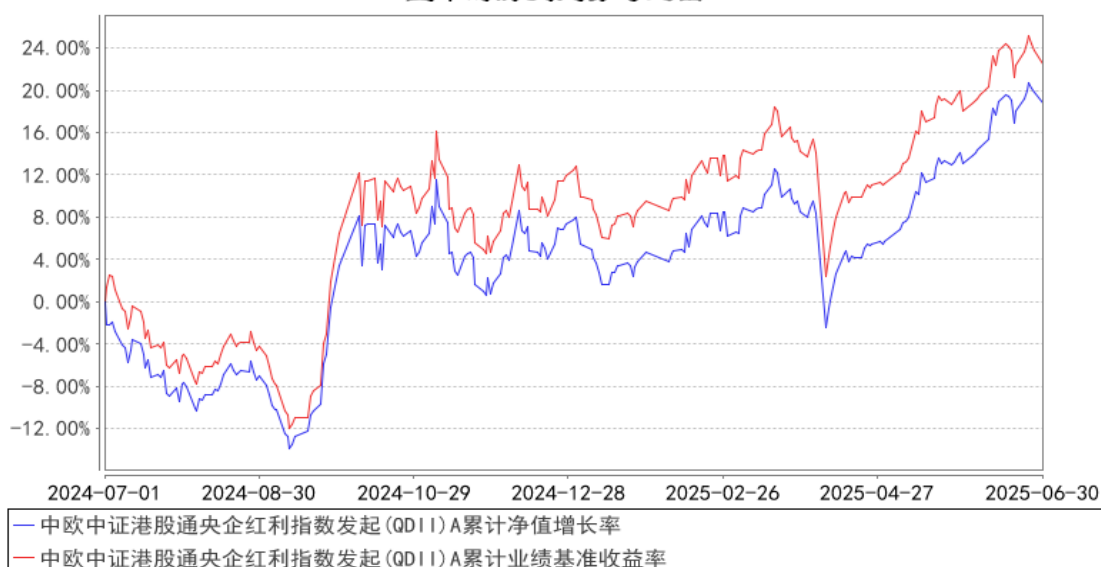
中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.97%	0.79%	3.75%	0.86%	1.22%	-0.07%
过去三个月	9.94%	1.53%	7.75%	1.60%	2.19%	-0.07%
过去六个月	9.91%	1.26%	8.55%	1.31%	1.36%	-0.05%
过去一年	17.38%	1.40%	22.49%	1.46%	-5.11%	-0.06%
自基金合同生效起至今	17.38%	1.40%	22.49%	1.46%	-5.11%	-0.06%

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

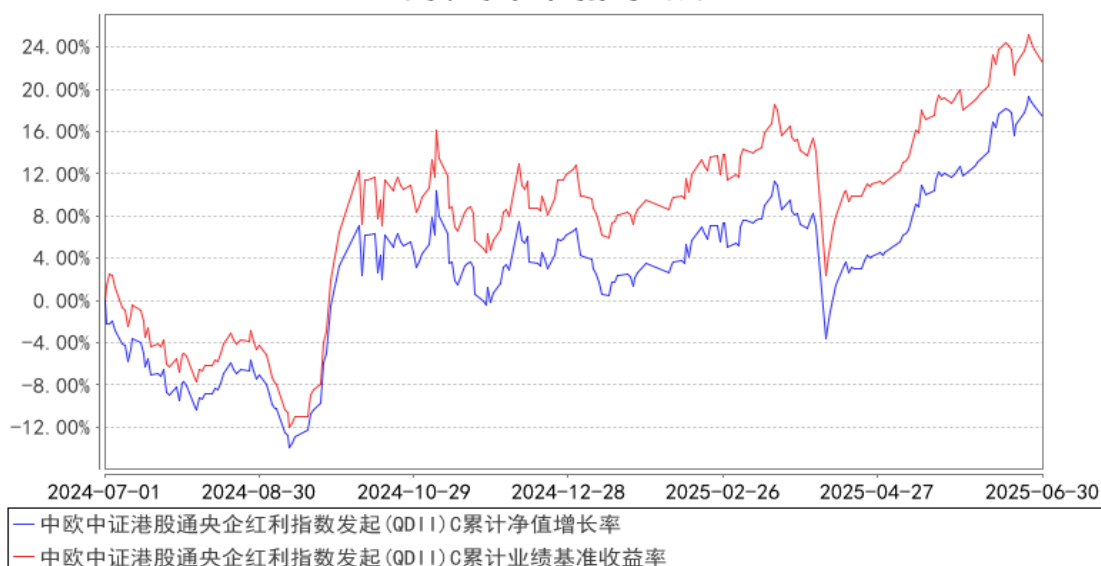
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金基金合同生效日期为 2024 年 7 月 1 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

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



注：本基金基金合同生效日期为 2024 年 7 月 1 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 208 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
FANG SHENSHEN	基金经理	2024-07-01	—	19 年	历任高盛私人财富管理部税务分析师，Cooper Investors 助理基金会计师、交易员、新兴市场组研究员。2019-02-11 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员。
张聪	基金经理 / 基金经理助理	2024-09-19	—	4 年	历任友联互通信息技术有限公司高级软件工程师，IDG 资本投资顾问（北京）有限公司分析师，北京联和运通投资有限公司高级分析师，华兴资本新经济基金数据研究副总裁/数据团队负责人，高瓴资本 PE 大消费组副总裁，西部证券研究发展中心另类数据总监。2023-08-21 加入中欧基金管理有限公司。

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

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

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中张聪担任本基金的基金经理助理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 19 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

