

中欧中证机器人指数发起式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 17 日起至 2024 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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金	
基金简称	中欧中证机器人指数发起	
基金主代码	020255	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 17 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	313,124,529.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧中证机器人指数发起 A	中欧中证机器人指数发起 C
下属分级基金的交易代码	020255	020256
报告期末下属分级基金的份额总额	21,587,437.18 份	291,537,092.43 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	<p>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%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证机器人指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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		招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	张姗
	联系电话	021-68609600	400-61-95555
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700		400-61-95555
传真	021-33830351		0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120		518040
法定代表人	窦玉明		缪建民

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。

2.5 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	2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）-2024 年 6 月 30 日	
	中欧中证机器人指数发起 A	中欧中证机器人指数发起 C
本期已实现收益	-250,098.20	-3,089,292.76
本期利润	-1,702,651.59	-31,252,712.18
加权平均基金份额 本期利润	-0.0911	-0.1959
本期加权平均净 值利润率	-8.58%	-18.43%
本期基金份额净 值增长率	-1.47%	-1.57%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-317,296.75	-4,565,614.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0147	-0.0157
期末基金资产净值	21,270,140.43	286,971,478.07
期末基金份额净值	0.9853	0.9843
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.47%	-1.57%

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。

4、本基金合同自 2024 年 01 月 17 日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

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

中欧中证机器人指数发起 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
过去一个月	-6.71%	1.24%	-6.76%	1.24%	0.05%	0.00%
过去三个月	-11.00%	1.47%	-11.41%	1.48%	0.41%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.47%	1.85%	-5.54%	1.94%	4.07%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为：中证机器人指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

中欧中证机器人指数发起 C

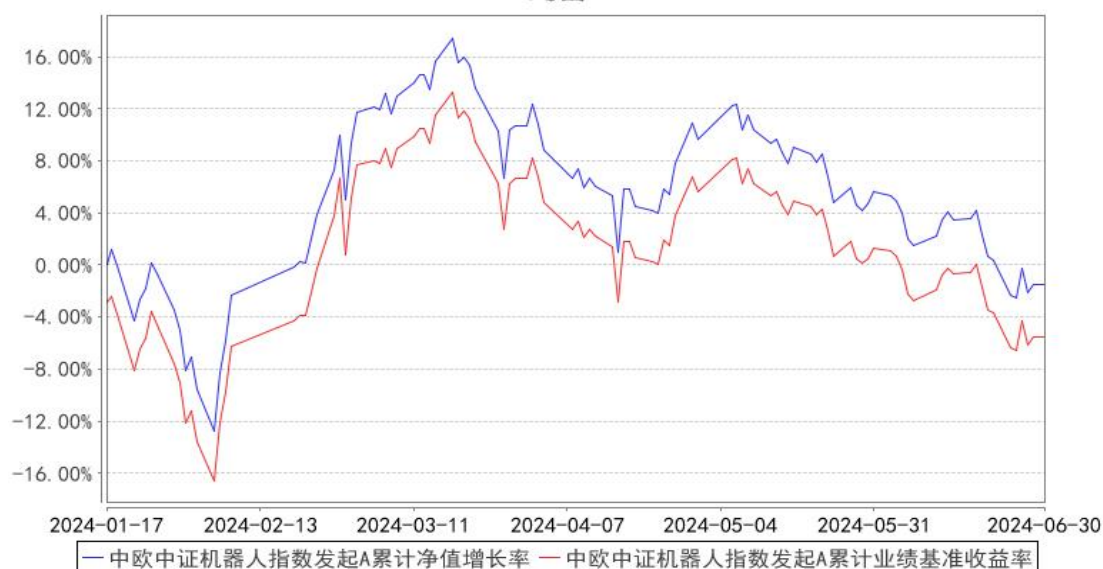
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-6.73%	1.24%	-6.76%	1.24%	0.03%	0.00%
过去三个月	-11.04%	1.47%	-11.41%	1.48%	0.37%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.57%	1.85%	-5.54%	1.94%	3.97%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为：中证机器人指数收益率*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。

