

中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：上海农村商业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海农村商业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	10
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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	39

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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	41
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	43
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金	
基金简称	中欧中证全指证券公司指数发起	
基金主代码	025779	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 31 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	上海农村商业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	42,974,461.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧中证全指证券公司指数发起 A	中欧中证全指证券公司指数发起 C
下属分级基金的交易代码	025779	025780
报告期末下属分级基金的份额总额	16,448,383.23 份	26,526,078.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，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%；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偏离度和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偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×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，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	上海农村商业银行股份有限公司

			司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	方樑
	联系电话	021-68609600	021-61899999
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgyy@shrcb.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	021-962999
传真		021-50190017	021-61899453
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市黄浦区中山东二路 70 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	上海市黄浦区中山东二路 70 号 A 座 6 楼
邮政编码		200120	200002
法定代表人		窦玉明	徐力

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧中证全指证券公司指数发起 A	中欧中证全指证券公司指数发起 C
本期已实现收益	-106,260.87	-66,860.35
本期利润	-501,525.48	464,142.69
加权平均基金份 额本期利润	-0.0398	0.0477
本期加权平均净 值利润率	-4.43%	5.39%
本期基金份额净 值增长率	-6.29%	-6.41%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	-1,385,393.73	-2,271,756.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0842	-0.0856
期末基金资产净值	15,062,989.50	24,254,321.93
期末基金份额净值	0.9158	0.9144
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-8.42%	-8.56%

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

中欧中证全指证券公司指数发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.23%	1.70%	8.27%	1.72%	0.96%	-0.02%
过去六个月	-6.29%	1.50%	-7.42%	1.51%	1.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-8.42%	1.37%	-11.23%	1.39%	2.81%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率*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。

中欧中证全指证券公司指数发起 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去三个月	9.17%	1.70%	8.27%	1.72%	0.90%	-0.02%
过去六个月	-6.41%	1.50%	-7.42%	1.51%	1.01%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	-8.56%	1.37%	-11.23%	1.39%	2.67%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率*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

中欧中证全指证券公司指数发起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 2025 年 10 月 31 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。

中欧中证全指证券公司指数发起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 2025 年 10 月 31 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵子衡	基金经理 / 基金经理助理	2025-10-31	-	4 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

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，其中赵子衡担任本基金的基金经理。

4.2 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2026 年上半年，中证全指证券公司指数下跌 7.87%，其中一季度下跌 15.22%、二季度上涨 8.67%。上半年的核心逻辑始终是：成交量是券商板块的主要影响变量，券商股价是“未来成交量水平”的折现。从行业经营基础看，市场参与者基础较 2025 年大幅扩张，一季度日均股基交易额接近 3.1 万亿元、较 2025 年增长超 50%，新开户量增长 61%，两融余额稳守 2.6 万亿元；二季度市场成交中枢站稳 3 万亿元台阶，板块自身日均成交额从 4 月的 260 亿元逐月抬升至 6 月的 496 亿元，两融日均余额连创历史新高，两融业务对券商单月业绩的贡献度持续刷新纪录，成交中枢从 1 至 1.5 万亿元时代跃升至 2 至 3 万亿元时代的判断持续获得验证。

