

中欧国证通用航空产业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：成都银行股份有限公司

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。

基金托管人成都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	13
§ 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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40

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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	44
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	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧国证通用航空产业指数发起式证券投资基金	
基金简称	中欧国证通用航空产业指数发起	
基金主代码	024348	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 25 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	成都银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	39,187,077.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧国证通用航空产业指数发起 A	中欧国证通用航空产业指数发起 C
下属分级基金的交易代码	024348	024349
报告期末下属分级基金的份额总额	23,959,018.64 份	15,228,059.35 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	国证通用航空产业指数收益率×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	成都银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	黎忆海	涂希懋
	联系电话	021-68609600	028-86160413
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tuxm@bocd.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95507
传真		021-50190017	028-86160167
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	四川省成都市青羊区西御街 16 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	四川省成都市青羊区西御街 16 号
邮政编码		200120	610015
法定代表人		窦玉明	黄建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
据和指标	中欧国证通用航空产业指数发起 A	中欧国证通用航空产业指数发起 C
本期已实现收益	-146,240.57	-59,656.60
本期利润	-5,843,007.27	-5,368,912.24
加权平均基金份额本期利润	-0.2447	-0.2714
本期加权平均净值利润率	-21.24%	-23.47%
本期基金份额净值增长率	-17.06%	-17.17%
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	-355,436.32	-263,696.87
期末可供分配基金份额利润	-0.0148	-0.0173
期末基金资产净值	23,603,582.32	14,964,362.48
期末基金份额净值	0.9852	0.9827
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	-1.48%	-1.73%

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

中欧国证通用航空产业指数发起 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	-10.49%	1.83%	-10.46%	1.82%	-0.03%	0.01%
过去六个月	-17.06%	2.07%	-15.95%	2.13%	-1.11%	-0.06%
过去一年	-4.11%	1.76%	-2.53%	1.81%	-1.58%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.48%	1.76%	3.59%	1.81%	-5.07%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：国证通用航空产业指数收益率*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。

中欧国证通用航空产业指数发起 C

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

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-10.54%	1.83%	-10.46%	1.82%	-0.08%	0.01%
过去六个月	-17.17%	2.07%	-15.95%	2.13%	-1.22%	-0.06%
过去一年	-4.34%	1.76%	-2.53%	1.81%	-1.81%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.73%	1.76%	3.59%	1.81%	-5.32%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：国证通用航空产业指数收益率*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

中欧国证通用航空产业指数发起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 6 月 25 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。

中欧国证通用航空产业指数发起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 6 月 25 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	2025-06-25	-	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

上半年，通用航空指数下跌 16.84%。贯穿整个上半年的核心矛盾，是宏观流动性预期切换（美元指数与实际利率变化）与产业事件（卫星星座组网、可回收技术验证、商业航天企业资本化）之间的反复博弈：前者决定板块估值水位，后者决定商业航天商业化落地的确定性预期。

一季度，受监管层释放市场降温信号、火箭发射失利及中东地缘冲突影响，通用航空指数下跌 6.53%。

1 月（+4.65%）：产业催化引爆情绪，杠杆过热触发监管组合拳，板块由冲高转入回落。宏观层面，2025 年 12 月美联储降息并重启扩表后，5 年期 TIPS 收益率持续下行，美元走弱、人民币

升值，全球流动性宽松窗口打开；截至 1 月 12 日，上证指数走出 17 根连阳并突破 4000 点，为板块行情提供了良好的市场环境。产业端利好密集催化，行情加速上行：1 月 2 日 Starlink 宣布下调 4400 颗卫星轨道高度；1 月 8 日国内商业航天企业与卫星运营商签署发射服务合同；1 月 9 日中国无线电创新院新增近 20 万颗卫星星座申请，成为本轮行情的主要催化剂。板块年内高点出现在 1 月 12 日。随着市场过热迹象加剧，监管层打出组合拳：1 月 12 日交易所对多家商业航天概念股实施重点监控；1 月 13 日板块开盘快速下杀；1 月 14 日融资保证金比例由 80%上调至 100%，A 股整体情绪快速转向。1 月 30 日，特朗普提名鹰派人物凯文·沃什出任美联储主席，其“降息与缩表同步”的政策主张扭转全球流动性宽松预期，美元指数跳涨，板块结束反弹、再度进入调整。