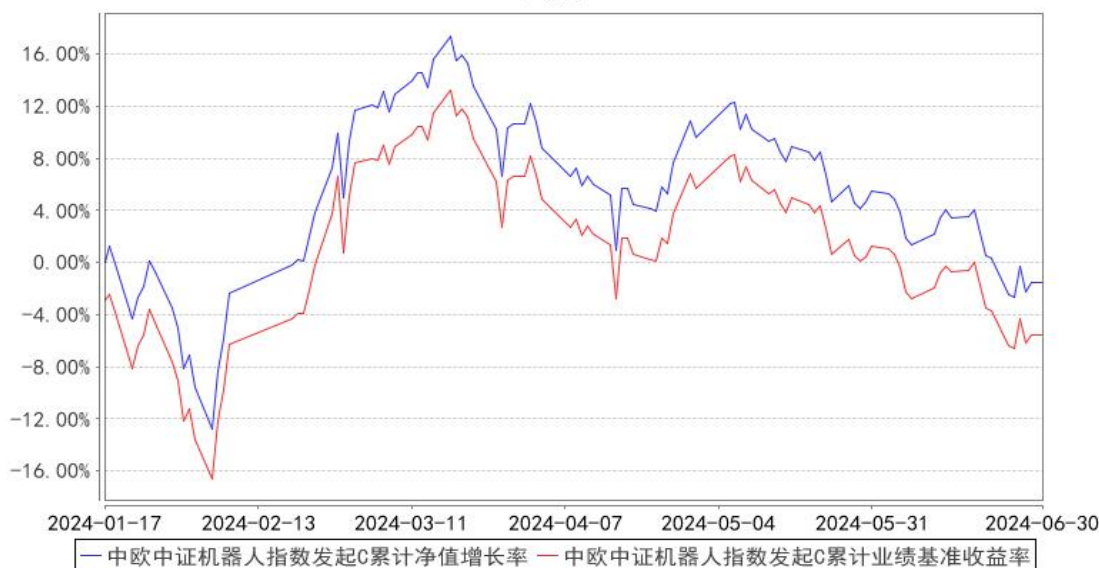
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧中证机器人指数发起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 2024 年 1 月 17 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应当符合基金合同约定。

中欧中证机器人指数发起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 2024 年 1 月 17 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应当符合基金合同约定。

§ 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 175 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		
宋巍巍	基金经理	2024-01-17	-	7 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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

即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

4.2 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 14 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

我国工业机器人装机量全球第一，工业机器人产量从 16 年 6.5 万台快速增长到 23 年 37.7 万台，其中 30% 左右的需求来自电气电子行业，26% 来自汽车制造行业。工业机器人是中国制造业从中低端向高端发展的重要基石。今年上半年工业机器人产量同比增长 26.8%，根据 MIR 睿工业预测，2025 年国内工业机器人销量有望达 39.2 万台。

工业机器人是顺周期行业，历史中其产量与制造业 PMI 相关性较高。今年以来工业机器人行业先于制造业开始复苏，工业机器人的发展得益于国内高端制造业尤其是新能源汽车行业的快速发展。虽然国内 6 月和 7 月 PMI 数据处于枯荣线以下，国内工业机器人产量已连续 7 个月同比回

升，2024 年 1-6 月工业机器人累计产量创历史新高，我们预计下半年工业机器人出货量有望持续回升。

工业机器人已经成为国产替代的又一重要领域。2023 年工业机器人内外资市场份额发生较大变化，根据 GGII 最新统计数据显示，2023 年国产工业机器人份额首次突破 50%，达到 52.45%，从销量口径上首次实现反超。预计 2024 年国产工业机器人市场份额有望继续提升。

人形机器人作为人工智能未来最大的下游应用，行业处于 0-1 的阶段，政策支持、新产品和创新是行业的三个驱动因子。23 年 11 月工业和信息化部发布了《人形机器人创新发展指导意见》提出支持建设人形机器人重点实验室、制造业创新中心，凝聚产学研力量提升关键共性技术供给能力。截至 2024 年 6 月，国内已成立 9 家人形机器人创新中心。各个地方也发布了针对人形机器人产业的发展规划，今年 6 月分别有《山东省促进人形机器人产业创新发展实施方案（2024-2027 年）》，《安徽省人形机器人产业发展行动计划（2024-2027 年）》发布，支持人形机器人初创企业，促进人形机器人产业化落地。