一季度，证券公司指数于 1 月 6 日触及年内高点后震荡下跌，全季下跌 15.22%。全季度的核心逻辑是：成交量是券商板块的主要影响变量，1 月 14 日前后成交量从 3 万亿元以上台阶回落，是券商指数下行的主要原因；3 月地缘冲击叠加市场跌破 4000 点，是加速下跌的触发器。1 月，市场成交额和两融余额创历史新高，但宽基指数 ETF 大幅流出，1 月 14 日监管层释放降温信号，两融业务收紧，成交金额下降，证券公司主跌浪开启，指数整体收跌 1.62%。1 月 5 日，上证指数突破 4000 点，成交金额与两融余额攀升，券商在上证指数突破关键整数关口时往往放量上涨，预期市场进入正循环。1 月 6 日，沪指录得 13 连阳，刷新 2015 年 7 月以来新高，沪深两市成交额达 2.8 万亿元。1 月中旬，两融余额突破 2.68 万亿元，较 2025 年底增长近 2000 亿元，杠杆资金占市场成交额比例超 15%，达历史高位，引发监管层主动降温。1 月 14 日，全 A 成交金额接近 4 万亿，沪深北交易所将融资保证金最低比例从 80%提高至 100%。1 月 30 日，特朗普提名凯文·沃什出任新一届美联储主席，其“降息与缩表同步”的政策主张引发全球流动性收紧预期。1 月证券公司回落的主要原因是成交量自然触顶——1 月 6 日成交额 2.8 万亿元时，市场对全年日均成交额的乐观预期被推至“3 万亿元以上甚至更高”，对应的券商净利润预期大幅上修；随后 1 月 14 日冲至 39869 亿元的历史峰值，而这个峰值本身就已经是市场能量的极限释放，两融余额 2.68 万亿元、杠杆资金占市场成交额比例超 15%均处历史高位，没有新的增量资金能在此基础上继续推高成交量，此后成交量的回落本质上是杠杆资金到了上限、增量入场速度放缓，峰值向均值回归是必然的。2 月，经济基本面数据全面向好，但地缘政治升级压制了基本面修复对券商板块的提振效果，证券公司指数下跌 2.20%，节前成交量下滑。春节期间（2 月 20 日），媒体报道特朗普考虑对伊朗实施军事打击；2 月 20 日，美国最高法院裁定特朗普依据《国际紧急经济权力法》征收的全球关税违法，随即宣布加征 15%关税。国产大模型与人形机器人登上春晚舞台，提振科技板块情绪，但证券公司指数延续下跌。2 月公布的 1 月核心经济数据：M1 同比从 3.8%升至 4.9%；M2 同比从 8.5%升至 9.0%；社融增量 7.22 万亿元创历史同期新高，企业中长期贷款占比首次超过政府债券，标志着经济驱动从政府加杠杆转向企业加杠杆；PPI 同比降幅连续 5 个月收窄、环比连续 4 个月上涨，通缩压力缓解；制造业 PMI 受春节季节性回落至 49.3%，但生产端维持扩张；工业企业利润延续逐季加速态势，私营企业盈利增速领先，经济内生动力正在形成。3 月，美伊冲突推动油价暴涨强化通胀预期，美联储降息预期大幅压缩，流动性收紧成为券商板块加速下跌的主导力量，地缘冲突急剧升级，成交金额下滑，证券公司指数全月收跌 11.88%。2 月 28 日，美以联军对伊朗发动打击；伊朗随即宣布关闭霍尔木兹海峡；3 月 1 日，媒体报道哈梅内伊在袭击中遇害。油价从 70 美元/桶飙升至 115 美元/桶，通胀预期强化，市场对美联储全年降息预期从 1 至 2 次压缩至 0 至 1 次。3 月 18 日，美联储 FOMC 维持利率不变，基调偏鹰，上调通胀预期，上