2025 年上半年，港股通央企红利指数上涨 10.6%，跑输恒生指数和恒生科技指数，但跑赢沪深 300 和中证红利指数。上半年，地缘局势总体可控，外溢风险相对有限。关税谈判后暂停期延长至 7、8 月份，为市场提供了缓冲期，港股市场流动性短期充裕。经历了几轮主题轮动后，恒生指数上半年涨幅 20%，逼近年内新高。自去年 9.24 以来，在港股市场整体估值处于历史低位、企业派息意愿持续增强、中长期资金入市政策支持力度加入等多重因素驱动下，红利策略逐渐成为投资者配置高现金流、低波动资产的重要工具，这一趋势至今已经持续了一年左右。

当前央国企相关的资源板块仍处于估值洼地，而当下此类板块正迎来多重政策因素催化。7 月 1 日财经委会议召开，标志着“反内卷”政策从前期党中央层面定方向，逐渐转向中央政府层面的政策制定和地方政府的配合执行，节奏上类似于 2015 年 11 月至 2016 年 2 月的政府部门加速参与阶段，各行业“反内卷”的主要方式逐渐从 7 月 1 日前以行业自律为主，进一步升级为国务院各部委加速参与。同时我们应该看到，化债行为还在持续进行中，地方财政不断发力，央国企

长期累积的应收账款有望得到明显改善，从而进一步提升企业的现金流状况。下半年相关资源板块有望受益于基建项目带来的订单增长，以基建类、周期类为主的央企上市公司有望得到进一步提振。

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 10.04%，同期业绩比较基准收益率为 8.55%；基金 C 类份额净值增长率为 9.91%，同期业绩比较基准收益率为 8.55%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们继续看好央企红利资产的配置价值。当前指数权重股主要聚焦于大型能源运输与金融央企，这些资产都具备良好的分红能力与稳定现金流，且对周期变化有较高的敏感性。在全球流动性宽松的背景下，周期类资产有较强的利润弹性。从股息率来看，截至二季度末，港股通央企红利指数仍有 7.9%股息率，优于中证红利指数的 5.6%，尤其是和 10 年期国债利率相比继续保持优势；估值层面来看，港股通央企红利指数当前 7X 左右的 PE 估值低于中证红利指数。投资操作方面，本基金秉承被动化投资理念，力争紧密跟踪基准指数表现，并做好对指数成份调整、申赎和流动性头寸的应对，将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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，南京银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）（以下称“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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	18,418,189.97	10,523,761.40
结算备付金		4,096,027.26	—
存出保证金		269,847.73	—
交易性金融资产	6.4.7.2	160,843,430.38	53,688,113.55

其中：股票投资		160,843,430.38	53,688,113.55
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		2,530,537.66	125,309.01
应收申购款		3,146,152.27	3,782,891.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		189,304,185.27	68,120,075.10
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,095,855.07	5,079,951.64
应付赎回款		11,045,945.98	2,313,211.04
应付管理人报酬		60,698.77	21,662.84
应付托管费		12,139.79	4,332.59
应付销售服务费		22,120.66	7,093.76
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	67,442.53	18,107.97
负债合计		15,304,202.80	7,444,359.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	147,797,924.18	56,585,166.93
未分配利润	6.4.7.8	26,202,058.29	4,090,548.33
净资产合计		173,999,982.47	60,675,715.26
负债和净资产总计		189,304,185.27	68,120,075.10

注： 1. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 147,797,924.18 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.1877 元，基金份额总额 37,277,860.80 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.1738 元，基金份额总额 110,520,063.38 份。

2. 本基金基金合同于 2024 年 07 月 01 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,304,416.78
1. 利息收入		18,959.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,959.24
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,734,926.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-111,538.30
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
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	3,846,464.44
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	8,904,148.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-370,172.95
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,555.93
减：二、营业总支出		448,692.23
1. 管理人报酬		245,416.75
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费		49,083.40
3. 销售服务费		84,030.63
4. 投资顾问费		-

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	70, 161. 45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11, 855, 724. 55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11, 855, 724. 55
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11, 855, 724. 55

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	56, 585, 166. 93	-	4, 090, 548. 33	60, 675, 715. 26
二、本期期初净资产	56, 585, 166. 93	-	4, 090, 548. 33	60, 675, 715. 26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	91, 212, 757. 25	-	22, 111, 509. 96	113, 324, 267. 21
（一）、综合收益总额	-	-	11, 855, 724. 55	11, 855, 724. 55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	91, 212, 757. 25	-	10, 255, 785. 41	101, 468, 542. 66
其中：1. 基金申购款	240, 678, 072. 20	-	22, 932, 335. 00	263, 610, 407. 20
2. 基金赎回款	- 149, 465, 314. 95	-	-12, 676, 549. 59	-162, 141, 864. 54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
四、本期期末净资产	147,797,924.18	-	26,202,058.29	173,999,982.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

基金管理人负责人

王音然

主管会计工作负责人

李宝林

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 [2024]791 号《关于准予中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定。经向中国证监会备案，《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》于 2024 年 7 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 40,556,227.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,007.37 份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)基金合同》和《中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金(QDII)招募说明书》，本基金根据认购/申购、赎回所使用的货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购/申购、赎回的份额类别，统称为人民币份额；以美元计价并进行认购/申购、赎回的份额类别，统称为美元份额(特指美元现汇份额)。在人民币份额和美元份额类别内，根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将人民币份额和美元份额各自分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资人认购/申购时，收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，但从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，各类别基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别，并交付相应币种的款项。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用

发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于

延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利, H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册, H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利, 由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	18,418,189.97
等于：本金	18,416,365.05
加：应计利息	1,824.92
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	18,418,189.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		149,769,493.92	—	160,843,430.38	11,073,936.46
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		149,769,493.92	—	160,843,430.38	11,073,936.46