本基金于 2024 年 1 月成立，报告期内，基金管理人根据基金合同约定进行了建仓操作。在投资策略方面，本基金作为跟踪中证机器人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-1.47%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%；基金 C 类份额净值增长率为-1.57%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

人形机器人集成人工智能、高端制造、新材料等先进技术，将深刻变革人类生产生活方式，重塑全球产业发展格局。全球多个科技巨头布局人形机器人行业，共同推动行业进步。目前人形机器人行业处于整机成熟度提升，零部件进入定点采购，量产逐步推进的阶段。今年以来，Optimus 擎天柱人形机器人经过多次迭代，进入类通用场景学习。另外，多家科技巨头参与投资的 Figure 机器人，已经具备与人类对话、自主识别各类物体及其位置和状态的能力。3 月 19 日的全球英伟达 GTC 大会中，九款人形机器人压轴亮相，其中三款来自我国人形机器人公司。人形机器人、工业机器人等具身智能形态，是人工智能时代最重要的技术落地，也是算力需求的下一个爆发点。

今年五月，国内人形机器人企业在日本横滨举办的 ICRA（IEEE International Conference on Robotics and Automation）机器人与自动化国际会议中发布了新产品，率先实现双足人形机器人价格下调到 10 万以内。2024 年 7 月 4 日-6 日世界人工智能大会（WAIC2024）在上海召开。本届

大会展览重点打造人形机器人专区，展出多款人形机器人，Optimus 擎天柱二代在大会中亮相。

无论是人形机器人，还是工业机器人都在快速发展阶段，这两方面需求共同构成了机器人指数中各类企业的市场空间。人形机器人关节成本达到 60%，关节包含电机，减速器，丝杠，轴承，传感器等。除了软件 and 大脑之外，机器人相比数字化的人工智能应用，最大的不同是高精度的运动控制。精密关节零部件是机器人运动能力的基础，也是国内制造业企业具有成本竞争力的方向。例如机器人直线关节丝杠，在目前大部分市场份额为国外厂商的情况下，具有双重贝塔的属性：人形机器人需求+国产替代需求。另外，高精度磨床设备和传感器也是未来较多机会的细分领域。展望下半年，8 月 2024 世界机器人大会将在北京举行，9 月中国国际工业博览会机器人展将在上海举行。两场大会中会有更多新技术以及产品展现。

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验。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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧中证机器人指数发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	17,525,645.40
结算备付金		607,084.16
存出保证金		65,241.59
交易性金融资产	6.4.7.2	291,588,043.26
其中：股票投资		291,588,043.26
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		-
应收申购款		6,969,080.88
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		316,755,095.29
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		3,436,230.33
应付赎回款		4,805,014.55
应付管理人报酬		125,763.42
应付托管费		25,152.69
应付销售服务费		46,652.48
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	74,663.32
负债合计		8,513,476.79
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	313,124,529.61
未分配利润	6.4.7.8	-4,882,911.11
净资产合计		308,241,618.50
负债和净资产总计		316,755,095.29

注：1. 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 313,124,529.61 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9853 元，基金份额总额 21,587,437.18 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.9843 元，基金份额总额 291,537,092.43 份。

2. 本基金基金合同于 2024 年 01 月 17 日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧中证机器人指数发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-32,269,903.93
1. 利息收入		20,646.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,646.28
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）		-2,812,366.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,410,894.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	34.08
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	1,598,493.81
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	-29,615,972.81
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	137,789.31
减：二、营业总支出		685,459.84
1. 管理人报酬		417,779.61
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费		83,555.94
3. 销售服务费		156,728.52
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	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	27,395.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,955,363.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,955,363.77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-32,955,363.77

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧中证机器人指数发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 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	16,989,235.45	-	-	16,989,235.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	296,135,294.16	-	-4,882,911.11	291,252,383.05
（一）、综合收益总额	-	-	-32,955,363.77	-32,955,363.77
（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）	296,135,294.16	-	28,072,452.66	324,207,746.82
其中：1. 基金申购款	836,743,438.25	-	63,632,688.80	900,376,127.05
2. 基金赎回款	-540,608,144.09	-	-35,560,236.14	-576,168,380.23
（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	313,124,529.61	-	-4,882,911.11	308,241,618.50