证指数跌破 4000 点并于 3 月 23 日下探 3800 点，券商板块加速下跌。

二季度，证券公司指数在成交量中枢抬升与政策催化的共振下上涨 8.67%。4 月，地缘缓和驱动大盘反弹，指数上涨 4.73%；5 月，中美元首会谈，降准降息利好兑现后回落 4.16%；6 月在估值均值回归与政策集中催化下大涨 8.27%。4 月，地缘缓和驱动的风险偏好修复，券商随大盘反弹，指数上涨 4.73%。4 月 7 日美伊临时停火协议达成，4 月 8 日 A 股全线大涨，券商指数单日上涨 3.96%；4 月 10 日再度放量上涨 3.58%，板块单日成交额 565 亿元，创一季度以来新高，此后市场进入震荡消化期。4 月 28 日政治局会议提出“稳定和增强资本市场信心”，明确的政策定调推动板块企稳回升。整体看，4 月券商的上涨主要来自地缘风险溢价回吐后的贝塔修复，板块日均成交额 260 亿元，市场关注度仍集中于 AI 主线，券商尚未获得独立定价。5 月，降准降息利好兑现叠加风格切换，指数下跌 4.16%。5 月 7 日央行降准 0.5 个百分点、下调政策利率 0.1 个百分点，释放长期流动性约 1 万亿元。5 月 12 日，指数创全季阶段高点。随后央行一季度货币政策报告删除“降准降息”表述，短期宽松预期降温；更关键的是市场风格加速向中小盘科技切换，AI 算力与存储主线对资金的虹吸达到极致，券商作为传统大金融板块持续失血。6 月，在陆家嘴论坛“一揽子”政策落地、主动 ETF 开闸打开资管增量、科创板扩容增厚投行收入、市场交投持续活跃的驱动下，证券公司指数大涨 8.27%。陆家嘴论坛释放“一揽子”资本市场改革信号，明确提出“进一步健全投融资相协调的资本市场功能”，政策从资产端、产品端、资金端全链条发力：科创板第五套标准将扩大至人工智能领域；主动管理型 ETF 正式获批；商业不动产 REITs 试点落地；研究设立非银流动性支持工具。指数单日大涨，板块成交额放大至 906 亿元、次日逼近千亿。

在投资策略方面，本基金作为跟踪中证全指证券公司指数的场外指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-6.29%，同期业绩比较基准收益率为-7.42%；基金 C 类份额净值增长率为-6.41%，同期业绩比较基准收益率为-7.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内经济延续温和复苏态势，PPI 同比持续加速上行，工业企业盈利修复趋势渐明。行业层面，券商并购整合持续深化，头部机构强者恒强，在监管支持合理扩杠杆、AI 技术赋能与资本使用效率提升的共同作用下，证券行业 ROE 中枢有望突破 10%。

IPO 端，硬科技 IPO 募资需求增长，科创板第五套标准扩大至人工智能领域，行业股权融资业务具备中长期支撑，新质生产力企业的上市亦将持续为市场注入优质资产。

国内货币政策与流动性方面，2026 年政府工作报告明确要求继续实施适度宽松的货币政策，灵活高效运用降准降息等政策工具。降准降息从“适时”调整为“灵活高效”的表述变化，一方面，“灵活”意味着决策层将根据经济金融形势相机抉择，把握好政策的力度与节奏；另一方面，“高效”则表明不搞“大水漫灌”，确保释放的流动性精准注入实体经济。

海外方面，随着 6 月议息会议彻底删除政策前瞻指引，市场已开始计价年底前的加息可能，美联储或将在年末进入加息周期。这意味着支撑上半年行情的外部流动性宽松逻辑面临阶段性退坡，市场的驱动力将从单纯的流动性宽松转向周期盈利驱动，估值扩张空间收窄而业绩兑现的重要性上升。需关注的是，若加息节奏快于预期，或地缘局势再度扰动油价与通胀路径，实际利率的重新抬升仍可能对全球风险资产形成阶段性压制。

资金层面，2025 年全年国内 10 年期国债利率保持在 2% 以下，推动居民财富从债市向股市迁移；与此同时，人民币汇率升值预期增强外资流入动能。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金的管理人——中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金本报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	908,562.94	549,027.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	38,948,562.54	13,595,585.29
其中：股票投资		37,633,216.00	13,393,566.00
基金投资		-	-
债券投资		1,315,346.54	202,019.29
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		-	-
应收申购款		1,084,967.20	283,639.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		40,942,092.68	14,428,251.56
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,150,102.62	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		443,982.34	350,962.11
应付管理人报酬		12,095.73	5,846.18
应付托管费		2,419.17	1,169.23
应付销售服务费		3,353.88	776.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.61	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	12,817.90	10,000.00
负债合计		1,624,781.25	368,753.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	42,974,461.37	14,386,863.01
未分配利润	6.4.7.8	-3,657,149.94	-327,365.00
净资产合计		39,317,311.43	14,059,498.01
负债和净资产总计		40,942,092.68	14,428,251.56