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	149.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,694.45
其中：交易所市场	18,694.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	8,926.92
预提费用-信息披露费	39,671.58
合计	67,442.53

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,569,350.04	21,569,350.04
本期申购	29,858,135.20	29,858,135.20
本期赎回（以“-”号填列）	-14,149,624.44	-14,149,624.44
本期末	37,277,860.80	37,277,860.80

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,015,816.89	35,015,816.89
本期申购	210,819,937.00	210,819,937.00
本期赎回（以“-”号填列）	-135,315,690.51	-135,315,690.51
本期末	110,520,063.38	110,520,063.38

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	594,288.82	1,116,061.86	1,710,350.68
本期期初	594,288.82	1,116,061.86	1,710,350.68
本期利润	838,129.09	2,778,693.25	3,616,822.34
本期基金份额交易产生的变动数	503,790.07	1,164,786.84	1,668,576.91
其中：基金申购款	892,182.40	1,973,308.71	2,865,491.11
基金赎回款	-388,392.33	-808,521.87	-1,196,914.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,936,207.98	5,059,541.95	6,995,749.93

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	908,456.97	1,471,740.68	2,380,197.65
本期期初	908,456.97	1,471,740.68	2,380,197.65
本期利润	2,113,447.04	6,125,455.17	8,238,902.21
本期基金份额交易产生的变动数	2,364,287.46	6,222,921.04	8,587,208.50
其中：基金申购款	6,009,221.63	14,057,622.26	20,066,843.89
基金赎回款	-3,644,934.17	-7,834,701.22	-11,479,635.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,386,191.47	13,820,116.89	19,206,308.36

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,244.36
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	1,444.12
其他	270.76
合计	18,959.24

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,900,891.87
减：卖出股票成本总额	8,807,603.89
减：交易费用	204,826.28

买卖股票差价收入	-111,538.30
----------	-------------

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,846,464.44
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	3,846,464.44

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,904,148.42
股票投资	8,904,148.42
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,904,148.42

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,555.93
合计	16,555.93

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	8,926.92
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,850.61
账户维护费	9,000.00
证券组合费	712.34
合计	70,161.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2025 年 7 月 12 日宣告收益分配基准日为 2025 年 7 月 7 日的分红，向截至 2025 年 7 月 15 日止在本基金 A 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.114 元；向截至 2025 年 7 月 15 日止在本基金 C 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.107 元。

本基金的基金管理人于 2025 年 8 月 15 日宣告收益分配基准日为 2025 年 8 月 7 日的分红，向截至 2025 年 8 月 19 日止在本基金 A 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.193 元；向截至 2025 年 8 月 19 日止在本基金 C 类份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.181 元。

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，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国民生银行股份有限公司香港分行	境外托管人
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金托管人
自然人股东	基金管理人股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	245,416.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	93,830.73
应支付基金管理人的净管理费	151,586.02

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

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	49,083.40

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C	合计
中欧财富	-	6,685.29	6,685.29
合计	-	6,685.29	6,685.29

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

计算方法如下：

$$H=E\times 0.25\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 7 月 1 日）持有的基金份额	-
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例	26.83%

- 注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
- 2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 3、本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金 C 类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中欧财富	375.19	0.00%	-	-
自然人股东	2,869,022.77	2.60%	2,847,299.21	8.13%

- 注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 A 类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
南京银行股份有限公司	17,291,361.33	17,240.45
中国民生银行股份有限公司香港分行	1,126,828.64	3.91

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2025 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 2025 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 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限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%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,418,189.97	-	-	-	18,418,189.97
结算备付金	4,096,027.26	-	-	-	4,096,027.26
存出保证金	269,847.73	-	-	-	269,847.73
交易性金融资产	-	-	-	160,843,430.38	160,843,430.38
应收股利	-	-	-	2,530,537.66	2,530,537.66
应收申购款	-	-	-	3,146,152.27	3,146,152.27
资产总计	22,784,064.96	-	-	166,520,120.31	189,304,185.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,045,945.98	11,045,945.98
应付管理人报酬	-	-	-	60,698.77	60,698.77
应付托管费	-	-	-	12,139.79	12,139.79
应付清算款	-	-	-	4,095,855.07	4,095,855.07
应付销售服务费	-	-	-	22,120.66	22,120.66
其他负债	-	-	-	67,442.53	67,442.53
负债总计	-	-	-	15,304,202.80	15,304,202.80
利率敏感度缺口	22,784,064.96	-	-	151,215,917.51	173,999,982.47
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2024 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	10,523,761.40	-	-	-	10,523,761.40
交易性金融资产	-	-	-	53,688,113.55	53,688,113.55
应收股利	-	-	-	125,309.01	125,309.01
应收申购款	-	-	-	3,782,891.14	3,782,891.14
资产总计	10,523,761.40	-	-	57,596,313.70	68,120,075.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,313,211.04	2,313,211.04
应付管理人报酬	-	-	-	21,662.84	21,662.84
应付托管费	-	-	-	4,332.59	4,332.59
应付清算款	-	-	-	5,079,951.64	5,079,951.64
应付销售服务费	-	-	-	7,093.76	7,093.76
其他负债	-	-	-	18,107.97	18,107.97
负债总计	-	-	-	7,444,359.84	7,444,359.84
利率敏感度缺口	10,523,761.40	-	-	50,151,953.86	60,675,715.26

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 2025 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 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 2025 年 6 月 30 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	-	1,126,828.73	-	1,126,828.73
交易性金融资 产	-	160,843,430.38	-	160,843,430.38