2 月 (+2.70%)：可回收技术取得关键验证，基本面数据全面向好，产业与基本面形成共振。产业端，2 月 11 日国内可回收火箭完成低空演示验证飞行，成功验证一级上升与回收段飞行及回收性能，是国内商业航天走向可复用的重要节点。国内基本面，1 月核心数据全面向好：M1 同比由 3.8%升至 4.9%，M2 同比由 8.5%升至 9.0%；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；工业企业利润延续逐季加速，私营企业盈利增速领先。上述数据共同验证经济内生动力正在形成，构成 2 月指数震荡上行的基本面支撑。海外方面，春节期间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，随后宣布加征 15%关税，外部不确定性上升。

3 月 (-13.03%)：地缘冲突推升油价强化通胀预期，实际利率上行主导杀跌。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，通胀预期显著强化，市场对美联储全年降息预期由 1-2 次压缩至 0-1 次。3 月 18 日美联储 FOMC 维持利率不变、基调偏鹰，上证指数跌破 4000 点并于 3 月 23 日下探 3800 点，随后开启反弹。本月的核心传导链条是：地缘冲突→油价上行→通胀预期强化→美联储政策预期转鹰→实际利率上行，实际利率上行是本月杀跌的主要变量，而非产业逻辑恶化。

二季度，通用航空指数下跌 11.03%，核心矛盾仍是宏观流动性预期与产业事件之间的博弈，月度呈现“先扬后抑”的节奏。

4 月 (+4.32%)：地缘缓和驱动贝塔修复，政策定调强化风险偏好。4 月 8 日，美伊达成临时停火协议，地缘风险溢价快速回吐，油价单日暴跌 13%， “再通胀”担忧缓解，通用航空指数单日上涨 4.90%；4 月 17 日伊朗宣布停火期间重新开放霍尔木兹海峡，国际油价进一步大幅下挫。产业端，行业迎来航天主题产业活动，商业可回收运载火箭进入试验筹备周期。4 月 28 日中共中央政治局会议强调深入整治“内卷式”竞争、全面实施“人工智能+”行动、部署新基建“六网”建设，并提

出“稳定和增强资本市场信心”，大盘蓝筹受益于政策定调明确，风险偏好显著修复；板块在月内冲高后有所回落。

5 月（-12.56%）：宽松利好兑现，AI 主线资金虹吸，板块持续失血。月初行情延续强势，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，向市场释放长期流动性约 1 万亿元；同期中美元首会谈改善市场情绪。此后，央行一季度货币政策报告删除“降准降息”表述，宽松预期降温，前期宽松利好呈现“兑现即卖出”特征；与此同时，市场风格加速向 AI 算力与存储主线极致切换，在资金虹吸效应下，商业航天作为前期涨幅可观的主题板块持续失血，构成全季跌幅的主要来源。

6 月（-2.47%）：宏观压制与产业密集兑现相互对冲，跌幅显著收窄。宏观端，上旬超预期非农数据引发加息预期升温；6 月中旬沃什首次主持 FOMC 议息会议，删除前瞻指引，政策立场进一步转鹰，对以远期现金流定价的板块估值形成压制。国内价格端，6 月 PPI 环比转为-0.3%，为上半年首次转负，需求侧动能边际走弱。产业端进入密集兑现期，形成有效对冲：国内多款运载火箭完成组网卫星发射试验；海外航天企业完成资本化进程，为全球航天产业商业化发展提供参考；上述催化推动月末板块迎来阶段性修复行情。