注： 1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 42,974,461.37 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9158 元，基金份额总额 16,448,383.23 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9144 元，基金份额总额 26,526,078.14 份。

2. 本基金基金合同于 2025 年 10 月 31 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：中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		38,959.68
1. 利息收入		256.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	256.41
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）		-106,312.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-327,730.06
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	3,442.86
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	-
股利收益	6.4.7.14	217,974.80
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15	135,738.43
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	9,277.24
减：二、营业总支出		76,342.47
1. 管理人报酬		48,992.16
2. 托管费		9,798.48
3. 销售服务费		10,538.07
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		2,053.33
其中：卖出回购金融资产支出		2,053.33
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		1.03
8. 其他费用	6.4.7.18	4,959.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		-37,382.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,382.79

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-37,382.79

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,386,863.01	-	-327,365.00	14,059,498.01
二、本期期初净资产	14,386,863.01	-	-327,365.00	14,059,498.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	28,587,598.36	-	-3,329,784.94	25,257,813.42
（一）、综合收益总额	-	-	-37,382.79	-37,382.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	28,587,598.36	-	-3,292,402.15	25,295,196.21
其中：1. 基金申购款	54,880,174.44	-	-6,147,243.97	48,732,930.47
2. 基金赎回款	-26,292,576.08	-	2,854,841.82	-23,437,734.26
（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	42,974,461.37	-	-3,657,149.94	39,317,311.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平	王音然	李宝林
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金(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[2025]2167号《关于准予中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金注册的批复》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《中欧中证全指证券公司指数发起式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发起式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币11,188,350.86元,经向中国证监会备案,《中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金基金合同》于2025年10月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,188,439.20份基金份额,其中包含认购资金利息折合88.34份基金份额。本基金最新情况见2.基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[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[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]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2. 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

6. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用

比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	90,055.81
等于：本金	90,050.17
加：应计利息	5.64
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	818,507.13
等于：本金	818,495.65
加：应计利息	11.48
减：坏账准备	-
合计	908,562.94

注：本基金持有的其他存款均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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		37,679,054.49	-	37,633,216.00	-45,838.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,300,869.00	14,836.54	1,315,346.54	-359.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,300,869.00	14,836.54	1,315,346.54	-359.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		38,979,923.49	14,836.54	38,948,562.54	-46,197.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	4,959.40
其他应付	7,858.50
合计	12,817.90

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证全指证券公司指数发起 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,460,000.30	10,460,000.30
本期申购	7,680,936.73	7,680,936.73
本期赎回（以“-”号填列）	-1,692,553.80	-1,692,553.80
本期末	16,448,383.23	16,448,383.23

中欧中证全指证券公司指数发起 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,926,862.71	3,926,862.71

本期申购	47,199,237.71	47,199,237.71
本期赎回（以“-”号填列）	-24,600,022.28	-24,600,022.28
本期末	26,526,078.14	26,526,078.14

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

中欧中证全指证券公司指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,782.85	-210,244.17	-237,027.02
本期期初	-26,782.85	-210,244.17	-237,027.02
本期利润	-106,260.87	-395,264.61	-501,525.48
本期基金份额交易产生的变动数	-42,200.24	-604,640.99	-646,841.23
其中：基金申购款	-57,511.73	-770,191.48	-827,703.21
基金赎回款	15,311.49	165,550.49	180,861.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-175,243.96	-1,210,149.77	-1,385,393.73