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

杨毅

王音然

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

中欧中证机器人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[2023]2657 号文《关于准予中欧中证机器人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《中欧中证机器人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,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 16,989,235.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,004.97 基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国招商银行股份有限公司。

根据《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金基金合同》和《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资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。

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。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业

会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和

重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具,按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

- (1) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停

时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有

关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	17,525,645.40
等于：本金	17,524,005.82
加：应计利息	1,639.58
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	17,525,645.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	321,204,016.07	-	291,588,043.26	-29,615,972.81

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	321,204,016.07	-	291,588,043.26	-29,615,972.81

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 2024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	58,063.31
其中：交易所市场	58,063.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	16,600.00
补差费	0.01
合计	74,663.32

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧中证机器人指数发起 A

项目	本期 2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日
----	--------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,710,468.18	10,710,468.18
本期申购	20,282,780.51	20,282,780.51
本期赎回（以“-”号填列）	-9,405,811.51	-9,405,811.51
本期末	21,587,437.18	21,587,437.18

中欧中证机器人指数发起 C

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,278,767.27	6,278,767.27
本期申购	816,460,657.74	816,460,657.74
本期赎回（以“-”号填列）	-531,202,332.58	-531,202,332.58
本期末	291,537,092.43	291,537,092.43

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金自 2024 年 01 月 02 日至 2024 年 01 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 16,988,230.48 元（其中 A 类为 10,710,377.35 元，C 类为 6,277,853.13 元）。在本基金成立后，折算为 16,988,230.48 份基金份额（其中 A 类为 10,710,377.35 份，C 类为 6,277,853.13 份）。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 1,004.97 元（其中 A 类为 90.83 元，C 类为 914.14 元）在本基金成立后，折算为 1,004.97 份（其中 A 类为 90.83 份，C 类为 914.14 份）基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧中证机器人指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-250,098.20	-1,452,553.39	-1,702,651.59
本期基金份额交易产生的变动数	-29.02	1,385,383.86	1,385,354.84
其中：基金申购款	-23,498.95	2,070,166.52	2,046,667.57
基金赎回款	23,469.93	-684,782.66	-661,312.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-250,127.22	-67,169.53	-317,296.75

中欧中证机器人指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-3,089,292.76	-28,163,419.42	-31,252,712.18
本期基金份额交易产生的变动数	-584,605.19	27,271,703.01	26,687,097.82

其中：基金申购款	-2,330,880.86	63,916,902.09	61,586,021.23
基金赎回款	1,746,275.67	-36,645,199.08	-34,898,923.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,673,897.95	-891,716.41	-4,565,614.36

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
活期存款利息收入	17,100.81	
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	3,318.47	
其他	227.00	
合计	20,646.28	

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	
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	111,161,655.15	
减：卖出股票成本总额	115,258,924.79	
减：交易费用	313,624.96	
买卖股票差价收入	-4,410,894.60	

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	
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	631.08	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-597.00	
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	34.08	

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	
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日	

	月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,421,034.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,404,576.00
减：应计利息总额	17,055.75
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-597.00

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
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,598,493.81
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	1,598,493.81

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-29,615,972.81
股票投资	-29,615,972.81
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	-29,615,972.81

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	137,293.99
基金转换费收入	495.32
合计	137,789.31

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 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	16,600.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,906.88
账户维护费	3,000.00
开户费	400.00
存托服务费	488.89
合计	27,395.77

6.4.7.19 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

中欧基金管理有限公司已于 2024 年 4 月 9 日正式受让中欧私募基金管理（上海）有限公司全部股权，中欧私募基金管理（上海）有限公司已变更为中欧基金管理有限公司全资子公司。

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东，基金销售机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国都证券	238,196,896.86	43.52

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
国都证券	404,161.17	14.22

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国都证券	177,774.77	79.67	12,706.62	21.88

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月17日（基金合同生效日）至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：应支付销售机构的客户维护费	167,718.19
应支付基金管理人的净管理费	250,061.42

注：1. 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。

2. 本基金合同于 2024 年 1 月 17 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	83,555.94