在投资策略方面，本基金作为跟踪国证通用航空产业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-17.06%，同期业绩比较基准收益率为-15.95%；基金 C 类份额净值增长率为-17.17%，同期业绩比较基准收益率为-15.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年既是“十五五”规划的开局之年，也是商业航天从“产业政策”向“技术突破”切换的关键年份。在国防端，装备升级换代需求有望进入新一轮采购周期，叠加印巴、以伊等地区冲突催化，军贸订单有望加速突破，形成内需与外贸的共振；在产业端，商业航天则迎来“资本—技术—星座”三重驱动的闭环落地。

一是资本元年。海内外航天企业资本化进程持续推进，国内多家商业运载火箭企业有序开展股权融资筹备工作。海外航天企业完成资本化进程，为国内标的提供了估值锚与流量效应；本土商业航天赛道 IPO 推进节奏持续加快，产业化落地进度靠前的赛道经营主体年内存在登陆资本市场的潜在机会，一级融资与二级定价的联动有望推动行业并购整合与产能投放。

二是回收突破。多款民营可回收运载火箭计划于三季度开展回收试飞，国有系列可回收火箭

试飞窗口同样临近，三季度将是国内可回收技术的密集验证期，技术迭代领先的企业将确立行业领先地位，并直接打开发射成本下降的空间。参考海外经验，一子级回收复用可使每公斤发射成本较传统一次性火箭下降约 40%-50%；一旦国内首次入轨级回收成功，板块定价逻辑有望由“主题预期”切换至“成本曲线”。

三是星座决战。各类低轨卫星星座组网节奏持续加快、二代实验星密集升空，倒逼运载火箭产能扩张的逻辑持续强化。各类低轨星座整体规划卫星部署规模庞大，综合测算对应的发射需求空间充足；结合单箭搭载载荷规模测算，中长期将产生上千次发射服务需求，持续带动火箭结构件、发动机、卫星平台、相控阵及 T/R 组件产业链形成长期稳定需求。手机直连卫星技术已于 6 月完成现有商用终端无改造通话测试，也为下游终端设备与卫星应用赛道开辟全新需求空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的相关规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同的规定，对管理人在本基金的投资运作、资产净值计算、费用开支、利润分配等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本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

本托管人认真复核了中欧基金管理有限公司编制的《中欧国证通用航空产业指数发起式证券投资基金 2026 年中期报告》中的财务指标和基金净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容，确认其真实、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：中欧国证通用航空产业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	1,456,209.83	1,312,863.84
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	39,444,123.68	28,823,948.63
其中：股票投资		36,912,559.98	28,318,371.10
基金投资		—	—
债券投资		2,531,563.70	505,577.53
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		231,986.73	1,710,912.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		41,132,320.24	31,847,724.98
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		1,999,998.40	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		510,041.39	1,014,863.62
应付管理人报酬		17,417.11	10,623.34
应付托管费		3,483.44	2,124.69
应付销售服务费		3,680.51	1,829.35
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	29,754.59	10,014.82
负债合计		2,564,375.44	1,039,455.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	39,187,077.99	25,947,087.64
未分配利润	6.4.7.8	-619,133.19	4,861,181.52
净资产合计		38,567,944.80	30,808,269.16
负债和净资产总计		41,132,320.24	31,847,724.98

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 39,187,077.99 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9852 元，基金份额总额 23,959,018.64 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9827 元，基金份额总额 15,228,059.35 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧国证通用航空产业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	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-10,988,889.37	288,144.15
1. 利息收入		440.71	18.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	440.71	18.78
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）		-130,575.18	1,019.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-266,802.95	-2,483.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,850.01	-
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	123,377.76	3,503.10
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	-11,006,022.34	287,105.70
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	147,267.44	-
减：二、营业总支出		223,030.14	1,577.99
1. 管理人报酬		124,293.91	713.59
2. 托管费		24,858.79	142.71
3. 销售服务费		28,169.74	5.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,953.11	-
其中：卖出回购金融资产 支出		6,953.11	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	38,754.59	715.78