应收股利	-	2, 530, 537. 66	-	2, 530, 537. 66
资产合计	-	164, 500, 796. 77	-	164, 500, 796. 77
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	164, 500, 796. 77	-	164, 500, 796. 77
项目	上年度末 2024 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	-	8, 425, 981. 32	-	8, 425, 981. 32
交易性金融资 产	-	53, 688, 113. 55	-	53, 688, 113. 55
应收股利	-	125, 309. 01	-	125, 309. 01
资产合计	-	62, 239, 403. 88	-	62, 239, 403. 88
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	5, 079, 951. 64	-	5, 079, 951. 64
负债合计	-	5, 079, 951. 64	-	5, 079, 951. 64
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	57, 159, 452. 24	-	57, 159, 452. 24

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变 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 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	港币相对人民币贬 值 5%	-8, 225, 039. 84	-2, 857, 972. 61

	港币相对人民币升值 5%	8, 225, 039. 84	2, 857, 972. 61
--	--------------	-----------------	-----------------

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	160, 843, 430. 38	92. 44	53, 688, 113. 55	88. 48
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	160, 843, 430. 38	92. 44	53, 688, 113. 55	88. 48

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	8, 336, 602. 91	2, 807, 361. 19
	业绩比较基准下降 5%	-8, 336, 602. 91	-2, 807, 361. 19

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	160,843,430.38	53,688,113.55
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	160,843,430.38	53,688,113.55

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	160,843,430.38	84.97
	其中：普通股	160,843,430.38	84.97
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	22,514,217.23	11.89
8	其他各项资产	5,946,537.66	3.14
9	合计	189,304,185.27	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 80,601,300.94 元，占基金资产净值比例 46.32%。

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	160,843,430.38	92.44
合计	160,843,430.38	92.44

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
------	------	---------------

基础材料	7,081,857.17	4.07
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	20,251,659.99	11.64
金融	55,452,273.37	31.87
医疗保健	3,191,825.00	1.83
工业	50,720,529.62	29.15
信息技术	2,456,629.15	1.41
电信服务	13,821,815.15	7.94
公用事业	1,806,755.34	1.04
地产业	6,060,085.59	3.48
合计	160,843,430.38	92.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	中远海运控股股份有限公司	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	519,000	6,455,839.96	3.71
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	中远海运控股股份有限公司	01919 HS	深港通联合市场	中国	407,500	5,068,891.69	2.91
2	Orient Overseas (International) Limited	东方海外(国际)有限公司	00316 HS	深港通联合市场	中国	22,000	2,676,390.86	1.54

	onal) Limit ed							
2	Orien t Overs eas (Inte rnati onal) Limit ed	东方海 外(国 际)有 限公司	316 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	21,500	2,615,563.80	1.50
3	China Citic Bank Corpo ratio n Limit ed	中信银 行股份 有限公 司	00998 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	377,000	2,571,662.52	1.48
3	China Citic Bank Corpo ratio n Limit ed	中信银 行股份 有限公 司	998 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	367,000	2,503,448.66	1.44
4	Petro China Compa ny Limit ed	中国石 油天然 气股份 有限公 司	00857 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	350,000	2,154,481.88	1.24
4	Petro China Compa ny Limit ed	中国石 油天然 气股份 有限公 司	857 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	342,000	2,105,236.58	1.21
5	China Everb right Bank Compa	中国光 大银行 股份有 限公司	06818 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	602,000	2,152,056.09	1.24

	ny Limit ed							
5	China Everb right Bank Compa ny Limit ed	中国光 大银行 股份有 限公司	6818 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	576,000	2,059,110.14	1.18
6	Sinot rans Limit ed	中国外 运股份 有限公 司	00598 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	572,000	2,076,108.89	1.19
6	Sinot rans Limit ed	中国外 运股份 有限公 司	598 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	567,000	2,057,961.09	1.18
7	AGRIC ULTUR AL BANK OF CHINA LIMIT ED	中国农 业银行 股份有 限公司	01288 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	406,000	2,073,409.52	1.19
7	AGRIC ULTUR AL BANK OF CHINA LIMIT ED	中国农 业银行 股份有 限公司	1288 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	399,000	2,037,661.08	1.17
8	CNOOC Limit ed	中国海 洋石油 有限公 司	00883 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	126,000	2,036,129.00	1.17
8	CNOOC Limit ed	中国海 洋石油 有限公 司	883 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	120,000	1,939,170.48	1.11
9	China Const	中国建 设银行	00939 HS	深 港 通 联 合 市	中国	273,000	1,971,781.81	1.13

	ructi on Bank Corpo ratio n	股份有 限公司		场				
9	China Const ructi on Bank Corpo ratio n	中国建 设银行 股份有 限公司	939 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	271,000	1,957,336.52	1.12
10	Indus trial and Comme rcial Bank of China Limit ed	中国工 商银行 股份有 限公司	01398 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	344,000	1,951,281.18	1.12
10	Indus trial and Comme rcial Bank of China Limit ed	中国工 商银行 股份有 限公司	1398 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	328,000	1,860,523.91	1.07
11	Cssc (Hong Kong) Shipp ing Compa ny Limit ed	中国船 舶集团 (香港) 航运租 赁有限 公司	03877 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	1,006,0 00	1,926,585.57	1.11
11	Cssc (Hong	中国船 舶集团	3877 HK	香 港 联 合 交 易	中国香 港	974,000	1,865,302.53	1.07

	Kong) Shipp ing Compa ny Limit ed	(香港) 航运租 赁有限 公司		所				
12	The Peopl e's Insur ance Compa ny (Grou p) Of China Limit ed	中国人 民保险 集团股 份有限 公司	01339 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	352,000	1,916,408.21	1.10
12	The Peopl e's Insur ance Compa ny (Grou p) Of China Limit ed	中国人 民保险 集团股 份有限 公司	1339 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	344,000	1,872,853.48	1.08
13	China Unico m (Hong Kong) Limit ed	中国联 合网络 通信(香港) 股份有 限公司	00762 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	228,000	1,933,698.78	1.11
13	China Unico m (Hong Kong) Limit ed	中国联 合网络 通信(香港) 股份有 限公司	762 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	212,000	1,798,000.62	1.03