注：1. 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。

2. 本基金合同于 2024 年 1 月 17 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧中证机器人指数 发起 A	中欧中证机器人指数 发起 C	合计
招商银行	-	8,336.71	8,336.71
中欧财富	-	484.68	484.68
合计	-	8,821.39	8,821.39

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。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算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金合同于 2024 年 1 月 17 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧中证机器人指数发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 1 月 17 日）持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	46.32%

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、本报告期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金 C 类基金份额。

4、本基金合同于 2024 年 1 月 17 日生效，故无上年度可比期间数据。

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

中欧中证机器人指数发起 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	5,000.00	0.00%
-	-	-

注：1、本报告期内，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，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。

3、本基金合同于 2024 年 1 月 17 日生效，故无上年度可比期末数据。

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 2024 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	17,525,645.40	17,100.81

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于 2024 年 01 月 17 日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2024 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	569	6,759.72	10,799.62	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	186	8,360.70	12,262.98	-
603285	键邦股	2024 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	133	3,105.55	3,342.29	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	88	7,652.48	15,393.84	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 2024 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 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%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	17,525,645.40	-	-	-	17,525,645.40
结算备付金	607,084.16	-	-	-	607,084.16

存出保证金	65,241.59	-	-	65,241.59
交易性金融资产	-	-	-291,588,043.26	291,588,043.26
应收申购款	-	-	6,969,080.88	6,969,080.88
资产总计	18,197,971.15	-	-298,557,124.14	316,755,095.29
负债				
应付赎回款	-	-	4,805,014.55	4,805,014.55
应付管理人报酬	-	-	125,763.42	125,763.42
应付托管费	-	-	25,152.69	25,152.69
应付清算款	-	-	3,436,230.33	3,436,230.33
应付销售服务费	-	-	46,652.48	46,652.48
其他负债	-	-	74,663.32	74,663.32
负债总计	-	-	8,513,476.79	8,513,476.79
利率敏感度缺口	18,197,971.15	-	-290,043,647.35	308,241,618.50

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2024 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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2024 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	291,588,043.26	94.60

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	291,588,043.26	94.60

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（2024年6月30日）
	业绩比较基准上升5%	14,492,166.54
	业绩比较基准下降5%	-14,492,166.54

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 2024年6月30日
第一层次	291,522,241.98
第二层次	24,002.55
第三层次	41,798.73

合计	291,588,043.26
----	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 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	291,588,043.26	92.05
	其中：股票	291,588,043.26	92.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,132,729.56	5.72
8	其他各项资产	7,034,322.47	2.22
9	合计	316,755,095.29	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	228,942,040.78	74.27
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	59,362,827.65	19.26
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	3,217,373.55	1.04
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	291,522,241.98	94.58

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

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	50,407.44	0.02
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	15,393.84	0.00
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	-	-
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	65,801.28	0.02

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	002230	科大讯飞	722,400	31,027,080.00	10.07
2	300124	汇川技术	552,300	28,332,990.00	9.19
3	688169	石头科技	59,011	23,167,718.60	7.52
4	002236	大华股份	1,266,600	19,581,636.00	6.35
5	688777	中控技术	404,887	15,264,239.90	4.95
6	002008	大族激光	539,300	11,217,440.00	3.64
7	688188	柏楚电子	52,648	9,716,188.40	3.15
8	002472	双环传动	433,400	9,543,468.00	3.10
9	002139	拓邦股份	798,900	8,484,318.00	2.75
10	300024	机器人	794,700	7,740,378.00	2.51
11	603486	科沃斯	147,800	6,973,204.00	2.26
12	300083	创世纪	1,079,800	6,619,174.00	2.15
13	603283	赛腾股份	77,000	5,882,800.00	1.91
14	688017	绿的谐波	64,861	5,325,088.10	1.73
15	002747	埃斯顿	334,300	4,753,746.00	1.54
16	603728	鸣志电器	107,700	4,332,771.00	1.41
17	601608	中信重工	1,112,200	4,237,482.00	1.37