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,211,919.51	286,566.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,211,919.51	286,566.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,211,919.51	286,566.16

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧国证通用航空产业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	25,947,087.64	-	4,861,181.52	30,808,269.16
二、本期期初净资产	25,947,087.64	-	4,861,181.52	30,808,269.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,239,990.35	-	-5,480,314.71	7,759,675.64
（一）、综合收益总额	-	-	-11,211,919.51	-11,211,919.51
（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）	13,239,990.35	-	5,731,604.80	18,971,595.15
其中：1. 基金申购款	90,871,879.10	-	20,216,594.66	111,088,473.76
2. 基金赎回款	-77,631,888.75	-	-14,484,989.86	-92,116,878.61
（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	39,187,077.99	-	-619,133.19	38,567,944.80
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,475,624.72	-	-	10,475,624.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	286,566.16	286,566.16
(一)、综合收益总额	-	-	286,566.16	286,566.16
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	10,475,624.72	-	286,566.16	10,762,190.88

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

中欧国证通用航空产业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]1003 号《关于准予中欧国证通用航空产业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《中欧国证通用航空产业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 10,475,507.12 元，经向中国证监会备案，《中欧国证通用航空产业指数发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,475,624.72 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 117.60 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	25,915.90

等于：本金	25,913.95
加：应计利息	1.95
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	1,430,293.93
等于：本金	1,430,269.35
加：应计利息	24.58
减：坏账准备	-
合计	1,456,209.83

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	44,805,978.93	-	36,912,559.98	-7,893,418.95
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	31,063.70	2,531,563.70	-787.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	31,063.70	2,531,563.70	-787.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,307,265.93	31,063.70	39,444,123.68	-7,894,205.95

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
预提费用-信息披露费	24,795.19
合计	29,754.59

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧国证通用航空产业指数发起 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	16,758,107.15	16,758,107.15
本期申购	30,208,099.04	30,208,099.04
本期赎回（以“-”号填列）	-23,007,187.55	-23,007,187.55
本期末	23,959,018.64	23,959,018.64

中欧国证通用航空产业指数发起 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	9,188,980.49	9,188,980.49
本期申购	60,663,780.06	60,663,780.06
本期赎回（以“-”号填列）	-54,624,701.20	-54,624,701.20
本期末	15,228,059.35	15,228,059.35

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

中欧国证通用航空产业指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	406,906.83	2,741,735.43	3,148,642.26
本期期初	406,906.83	2,741,735.43	3,148,642.26

本期利润	-146,240.57	-5,696,766.70	-5,843,007.27
本期基金份额交易产生的变动数	186,171.75	2,152,756.94	2,338,928.69
其中：基金申购款	960,707.69	5,776,683.68	6,737,391.37
基金赎回款	-774,535.94	-3,623,926.74	-4,398,462.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	446,838.01	-802,274.33	-355,436.32

中欧国证通用航空产业指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	210,380.43	1,502,158.83	1,712,539.26
本期期初	210,380.43	1,502,158.83	1,712,539.26
本期利润	-59,656.60	-5,309,255.64	-5,368,912.24
本期基金份额交易产生的变动数	90,844.78	3,301,831.33	3,392,676.11
其中：基金申购款	1,817,851.54	11,661,351.75	13,479,203.29
基金赎回款	-1,727,006.76	-8,359,520.42	-10,086,527.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,568.61	-505,265.48	-263,696.87

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	16.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	424.20
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	440.71

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	24,628,637.91
减：卖出股票成本总额	24,865,852.12
减：交易费用	29,588.74
买卖股票差价收入	-266,802.95

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	12,542.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	308.00
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	12,850.01

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	809,280.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	799,692.00
减：应计利息总额	9,280.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	308.00

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	123,377.76
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	123,377.76

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	-11,006,022.34
股票投资	-11,004,945.34
债券投资	-1,077.00
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	-11,006,022.34

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	127,054.19
基金转换费收入	20,213.25
合计	147,267.44

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	24,795.19
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	38,754.59