中欧中证全指证券公司指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,405.48	-78,932.50	-90,337.98
本期期初	-11,405.48	-78,932.50	-90,337.98
本期利润	-66,860.35	531,003.04	464,142.69
本期基金份额交易产生的变动数	-241,779.03	-2,403,781.89	-2,645,560.92
其中：基金申购款	-426,222.97	-4,893,317.79	-5,319,540.76
基金赎回款	184,443.94	2,489,535.90	2,673,979.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-320,044.86	-1,951,711.35	-2,271,756.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	89.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	166.74
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	256.41

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,393,375.00
减：卖出股票成本总额	4,710,684.73
减：交易费用	10,420.33
买卖股票差价收入	-327,730.06

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,426.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,442.86

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	405,480.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	399,984.00
减：应计利息总额	5,480.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	16.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

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

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	217,974.80
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	217,974.80

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	135,738.43
股票投资	136,185.43
债券投资	-447.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	135,738.43

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,410.85
基金转换费收入	866.39
合计	9,277.24

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	—
证券出借违约金	—
合计	4,959.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
上海农村商业银行股份有限公司	基金托管人
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 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	48,992.16

其中：应支付销售机构的客户维护费	19,832.85
应支付基金管理人的净管理费	29,159.31

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照管理人出具的自动划付授权书中约定的方式自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,798.48

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照管理人出具的自动划付授权书中约定的方式自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证全指证券公司指数发起 A	中欧中证全指证券公司指数发起 C	合计
中欧财富	-	165.91	165.91

合计	-	165.91	165.91
----	---	--------	--------

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 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照管理人出具的自动划付授权书中约定的方式自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，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

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

中欧中证全指证券公司指数发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2025 年 10 月 31 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	60.80%

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

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各类基金份额。

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海农村商业银行股份有限公司	90,055.81	89.67

注：本基金的银行存款由基金托管人上海农村商业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 1,150,102.62 元，于 2026 年 7 月 2 日、6 日和 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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和反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	908,562.94	-	-	-	908,562.94
交易性金融资产	1,315,346.54	-	-	37,633,216.00	38,948,562.54
应收申购款	-	-	-	1,084,967.20	1,084,967.20
资产总计	2,223,909.48	-	-	38,718,183.20	40,942,092.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	443,982.34	443,982.34
应付管理人报酬	-	-	-	12,095.73	12,095.73
应付托管费	-	-	-	2,419.17	2,419.17
卖出回购金融资产款	1,150,102.62	-	-	-	1,150,102.62
应付销售服务费	-	-	-	3,353.88	3,353.88
应交税费	-	-	-	9.61	9.61
其他负债	-	-	-	12,817.90	12,817.90
负债总计	1,150,102.62	-	-	474,678.63	1,624,781.25
利率敏感度缺口	1,073,806.86	-	-	38,243,504.57	39,317,311.43
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	549,027.14	-	-	-	549,027.14
交易性金融资产	202,019.29	-	-	13,393,566.00	13,595,585.29
应收申购款	-	-	-	283,639.13	283,639.13
资产总计	751,046.43	-	-	13,677,205.13	14,428,251.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	350,962.11	350,962.11
应付管理人报酬	-	-	-	5,846.18	5,846.18
应付托管费	-	-	-	1,169.23	1,169.23
应付销售服务费	-	-	-	776.03	776.03
其他负债	-	-	-	10,000.00	10,000.00
负债总计	-	-	-	368,753.55	368,753.55
利率敏感度缺口	751,046.43	-	-	13,308,451.58	14,059,498.01

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 3.35%（2025 年 12 月 31 日：1.44%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	37,633,216.00	95.72	13,393,566.00	95.26
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	37,633,216.00	95.72	13,393,566.00	95.26