14	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行股份有限公司	03328 HS	深港通联合市场	中国	282,000	1,877,340.27	1.08
14	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行股份有限公司	3328 HK	香港联合交易所	中国香港	276,000	1,837,396.86	1.06
15	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	03988 HS	深港通联合市场	中国	453,000	1,883,796.88	1.08
15	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	434,000	1,804,785.53	1.04
16	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	01088 HS	深港通联合市场	中国	65,000	1,804,977.04	1.04
16	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港联合交易所	中国香港	63,500	1,763,323.72	1.01
17	China Mobile	中国移动有限公司	00941 HS	深港通联合市场	中国	22,000	1,747,478.59	1.00

	Limit ed							
17	China Mobil e Limit ed	中国移 动有限 公司	941 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	21,500	1,707,763.17	0.98
18	CITIC Telec om Inter natio nal Holdi ngs Limit ed	中信国 际电讯 集团有 限公司	01883 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	797,000	1,744,377.96	1.00
18	CITIC Telec om Inter natio nal Holdi ngs Limit ed	中信国 际电讯 集团有 限公司	1883 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	779,000	1,704,981.72	0.98
19	New China Life Insur ance Compa ny Ltd.	新华人 寿保险 股份有 限公司	01336 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	44,100	1,719,276.54	0.99
19	New China Life Insur ance Compa ny Ltd.	新华人 寿保险 股份有 限公司	1336 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	43,000	1,676,392.09	0.96
20	CITIC Limit	中国中 信股份	00267 HS	深 港 通 联 合 市	中国	175,000	1,720,393.68	0.99

	ed	有限公司		场				
20	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	267 HK	香港联合交易所	中国香港	168,000	1,651,577.93	0.95
21	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	中石化炼化工程(集团)股份有限公司	02386 HS	深港通联合市场	中国	311,000	1,696,026.37	0.97
21	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	中石化炼化工程(集团)股份有限公司	2386 HK	香港联合交易所	中国香港	304,500	1,660,578.87	0.95
22	Generalec Universal Medical Group Company Limited	通用环球医疗集团有限公司	02666 HS	深港通联合市场	中国	316,500	1,616,340.18	0.93
22	Generalec Universal Medical Group Company Limited	通用环球医疗集团有限公司	2666 HK	香港联合交易所	中国香港	308,500	1,575,484.82	0.91

	ed							
23	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	00728 HS	深港通联合市场	中国	318,000	1,618,200.56	0.93
23	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	728 HK	香港联合交易所	中国香港	308,000	1,567,313.75	0.90
24	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	02388 HS	深港通联合市场	中国	52,000	1,617,069.74	0.93
24	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港联合交易所	中国香港	49,500	1,539,326.00	0.88
25	Picc Property And Casualty Company Limited	中国人民财产保险股份有限公司	02328 HS	深港通联合市场	中国	110,000	1,524,780.40	0.88
25	Picc Property And	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	香港联合交易所	中国香港	110,000	1,524,780.40	0.88

	Casualty Company Limited	公司						
26	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	00386 HS	深港通联合市场	中国	406,000	1,521,734.49	0.87
26	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港联合交易所	中国香港	406,000	1,521,734.49	0.87
27	China Merchants Port Holdings Company Limited	招商局港口控股有限公司	00144 HS	深港通联合市场	中国	108,000	1,408,415.58	0.81
27	China Merchants Port Holdings Company Limited	招商局港口控股有限公司	144 HK	香港联合交易所	中国香港	106,000	1,382,333.81	0.79
28	Sinop	中石化	00934	深港通	中国	332,000	1,377,591.67	0.79

	ec Kanto ns Holdi ngs Limit ed	冠德控 股有限 公司	HS	联 合 市 场				
28	Sinop ec Kanto ns Holdi ngs Limit ed	中石化 冠德控 股有限 公司	934 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	324,000	1,344,396.69	0.77
29	China Merch ants Bank Co.,L td.	招商银 行股份 有限公 司	03968 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	27,500	1,375,562.58	0.79
29	China Merch ants Bank Co.,L td.	招商银 行股份 有限公 司	3968 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	26,500	1,325,542.12	0.76
30	China Coal Energ y Compa ny Limit ed	中国中 煤能源 股份有 限公司	01898 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	163,000	1,349,722.48	0.78
30	China Coal Energ y Compa ny Limit ed	中国中 煤能源 股份有 限公司	1898 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	161,000	1,333,161.47	0.77
31	Posta l	中国邮 政储蓄	01658 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	273,000	1,364,313.68	0.78

	Savings Bank Of China Corporation Limited	银行股份有限公司		场				
31	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	中国邮政储蓄银行股份有限公司	1658 HK	香港联合交易所	中国香港	262,000	1,309,341.33	0.75
32	COSCO SHIPPING Development Co., Ltd.	中远海运发展股份有限公司	2866 HK	香港联合交易所	中国香港	1,389,000	1,342,700.46	0.77
32	COSCO SHIPPING Development Co., Ltd.	中远海运发展股份有限公司	02866 HS	深港通联合市场	中国	1,369,000	1,323,367.12	0.76
33	China Nonferrous Mining Corporation	中国有色矿业公司	1258 HK	香港联合交易所	中国香港	198,000	1,316,326.87	0.76

	n Limit ed							
33	China Nonfe rrous Minin g Corpo ratio n Limit ed	中国有 色矿业 有限公 司	01258 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	190,000	1,263,141.95	0.73
34	China Railw ay Signa l & Comm unicat ion Corpo ratio n Limit ed	中国铁 路通信 信号股 份有限 公司	03969 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	424,000	1,248,933.76	0.72
34	China Railw ay Signa l & Comm unicat ion Corpo ratio n Limit ed	中国铁 路通信 信号股 份有限 公司	3969 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	410,000	1,207,695.39	0.69
35	Sinof ert Holdi ngs Limit ed	中化化 肥控股 有限公 司	00297 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	1,048,0 00	1,223,326.21	0.70