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
成都银行股份有限公司	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	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,293.91	713.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,851.81	14.38
应支付基金管理人的净管理费	69,442.10	699.21

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，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	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,858.79	142.71

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，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		
	中欧国证通用航空产业指数发起 A	中欧国证通用航空产业指数发起 C	合计
中欧财富	0.00	714.97	714.97
合计	0.00	714.97	714.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧国证通用航空产业指数发起 A	中欧国证通用航空产业指数发起 C	合计
中欧财富	0.00	0.00	0.00

合计	0.00	0.00	0.00
----	------	------	------

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，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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧国证通用航空产业指数发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日 (2025 年 6 月 25 日) 持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基 金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入 总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变	0.00	0.00

动份额		
减：报告期内赎回/ 卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基 金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基 金份额 占基金总份额比例	41.74%	97.07%

- 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、本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金 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		上年度可比期间 2025 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
成都银行股份有限公司	25,915.90	16.51	75,122.17	15.05

注：本基金的银行存款由基金托管人成都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 1,999,998.40 元，于 2026 年 7 月 6 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 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	1,456,209.83	-	-	-	1,456,209.83
交易性金融资产	2,531,563.70	-	-	36,912,559.98	39,444,123.68
应收申购款	-	-	-	231,986.73	231,986.73
资产总计	3,987,773.53	-	-	37,144,546.71	41,132,320.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	510,041.39	510,041.39
应付管理人报酬	-	-	-	17,417.11	17,417.11
应付托管费	-	-	-	3,483.44	3,483.44
卖出回购金融资产款	1,999,998.40	-	-	-	1,999,998.40
应付销售服务费	-	-	-	3,680.51	3,680.51
其他负债	-	-	-	29,754.59	29,754.59
负债总计	1,999,998.40	-	-	564,377.04	2,564,375.44
利率敏感度缺口	1,987,775.13	-	-	36,580,169.67	38,567,944.80
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	1,312,863.84	-	-	-	1,312,863.84
交易性金融资产	505,577.53	-	-	28,318,371.10	28,823,948.63
应收申购款	-	-	-	1,710,912.51	1,710,912.51

资产总计	1,818,441.37	-	-	30,029,283.61	31,847,724.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,014,863.62	1,014,863.62
应付管理人报酬	-	-	-	10,623.34	10,623.34
应付托管费	-	-	-	2,124.69	2,124.69
应付销售服务费	-	-	-	1,829.35	1,829.35
其他负债	-	-	-	10,014.82	10,014.82
负债总计	-	-	-	1,039,455.82	1,039,455.82
利率敏感度缺口	1,818,441.37	-	-	28,989,827.79	30,808,269.16

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 6.56%（2025 年 12 月 31 日：1.64%），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	36,912,559.98	95.71	28,318,371.10	91.92
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	36,912,559.98	95.71	28,318,371.10	91.92

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（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%	1,869,954.72	1,512,158.15
	业绩比较基准下降5%	-1,869,954.72	-1,512,158.15

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	36,912,559.98	28,318,371.10
第二层次	2,531,563.70	505,577.53

第三层次	-	-
合计	39,444,123.68	28,823,948.63

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	36,912,559.98	89.74
	其中：股票	36,912,559.98	89.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,531,563.70	6.15
	其中：债券	2,531,563.70	6.15
	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	1,456,209.83	3.54
8	其他各项资产	231,986.73	0.56

9	合计	41,132,320.24	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	31,550,798.75	81.81
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	677,040.00	1.76
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,554,613.97	6.62
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	2,130,107.26	5.52
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	36,912,559.98	95.71