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,941,446.98	681,041.17
	业绩比较基准下降 5%	-1,941,446.98	-681,041.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	37,633,216.00	13,393,566.00
第二层次	1,315,346.54	202,019.29
第三层次	-	-
合计	38,948,562.54	13,595,585.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,633,216.00	91.92
	其中：股票	37,633,216.00	91.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,315,346.54	3.21
	其中：债券	1,315,346.54	3.21
	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	908,562.94	2.22
8	其他各项资产	1,084,967.20	2.65
9	合计	40,942,092.68	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末指数投资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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	37,633,216.00	95.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,633,216.00	95.72

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	600030	中信证券	193,200	5,550,636.00	14.12
2	300059	东方财富	250,600	5,107,228.00	12.99
3	601211	国泰海通	223,700	4,071,340.00	10.36
4	601688	华泰证券	115,800	2,387,796.00	6.07
5	600999	招商证券	73,500	1,550,850.00	3.94
6	000776	广发证券	58,500	1,368,900.00	3.48
7	600958	东方证券	103,500	977,040.00	2.49
8	601995	中金公司	23,200	838,680.00	2.13
9	601377	兴业证券	136,800	826,272.00	2.10
10	000166	申万宏源	178,400	784,960.00	2.00
11	601066	中信建投	25,800	750,006.00	1.91
12	600909	华安证券	59,700	663,267.00	1.69
13	000783	长江证券	65,700	640,575.00	1.63

14	601555	东吴证券	78,700	623,304.00	1.59
15	002736	国信证券	60,800	607,392.00	1.54
16	601901	方正证券	81,500	586,800.00	1.49
17	601788	光大证券	38,700	558,441.00	1.42
18	601108	财通证券	64,400	557,060.00	1.42
19	601456	国联民生	62,200	549,848.00	1.40
20	002797	第一创业	83,200	546,624.00	1.39
21	601881	中国银河	43,000	540,510.00	1.37
22	601198	东兴证券	38,400	521,856.00	1.33
23	601162	天风证券	139,600	470,452.00	1.20
24	601099	太平洋	134,900	454,613.00	1.16
25	600109	国金证券	51,400	451,292.00	1.15
26	601696	中银证券	33,000	417,450.00	1.06
27	000728	国元证券	51,900	388,731.00	0.99
28	002673	西部证券	53,100	344,619.00	0.88
29	600918	中泰证券	62,700	333,564.00	0.85
30	600061	国投资本	50,700	332,085.00	0.84
31	000750	国海证券	88,500	325,680.00	0.83
32	600369	西南证券	79,000	317,580.00	0.81
33	601059	信达证券	19,300	312,467.00	0.79
34	601990	南京证券	43,600	286,452.00	0.73
35	002939	长城证券	32,000	266,880.00	0.68
36	002926	华西证券	31,200	254,904.00	0.65
37	600155	华创云信	43,900	242,328.00	0.62
38	000686	东北证券	27,900	234,360.00	0.60
39	002500	山西证券	42,700	220,332.00	0.56
40	601375	中原证券	54,600	217,854.00	0.55
41	600906	财达证券	25,700	191,722.00	0.49
42	601236	红塔证券	28,100	191,642.00	0.49
43	600095	湘财股份	22,700	170,931.00	0.43
44	601136	首创证券	10,900	152,055.00	0.39
45	600621	华鑫股份	10,600	136,952.00	0.35
46	002670	国盛证券	11,500	126,500.00	0.32
47	000712	锦龙股份	12,400	109,864.00	0.28
48	002945	华林证券	5,400	72,522.00	0.18