35	Sinofert Holdings Limited	中化化肥控股有限公司	297 HK	香港联合交易所	中国香港	1,022,000	1,192,976.51	0.69
36	China Galaxy Securities Co., Ltd.	中国银河证券股份有限公司	06881 HS	深港通联合市场	中国	151,500	1,219,956.55	0.70
36	China Galaxy Securities Co., Ltd.	中国银河证券股份有限公司	6881 HK	香港联合交易所	中国香港	147,500	1,187,746.48	0.68
37	China Communications Construction Company Limited	中国交通建设股份有限公司	01800 HS	深港通联合市场	中国	256,000	1,197,645.70	0.69
37	China Communications Construction Company Limited	中国交通建设股份有限公司	1800 HK	香港联合交易所	中国香港	250,000	1,169,575.88	0.67
38	China Everbright	中国光大环境(集团)	00257 HS	深港通联合市场	中国	340,000	1,184,440.66	0.68

	Environment Group Limited	有限公司						
38	China Everbright Environment Group Limited	中国光大环境(集团)有限公司	257 HK	香港联合交易所	中国香港	333,000	1,160,055.12	0.67
39	China Railway Construction Corporation Limited	中国铁建股份有限公司	01186 HS	深港通联合市场	中国	238,000	1,178,549.46	0.68
39	China Railway Construction Corporation Limited	中国铁建股份有限公司	1186 HK	香港联合交易所	中国香港	232,500	1,151,314.08	0.66
40	China State Construction International	中国建筑国际集团有限公司	03311 HS	深港通联合市场	中国	112,000	1,209,318.66	0.70

	Holdings Limited							
40	China State Construction International Holdings Limited	中国建筑国际集团有限公司	3311 HK	香港联合交易所	中国香港	96,000	1,036,558.85	0.60
41	China Communications Services Corporation Limited	中国通信服务股份有限公司	00552 HS	深港通联合市场	中国	292,000	1,131,729.95	0.65
41	China Communications Services Corporation Limited	中国通信服务股份有限公司	552 HK	香港联合交易所	中国香港	286,000	1,108,475.23	0.64
42	First Tractor Company Limited	第一拖拉机股份有限公司	00038 HS	深港通联合市场	中国	172,000	1,083,870.81	0.62

42	First Tractor Company Limited	第一拖拉机股份有限公司	38 HK	香港联合交易所	中国香港	166,000	1,046,061.37	0.60
43	China Overseas Grand Oceans Group Limited	中国海外宏洋集团有限公司	00081 HS	深港通联合市场	中国	676,000	1,097,331.20	0.63
43	China Overseas Grand Oceans Group Limited	中国海外宏洋集团有限公司	81 HK	香港联合交易所	中国香港	628,000	1,019,414.19	0.59
44	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	01766 HS	深港通联合市场	中国	248,000	1,072,015.46	0.62
44	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	1766 HK	香港联合交易所	中国香港	240,000	1,037,434.32	0.60
45	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	01109 HS	深港通联合市场	中国	44,000	1,067,346.28	0.61
45	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	42,000	1,018,830.54	0.59

	rces Land Limit ed	公司		所				
46	China Natio nal Build ing Mater ial Compa ny Limit ed	中国建 材股份 有限公 司	3323 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	366,000	1,251,651.38	0.72
46	China Natio nal Build ing Mater ial Compa ny Limit ed	中国建 材股份 有限公 司	03323 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	244,000	834,434.25	0.48
47	China Cinda Asset Manag ement Co., Ltd.	中国信 达资产 管理股 份有限 公司	01359 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	800,000	977,610.40	0.56
47	China Cinda Asset Manag ement Co., Ltd.	中国信 达资产 管理股 份有限 公司	1359 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	792,000	967,834.30	0.56
48	Green town China Holdi ngs	绿城中 国控股 有限公 司	03900 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	110,000	947,972.03	0.54

	Limit ed							
48	Green town China Holdi ngs Limit ed	绿城中 国控股 有限公 司	3900 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	105,500	909,191.35	0.52
49	China Railw ay Group Limit ed	中国中 铁股份 有限公 司	00390 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	268,000	918,953.78	0.53
49	China Railw ay Group Limit ed	中国中 铁股份 有限公 司	390 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	262,000	898,380.18	0.52
50	Kunlu n Energ y Compa ny Limit ed	昆仑能 源有限 公司	00135 HS	深 港 通 联 合 市 场	中国	136,000	945,072.02	0.54
50	Kunlu n Energ y Compa ny Limit ed	昆仑能 源有限 公司	135 HK	香 港 联 合 交 易 所	中国香 港	124,000	861,683.32	0.50