18	000967	盈峰环境	815,200	3,448,296.00	1.12
19	688248	南网科技	108,585	3,217,373.55	1.04
20	002031	巨轮智能	1,409,000	3,198,430.00	1.04
21	688559	海目星	91,464	3,008,250.96	0.98
22	000837	秦川机床	388,300	2,857,888.00	0.93
23	688322	奥比中光	102,544	2,738,950.24	0.89
24	002559	亚威股份	352,100	2,697,086.00	0.87
25	601882	海天精工	100,400	2,300,164.00	0.75
26	300607	拓斯达	163,200	2,222,784.00	0.72
27	002979	雷赛智能	118,900	2,163,980.00	0.70
28	300222	科大智能	399,900	2,143,464.00	0.70
29	603960	克来机电	101,100	2,133,210.00	0.69
30	301368	丰立智能	46,100	2,124,288.00	0.69
31	688305	科德数控	32,584	2,100,364.64	0.68
32	300660	江苏雷利	81,200	2,072,224.00	0.67
33	300161	华中数控	89,100	2,003,859.00	0.65
34	603611	诺力股份	115,600	1,969,824.00	0.64
35	688343	云天励飞	68,297	1,949,879.35	0.63
36	300276	三丰智能	538,200	1,894,464.00	0.61
37	300278	华昌达	637,300	1,829,051.00	0.59
38	688097	博众精工	85,910	1,828,164.80	0.59
39	002527	新时达	296,700	1,777,233.00	0.58
40	603915	国茂股份	169,600	1,745,184.00	0.57
41	002896	中大力德	58,100	1,620,990.00	0.53
42	688003	天准科技	49,354	1,616,837.04	0.52
43	688277	天智航	201,643	1,560,716.82	0.51
44	603416	信捷电气	54,100	1,546,178.00	0.50
45	688686	奥普特	23,475	1,503,104.25	0.49
46	600215	派斯林	208,500	1,486,605.00	0.48
47	300802	矩子科技	92,600	1,460,302.00	0.47
48	688698	伟创电气	53,927	1,454,411.19	0.47
49	002957	科瑞技术	105,600	1,431,936.00	0.46
50	688320	禾川科技	58,074	1,425,135.96	0.46
51	002380	科远智慧	76,800	1,405,440.00	0.46
52	300809	华辰装备	64,600	1,308,796.00	0.42
53	688306	均普智能	314,499	1,276,865.94	0.41
54	603666	亿嘉和	79,300	1,251,354.00	0.41
55	002184	海得控制	135,400	1,215,892.00	0.39
56	300486	东杰智能	205,800	1,181,292.00	0.38
57	002248	华东数控	197,100	1,180,629.00	0.38
58	600560	金自天正	86,000	1,152,400.00	0.37
59	688022	瀚川智能	78,799	1,080,334.29	0.35
60	688218	江苏北人	60,627	1,067,641.47	0.35

61	002975	博杰股份	35,600	1,063,728.00	0.35
62	688165	埃夫特	133,667	1,045,275.94	0.34
63	300097	智云股份	185,000	1,017,500.00	0.33
64	688697	纽威数控	62,838	985,928.22	0.32
65	603015	弘讯科技	129,600	979,776.00	0.32
66	301255	通力科技	20,900	651,662.00	0.21
67	688160	步科股份	16,168	646,558.32	0.21
68	300472	新元科技	141,400	626,402.00	0.20
69	301199	迈赫股份	25,600	619,008.00	0.20
70	001266	宏英智能	26,500	575,580.00	0.19
71	301112	信邦智能	21,200	459,828.00	0.15

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

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	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
2	688692	达梦数据	88	15,393.84	0.00
3	301580	爱迪特	186	12,262.98	0.00
4	301565	中仑新材	569	10,799.62	0.00
5	603381	永臻股份	133	3,342.29	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	40,843,480.55	13.25
2	002230	科大讯飞	37,847,228.96	12.28
3	002236	大华股份	24,781,007.30	8.04
4	688169	石头科技	23,746,747.36	7.70
5	688777	中控技术	19,724,087.97	6.40
6	688188	柏楚电子	11,943,912.48	3.87
7	002008	大族激光	11,789,995.32	3.82
8	002472	双环传动	10,442,180.31	3.39
9	300024	机器人	10,007,943.77	3.25
10	688017	绿的谐波	9,482,777.78	3.08
11	689009	九号公司	8,362,771.75	2.71
12	002139	拓邦股份	8,331,188.00	2.70
13	603486	科沃斯	7,600,084.00	2.47
14	300083	创世纪	7,321,923.25	2.38
15	603283	赛腾股份	6,797,842.00	2.21
16	603728	鸣志电器	6,572,499.00	2.13
17	002747	埃斯顿	6,240,315.00	2.02
18	002851	麦格米特	6,183,927.14	2.01