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	002085	万丰奥威	159,100	1,764,419.00	4.57
2	688297	中无人机	33,145	1,377,174.75	3.57
3	002389	航天彩虹	75,700	1,345,189.00	3.49
4	600316	洪都航空	45,100	1,260,094.00	3.27
5	600038	中直股份	45,900	1,160,811.00	3.01
6	688248	南网科技	15,357	1,062,397.26	2.75
7	688582	芯动联科	15,623	1,015,495.00	2.63
8	300045	华力创通	58,400	1,006,816.00	2.61
9	001696	宗申动力	46,800	973,908.00	2.53
10	688002	睿创微纳	6,150	951,343.50	2.47
11	002023	海特高新	66,600	863,136.00	2.24
12	688295	中复神鹰	13,848	838,357.92	2.17
13	688772	珠海冠宇	42,678	837,769.14	2.17
14	300900	广联航空	21,700	836,969.00	2.17
15	600363	联创光电	21,600	772,848.00	2.00
16	600862	中航高科	41,500	748,245.00	1.94
17	000801	四川九洲	57,600	745,344.00	1.93
18	300101	振芯科技	45,700	738,969.00	1.92
19	300627	华测导航	26,000	738,400.00	1.91
20	600372	中航机载	68,000	737,800.00	1.91
21	000738	航发控制	39,600	724,284.00	1.88
22	600118	中国卫星	8,800	722,040.00	1.87
23	600562	国睿科技	34,000	721,480.00	1.87
24	688563	航材股份	14,014	717,937.22	1.86
25	600893	航发动力	18,600	713,124.00	1.85
26	600879	航天电子	33,300	708,957.00	1.84
27	688122	西部超导	11,271	707,931.51	1.84
28	300699	光威复材	24,600	704,790.00	1.83
29	002151	北斗星通	22,100	701,675.00	1.82
30	603308	应流股份	11,600	700,640.00	1.82
31	300342	天银机电	14,900	700,300.00	1.82
32	002967	广电计量	38,200	689,510.00	1.79
33	688568	中科星图	16,578	687,489.66	1.78
34	000099	中信海直	46,500	677,040.00	1.76
35	300397	天和防务	42,800	647,992.00	1.68
36	002465	海格通信	50,100	639,777.00	1.66
37	300681	英搏尔	22,200	635,364.00	1.65
38	002625	光启技术	20,800	630,656.00	1.64
39	688523	航天环宇	11,965	626,966.00	1.63
40	300075	数字政通	60,000	613,200.00	1.59
41	300696	爱乐达	18,900	491,967.00	1.28
42	300177	中海达	69,000	427,800.00	1.11

43	688522	纳睿雷达	20,669	413,793.38	1.07
44	300581	晨曦航空	34,400	386,656.00	1.00
45	301091	深城交	24,400	378,200.00	0.98
46	688552	航天南湖	10,441	293,705.33	0.76
47	600212	绿能慧充	56,300	292,760.00	0.76
48	688631	莱斯信息	6,041	283,383.31	0.73
49	002651	利君股份	36,400	266,084.00	0.69
50	300542	新晨科技	20,900	231,572.00	0.60

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	002085	万丰奥威	2,222,596.00	7.21
2	002389	航天彩虹	1,599,509.00	5.19
3	600118	中国卫星	1,568,788.00	5.09
4	300342	天银机电	1,533,847.00	4.98
5	688297	中无人机	1,488,177.12	4.83
6	300045	华力创通	1,417,908.00	4.60
7	600879	航天电子	1,362,781.35	4.42
8	600038	中直股份	1,360,336.00	4.42
9	600316	洪都航空	1,352,522.00	4.39
10	002151	北斗星通	1,130,664.00	3.67
11	002465	海格通信	1,086,056.00	3.53
12	688568	中科星图	1,072,235.41	3.48
13	600363	联创光电	1,068,184.00	3.47
14	300900	广联航空	1,012,568.00	3.29
15	300101	振芯科技	967,733.00	3.14
16	002625	光启技术	885,857.00	2.88
17	001696	宗申动力	874,501.00	2.84
18	688295	中复神鹰	867,683.45	2.82
19	603308	应流股份	865,576.00	2.81
20	688122	西部超导	861,985.27	2.80
21	000801	四川九洲	855,023.00	2.78
22	300699	光威复材	848,225.00	2.75
23	688582	芯动联科	834,881.68	2.71
24	600862	中航高科	818,397.00	2.66
25	300627	华测导航	802,114.00	2.60
26	600562	国睿科技	788,339.00	2.56
27	000099	中信海直	785,304.00	2.55
28	688002	睿创微纳	773,025.64	2.51