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	01919 HS	6,163,258.52	10.16
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	1919 HK	1,835,974.54	3.03
2	Orient Overseas (International) Limited	00316 HS	2,729,730.49	4.50
2	Orient Overseas (International) Limited	316 HK	619,730.06	1.02
3	China Citic Bank Corporation Limited	00998 HS	2,659,429.07	4.38
3	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	484,358.55	0.80
4	CNOOC Limited	00883 HS	2,355,466.48	3.88
4	CNOOC Limited	883 HK	568,301.04	0.94
5	PetroChina Company Limited	00857 HS	2,335,166.87	3.85
5	PetroChina Company Limited	857 HK	547,528.27	0.90
6	Sinotrans Limited	00598 HS	2,268,266.05	3.74
6	Sinotrans Limited	598 HK	518,762.35	0.85
7	China Shenhua Energy Company Limited	01088 HS	2,250,065.45	3.71
7	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	512,816.23	0.85
8	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED	01288 HS	2,228,806.04	3.67
8	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED	1288 HK	389,724.07	0.64
9	China Unicom (Hong Kong) Limited	00762 HS	2,210,921.35	3.64

9	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	385,274.56	0.63
10	China Construction Bank Corporation	00939 HS	2,123,642.46	3.50
10	China Construction Bank Corporation	939 HK	416,628.51	0.69
11	China Everbright Bank Company Limited	06818 HS	2,100,644.19	3.46
11	China Everbright Bank Company Limited	6818 HK	424,029.52	0.70
12	Bank of China Limited	03988 HS	2,110,365.43	3.48
12	Bank of China Limited	3988 HK	411,872.74	0.68
13	Bank of Communications Co., Ltd.	03328 HS	2,042,924.32	3.37
13	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	439,126.20	0.72
14	Industrial and Commercial Bank of China Limited	01398 HS	2,077,549.44	3.42
14	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	381,225.03	0.63
15	China Mobile Limited	00941 HS	1,930,485.41	3.18
15	China Mobile Limited	941 HK	489,380.19	0.81
16	Cssc (Hong Kong) Shipping Company Limited	03877 HS	1,947,935.49	3.21
16	Cssc (Hong Kong) Shipping Company Limited	3877 HK	432,339.54	0.71
17	CITIC Telecom International Holdings Limited	01883 HS	1,883,686.95	3.10

17	CITIC Telecom International Holdings Limited	1883 HK	438,653.32	0.72
18	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	02386 HS	1,760,323.66	2.90
18	SINOPEC Engineering (Group) Co., Ltd.	2386 HK	487,039.42	0.80
19	China Telecom Corporation Limited	00728 HS	1,873,105.72	3.09
19	China Telecom Corporation Limited	728 HK	362,599.34	0.60
20	CITIC Limited	00267 HS	1,877,479.31	3.09
20	CITIC Limited	267 HK	350,774.61	0.58
21	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	01339 HS	1,840,958.93	3.03
21	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	1339 HK	320,145.50	0.53
22	China Petroleum & Chemical Corporation	00386 HS	1,707,175.09	2.81
22	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	444,489.80	0.73
23	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	02388 HS	1,804,847.75	2.97
23	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	298,074.19	0.49
24	Picc Property And Casualty Company Limited	02328 HS	1,727,715.27	2.85
24	Picc Property And Casualty Company Limited	2328 HK	332,776.38	0.55

25	Genertec Universal Medical Group Company Limited	02666 HS	1,672,935.09	2.76
25	Genertec Universal Medical Group Company Limited	2666 HK	371,575.60	0.61
26	China Merchants Port Holdings Company Limited	00144 HS	1,504,655.97	2.48
26	China Merchants Port Holdings Company Limited	144 HK	364,989.92	0.60
27	New China Life Insurance Company Ltd.	01336 HS	1,557,421.98	2.57
27	New China Life Insurance Company Ltd.	1336 HK	246,819.19	0.41
28	Sinopec Kantons Holdings Limited	00934 HS	1,423,041.74	2.35
28	Sinopec Kantons Holdings Limited	934 HK	370,774.76	0.61
29	COSCOSHIPPING Development Co.,Ltd.	02866 HS	1,427,015.09	2.35
29	COSCOSHIPPING Development Co.,Ltd.	2866 HK	355,105.35	0.59
30	China Coal Energy Company Limited	01898 HS	1,385,291.47	2.28
30	China Coal Energy Company Limited	1898 HK	371,847.42	0.61
31	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	03969 HS	1,388,235.74	2.29
31	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	3969 HK	341,330.56	0.56

32	China Merchants Bank Co., Ltd.	03968 HS	1,444,005.79	2.38
32	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	277,425.11	0.46
33	China Communications Services Corporation Limited	00552 HS	1,386,140.02	2.28
33	China Communications Services Corporation Limited	552 HK	311,859.70	0.51
34	China State Construction International Holdings Limited	03311 HS	1,381,482.71	2.28
34	China State Construction International Holdings Limited	3311 HK	309,094.94	0.51
35	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	01658 HS	1,390,881.14	2.29
35	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	1658 HK	293,953.81	0.48
36	China Communications Construction Company Limited	01800 HS	1,317,665.15	2.17
36	China Communications Construction Company Limited	1800 HK	330,887.24	0.55
37	Sinofert Holdings Limited	00297 HS	1,321,907.25	2.18
37	Sinofert Holdings Limited	297 HK	288,391.95	0.48
38	China Railway Construction	01186 HS	1,248,771.96	2.06

	Corporation Limited			
38	China Railway Construction Corporation Limited	1186 HK	325,239.07	0.54
39	China Everbright Environment Group Limited	00257 HS	1,237,201.89	2.04
39	China Everbright Environment Group Limited	257 HK	297,488.97	0.49
40	First Tractor Company Limited	00038 HS	1,242,938.49	2.05
40	First Tractor Company Limited	38 HK	286,492.36	0.47
41	CRRC Corporation Limited	01766 HS	1,229,406.62	2.03
41	CRRC Corporation Limited	1766 HK	297,021.79	0.49
42	China Galaxy Securities Co., Ltd.	06881 HS	1,207,708.74	1.99
42	China Galaxy Securities Co., Ltd.	6881 HK	253,752.01	0.42
43	China Overseas Grand Oceans Group Limited	00081 HS	1,164,209.82	1.92
43	China Overseas Grand Oceans Group Limited	81 HK	277,913.60	0.46
44	China National Building Material Company Limited	03323 HS	1,095,782.12	1.81
44	China National Building Material Company Limited	3323 HK	327,199.99	0.54
45	China Nonferrous Mining Corporation Limited	01258 HS	1,152,363.66	1.90
45	China Nonferrous Mining	1258 HK	261,159.27	0.43