7.3.2 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	4,079,176.00	29.01

2	300059	东方财富	3,954,027.00	28.12
3	601211	国泰海通	2,959,853.00	21.05
4	601688	华泰证券	1,848,240.00	13.15
5	600999	招商证券	1,023,874.00	7.28
6	000776	广发证券	959,502.00	6.82
7	600958	东方证券	753,706.00	5.36
8	601377	兴业证券	669,564.00	4.76
9	000166	申万宏源	649,549.00	4.62
10	601995	中金公司	637,520.00	4.53
11	601066	中信建投	523,537.00	3.72
12	002736	国信证券	520,707.00	3.70
13	601456	国联民生	510,001.00	3.63
14	601555	东吴证券	501,830.00	3.57
15	601788	光大证券	468,635.00	3.33
16	002797	第一创业	456,507.00	3.25
17	601901	方正证券	455,085.00	3.24
18	601881	中国银河	441,390.00	3.14
19	000783	长江证券	416,045.00	2.96
20	601108	财通证券	415,295.00	2.95
21	601198	东兴证券	403,127.00	2.87
22	601162	天风证券	390,434.00	2.78
23	601099	太平洋	381,160.00	2.71
24	600909	华安证券	371,749.00	2.64
25	600109	国金证券	350,379.00	2.49
26	601696	中银证券	323,817.00	2.30
27	000728	国元证券	306,543.00	2.18
28	002673	西部证券	291,641.00	2.07
29	600918	中泰证券	285,481.00	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	631,782.00	4.49
2	300059	东方财富	609,831.00	4.34
3	601211	国泰海通	357,514.00	2.54
4	601688	华泰证券	304,879.00	2.17
5	000776	广发证券	155,783.00	1.11
6	600999	招商证券	154,562.00	1.10
7	601377	兴业证券	110,397.00	0.79
8	601995	中金公司	109,563.00	0.78
9	000166	申万宏源	102,604.00	0.73
10	600958	东方证券	101,174.00	0.72
11	002736	国信证券	84,301.00	0.60

12	601066	中信建投	84,216.00	0.60
13	601788	光大证券	82,748.00	0.59
14	601555	东吴证券	78,812.00	0.56
15	002797	第一创业	75,892.00	0.54
16	601901	方正证券	72,264.00	0.51
17	601881	中国银河	71,223.00	0.51
18	601108	财通证券	66,210.00	0.47
19	601198	东兴证券	63,779.00	0.45
20	601099	太平洋	62,095.00	0.44

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	28,814,149.30
卖出股票收入（成交）总额	4,393,375.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,315,346.54	3.35
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,315,346.54	3.35

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	8,000	810,100.38	2.06
2	019792	25 国债 19	5,000	505,246.16	1.29

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

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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中，广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,084,967.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,084,967.20

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

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

7.12.6 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
中欧中证全指证券公司指数发起 A	420	39,162.82	10,000,000.00	60.80%	6,448,383.23	39.20%
中欧中证全指证券公司指数发起 C	4,099	6,471.35	0.00	0.00%	26,526,078.14	100.00%
合计	4,519	9,509.73	10,000,000.00	23.27%	32,974,461.37	76.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧中证全指证券公司指数发起 A	1,946.05	0.01%
	中欧中证全指证券公司指数发起 C	0.00	0.00%
	合计	1,946.05	0.00%

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	中欧中证全指证券公司指数发起 A	0
	中欧中证全指证券公司指数发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证全指证券公司指数发起 A	0
	中欧中证全指证券公司指数发起 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	23.27%	10,000,000.00	23.27%	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	23.27%	10,000,000.00	23.27%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证全指证券公司指数发起 A	中欧中证全指证券公司指数发起 C
基金合同生效日（2025 年 10 月 31 日）基金份额总额	10,308,619.42	879,819.78
本报告期期初基金份额总额	10,460,000.30	3,926,862.71
本报告期基金总申购份额	7,680,936.73	47,199,237.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,692,553.80	24,600,022.28
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份 额总额	16, 448, 383. 23	26, 526, 078. 14

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

本报告期末发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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 (%)	
浙商证券	3	32,650,968.30	98.32	5,989.98	98.30	-
东方财富	3	556,556.00	1.68	103.41	1.70	-

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	1,515,802.81	100.00	8,220,000.00	100.00	-	-

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22

3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
4	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧中证全指证券公司指数发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	23.27 %
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照

3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日