29	000738	航发控制	767,340.00	2.49
30	600372	中航机载	764,974.00	2.48
31	002023	海特高新	759,038.00	2.46
32	600893	航发动力	757,898.00	2.46
33	300075	数字政通	744,060.00	2.42
34	688248	南网科技	720,584.29	2.34
35	002967	广电计量	717,051.00	2.33
36	688772	珠海冠宇	693,690.71	2.25
37	688563	航材股份	677,758.74	2.20
38	688523	航天环宇	665,954.16	2.16

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300342	天银机电	2,070,405.00	6.72
2	600118	中国卫星	1,382,395.00	4.49
3	600879	航天电子	1,202,450.00	3.90
4	603308	应流股份	1,069,030.00	3.47
5	002085	万丰奥威	1,033,590.00	3.35
6	688002	睿创微纳	855,790.79	2.78
7	002389	航天彩虹	697,820.00	2.27
8	300284	苏交科	693,679.00	2.25
9	300900	广联航空	686,175.00	2.23
10	600316	洪都航空	665,685.00	2.16
11	600038	中直股份	654,405.00	2.12
12	002465	海格通信	616,867.00	2.00
13	300045	华力创通	605,609.00	1.97
14	688297	中无人机	593,843.77	1.93
15	002151	北斗星通	579,294.00	1.88
16	600893	航发动力	535,545.00	1.74
17	688568	中科星图	533,223.54	1.73
18	688248	南网科技	532,087.69	1.73
19	300699	光威复材	460,853.00	1.50
20	688122	西部超导	457,029.92	1.48

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	44,464,986.34
卖出股票收入（成交）总额	24,628,637.91

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	2,531,563.70	6.56
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	2,531,563.70	6.56

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	25,000	2,531,563.70	6.56

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，适度参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，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	231,986.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	231,986.73

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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中欧国证 通用航空 产业指数 发起 A	2,792	8,581.31	10,000,000.00	41.74%	13,959,018.64	58.26%
中欧国证 通用航空 产业指数 发起 C	3,917	3,887.68	0.00	0.00%	15,228,059.35	100.00%
合计	6,709	5,840.97	10,000,000.00	25.52%	29,187,077.99	74.48%

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	中欧国证通用航空产业指数发 起 A	11,046.95	0.05%
	中欧国证通用航空产业指数发 起 C	0.00	0.00%
	合计	11,046.95	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和相关部门 负责人持有本开放式 基金	中欧国证通用航空产业指数 发起 A	0
	中欧国证通用航空产业指数 发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧国证通用航空产业指数 发起 A	0
	中欧国证通用航空产业指数 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	25.52%	10,000,000.00	25.52%	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	25.52%	10,000,000.00	25.52%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧国证通用航空产业指数发起 A	中欧国证通用航空产业指数发起 C
基金合同生效日 (2025 年 6 月 25 日) 基金份额总额	10,301,610.82	174,013.90
本报告期期初基金份 额总额	16,758,107.15	9,188,980.49
本报告期基金总申购 份额	30,208,099.04	60,663,780.06
减：本报告期基金总 赎回份额	23,007,187.55	54,624,701.20
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	23,959,018.64	15,228,059.35

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

本报告期未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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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(%)	
中信证券	3	69,084,301.51	100.00	13,969.07	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。

10.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
中信证券	2, 823, 493. 16	100. 00	22, 700, 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	中欧国证通用航空产业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	中欧国证通用航空产业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	中欧国证通用航空产业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	中欧国证通用航空产业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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间区间					
机构	1	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	10,000,00 0.00	0.00	0.00	10,000,000.00	25.52 %
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