19	002698	博实股份	5,466,043.00	1.77
20	601608	中信重工	5,382,265.50	1.75

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	689009	九号公司	9,414,040.95	3.05
2	300124	汇川技术	7,111,308.50	2.31
3	002851	麦格米特	6,722,600.00	2.18
4	002698	博实股份	4,975,280.00	1.61
5	002230	科大讯飞	3,919,025.00	1.27
6	002073	软控股份	3,652,222.00	1.18
7	000821	京山轻机	3,629,967.00	1.18
8	002214	大立科技	3,295,662.00	1.07
9	300048	合康新能	3,224,442.00	1.05
10	002334	英威腾	2,933,158.00	0.95
11	002006	精工科技	2,793,397.00	0.91
12	300455	航天智装	2,615,082.00	0.85
13	600775	南京熊猫	2,458,570.00	0.80
14	002997	瑞鹤模具	2,255,689.00	0.73
15	301029	怡合达	2,217,325.20	0.72
16	603960	克来机电	2,197,522.00	0.71
17	002009	天奇股份	2,038,740.00	0.66
18	688777	中控技术	1,934,461.72	0.63
19	002236	大华股份	1,897,927.00	0.62
20	300293	蓝英装备	1,856,516.00	0.60

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	436,462,940.86
卖出股票收入（成交）总额	111,161,655.15

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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规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	65,241.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,969,080.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,034,322.47

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股未上市
2	688692	达梦数据	15,393.84	0.00	新股流通受限
3	301580	爱迪特	12,262.98	0.00	新股流通受限
4	301565	中仑新材	10,799.62	0.00	新股流通受限
5	603381	永臻股份	3,342.29	0.00	新股流通受限

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
中欧中证机器人指数发起 A	1,241	17,395.20	10,000,000.00	46.32%	11,587,437.18	53.68%
中欧中证机器人指数发起 C	51,951	5,611.77	0.00	0.00%	291,537,092.43	100.00%
合计	53,192	5,886.68	10,000,000.00	3.19%	303,124,529.61	96.81%

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	中欧中证机器人指数发起 A	9,089.17	0.04%

理人所有从业人员持有本基金	中欧中证机器人指数发起 C	29,044.63	0.01%
	合计	38,133.80	0.01%

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	中欧中证机器人指数发起 A	0
	中欧中证机器人指数发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧中证机器人指数发起 A	0
	中欧中证机器人指数发起 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	3.19%	10,000,000.00	3.19%	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	3.19%	10,000,000.00	3.19%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧中证机器人指数发起 A	中欧中证机器人指数发起 C
基金合同生效日 (2024 年 1 月 17 日) 基金份额总额	10,710,468.18	6,278,767.27
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申	20,282,780.51	816,460,657.74

购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	9,405,811.51	531,202,332.58
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,587,437.18	291,537,092.43

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
中信证券	3	309,146,012.59	56.48	45,356.69	20.33	本报告期新增 3 个
国都证券	2	238,196,896.86	43.52	177,774.77	79.67	本报告期新增 2 个, 本报告期退租 2 个
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	2,437,874.25	85.78	-	-	-	-
国都证券	404,161.17	14.22	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2024-01-18
2	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2024-01-18
3	中欧基金管理有限公司关于中欧中证机器人指数发起式证券投资基金 A 类份额参与招商银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2024-01-19
4	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金 C 类基金份额实施销售服务费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2024-03-28
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-16
6	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-16
7	中欧中证机器人指数发起式证券投资基金更新招募说明书（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
8	中欧中证机器人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	2024-06-25

§ 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	2024 年 01 月 17 日至 2024 年 02 月 26 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	3.19%

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、中欧中证机器人指数发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧中证机器人指数发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 (www.zofund.com) 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

2024 年 8 月 31 日