	Corporation Limited			
46	China Resources Land Limited	01109 HS	1,143,953.12	1.89
46	China Resources Land Limited	1109 HK	250,039.38	0.41
47	Greentown China Holdings Limited	03900 HS	1,146,674.70	1.89
47	Greentown China Holdings Limited	3900 HK	241,853.86	0.40
48	Kunlun Energy Company Limited	00135 HS	1,040,814.53	1.72
48	Kunlun Energy Company Limited	135 HK	245,047.34	0.40
49	China Railway Group Limited	00390 HS	972,413.00	1.60
49	China Railway Group Limited	390 HK	245,787.19	0.41

注：1. 买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	01919 HS	1,128,647.56	1.86
1	COSCO Shipping Holdings Co., Ltd.	1919 HK	184,971.25	0.30
2	China Construction Bank Corporation	00939 HS	298,097.69	0.49
3	China National Building Material Company Limited	03323 HS	284,975.01	0.47
4	China Unicom (Hong Kong) Limited	00762 HS	229,064.75	0.38
4	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	51,397.30	0.08
5	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED	01288 HS	269,927.36	0.44

6	China Mobile Limited	00941 HS	194,402.20	0.32
6	China Mobile Limited	941 HK	74,504.88	0.12
7	Sinotrans Limited	00598 HS	265,939.99	0.44
8	China Shenhua Energy Company Limited	01088 HS	260,881.25	0.43
9	CNOOC Limited	00883 HS	243,704.69	0.40
10	Picc Property And Casualty Company Limited	02328 HS	240,724.15	0.40
11	China Citic Bank Corporation Limited	00998 HS	234,740.26	0.39
12	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	02388 HS	223,769.74	0.37
13	Industrial and Commercial Bank of China Limited	01398 HS	216,143.11	0.36
14	PetroChina Company Limited	00857 HS	213,960.26	0.35
15	CITIC Limited	00267 HS	204,299.08	0.34
16	Bank of China Limited	03988 HS	202,855.25	0.33
17	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	01339 HS	199,129.00	0.33
18	Bank of Communications Co., Ltd.	03328 HS	194,418.99	0.32
19	China Merchants Bank Co., Ltd.	03968 HS	168,014.33	0.28
19	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	20,654.82	0.03
20	Orient Overseas (International) Limited	00316 HS	167,486.21	0.28

注：1. 卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	107,058,772.30
卖出收入（成交）总额	8,900,891.87

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	269,847.73
2	应收清算款	—
3	应收股利	2,530,537.66
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,146,152.27
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,946,537.66

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	3,597	10,363.60	10,000,000.96	26.83%	27,277,859.84	73.17%
中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）C	18,743	5,896.60	1,347,766.09	1.22%	109,172,297.29	98.78%
合计	22,340	6,615.84	11,347,767.05	7.68%	136,450,157.13	92.32%

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	中欧中证港股通央企红利指数发起（QDII）A	183,703.66	0.49%
	中欧中证港股通央企红利指数	2,923,694.10	2.65%

人员持有本基金	发起(QDII)C		
	合计	3,107,397.76	2.10%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A	0
	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A	0
	中欧中证港股通央企红利指数发起(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	6.77%	10,000,000.00	6.77%	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	6.77%	10,000,000.00	6.77%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)A	中欧中证港股通央企红利指数发起(QDII)C
基金合同生效日（2024 年 7 月 1 日）基金份额总额	16,591,528.35	23,964,698.96
本报告期期初基金份额总额	21,569,350.04	35,015,816.89

本报告期基金总申购份额	29,858,135.20	210,819,937.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,149,624.44	135,315,690.51
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	37,277,860.80	110,520,063.38

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-06-10

采取稽查或处罚等措施的机构	上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管局现场检查结束后，公司即成立整改小组，制定整改措施包括制度修订、人员培训宣导和强化内部检查等。针对涉及的问题，公司已按要求及时完成整改，并将整改报告报至上海监管局。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
申万宏源证券	1	95,866,924.99	82.67	23,967.51	78.86	—
Haitong International Securities Co Ltd	2	10,619,866.01	9.16	3,186.04	10.48	—
CLSA Limited	2	3,714,987.45	3.20	1,114.49	3.67	—
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	2	3,300,278.57	2.85	1,320.12	4.34	—
China International Capital Corp HK Sec Ltd	2	2,229,354.56	1.92	668.86	2.20	—
UBS SECURITIES ASIA	2	228,252.59	0.20	136.95	0.45	—

LTD.						
东方证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corp HK Sec Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES ASIA LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取

方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18
2	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2025-02-26
6	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）更新招募说明书（2025 年 2 月）	中国证监会指定媒介	2025-02-26
7	中欧基金管理有限公司关于调整中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）收益分配原则并相应修订基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-26
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
9	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
10	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-15
12	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-15
13	中欧基金管理有限公司关于暂停部	中国证监会指定媒介	2025-06-03

	分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告		
14	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2025-06-03
15	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09
16	中欧中证港股通央企红利指数发起式证券投资基金（QDII）更新招募说明书（2025 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2025-06-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日