

# 中欧消费主题股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12	投资组合报告附注.....	51
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>52</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	53
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4	基金投资策略的改变.....	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8	其他重大事件.....	57
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>58</b>
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 .....	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1	备查文件目录.....	58
12.2	存放地点.....	58
12.3	查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧消费主题股票型证券投资基金	
基金简称	中欧消费主题股票	
基金主代码	002621	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	706,852,972.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧消费主题股票 A	中欧消费主题股票 C
下属分级基金的交易代码	002621	002697
报告期末下属分级基金的份额总额	424,097,163.42 份	282,755,808.82 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关的具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金持续跟踪宏观经济面、政策面等重要指标，进行自上而下宏观分析，并结合市场环境趋势分析，综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。本基金为股票型基金，长期来看整体将积极配置于股票类资产，并根据市场环境动态调整。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	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，属于高预期收益风险水平的投资品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	北京市西城区复兴门内大街 55

	家嘴环路 479 号 8 层	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

## 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	中欧消费主题股票 A	中欧消费主题股票 C
本期已实现收益	-117,168,190.34	-70,014,576.06
本期利润	-64,820,359.54	-44,856,611.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1418	-0.1594
本期加权平均净值利润率	-7.26%	-8.36%
本期基金份额净值增长率	-8.13%	-8.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	59,197,221.62	26,782,918.23
期末可供分配基金份额利润	0.1396	0.0947
期末基金资产净	760,127,234.60	494,538,730.76

值		
期末基金份额净值	1.7923	1.7490
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	79.23%	74.90%

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、所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

中欧消费主题股票 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	-0.31%	0.91%	3.48%	1.01%	-3.79%	-0.10%
过去三个月	-9.31%	0.94%	-7.39%	0.87%	-1.92%	0.07%
过去六个月	-8.13%	0.93%	-5.47%	0.91%	-2.66%	0.02%
过去一年	-22.98%	1.17%	-16.41%	1.08%	-6.57%	0.09%
过去三年	-36.44%	1.35%	2.96%	1.32%	-39.40%	0.03%
自基金合同生效起至今	79.23%	1.36%	82.23%	1.24%	-3.00%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率\*85%+中证综合债券指数收益率\*15%。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。

中欧消费主题股票 C

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

过去一个月	-0.38%	0.91%	3.48%	1.01%	-3.86%	-0.10%
过去三个月	-9.49%	0.94%	-7.39%	0.87%	-2.10%	0.07%
过去六个月	-8.49%	0.93%	-5.47%	0.91%	-3.02%	0.02%
过去一年	-23.59%	1.17%	-16.41%	1.08%	-7.18%	0.09%
过去三年	-37.93%	1.35%	2.96%	1.32%	-40.89%	0.03%
自基金合同生效起至今	74.90%	1.36%	82.23%	1.24%	-7.33%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率\*85%+中证综合债券指数收益率\*15%。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







## § 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和中欧基金国际有限公司。截至2023年6月30日，本基金管理人共管理150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		
成雨轩	基金经理	2023-06-30	-	9年	历任方正证券股份有限公司食品饮料研究员，招商基金管理有限公司食品饮料/农业研究员。2018-03-26加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理、投资经理。
郭睿	基金经理	2018-07-12	2023-06-30	12年	历任中国国际金融股份有限公司研究部高级经理。2015-07-15加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。

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。

#### 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 69 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

报告期内大部分消费子行业在经历了春节前后的短期爆发式增长后，均呈现出收入增速放缓的态势，正如我们前期一直强调的，消费的复苏是缓慢的，并非一蹴而就的；春节期间的数据应当理解为是三年疫情结束后需求集中释放并且带有一定报复性消费的可能，而不是消费持续复苏的起点。在过去的三年中，疫情成为了多数企业的遮羞布，大家下意识的将收入的放缓/下滑，业绩的下滑甚至亏损全部归结于疫情的影响，从而忽视了企业本身存在的问题，第二季度的经营情况就是一块验金石。

在行业整体催化有限的背景下，我们仍然认为进一步挖掘个股将有望带来超额收益机会。行业优质公司的复苏进程将有望延续并逐步加速，供给侧出清越严重的行业，这一现象将更加明显。

期内本基金严格恪守基金契约，积极寻找未来仍具备持续、高速增长的优质公司。我们依旧

维持前期观点，消费的复苏是需要伴随经济的恢复而实现的，这一过程并非短期行为。从目前的经济预期来看，我们认为全年消费行业收入端整体有望呈现出一定增长，但增速尚难言乐观；反而是利润率有望得到快速修复。

对于地产产业链，我们整体偏谨慎，在房地产行业供需格局发生变化的背景下，对于产业链公司的影响亦需要时间进一步观察，在没有重大政策刺激的情况下，短期内出现板块性反转的概率不大。我们对相关标的进行了适当减仓。

对于养殖板块，我们认为仍在筑底过程当中，考虑整体生猪和白羽鸡价格处于相对低位，我们进行了初步的建仓，后续将会持续跟踪。

#### 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-8.13%，同期业绩比较基准收益率为-5.47%；基金 C 类份额净值增长率为-8.49%，同期业绩比较基准收益率为-5.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济稳定健康的发展是资本市场能够长期繁荣的前提，企业需要经济的增长来不断扩大业务边界，科技创新也需要有活力的经济环境。但宏观经济总有周期，上行周期企业共同繁荣，下行周期众多企业掉队，有护城河的企业才能够不断穿越周期。资本市场也往往跟随经济周期重复着过度乐观-过度悲观的周期，导致企业的估值大幅波动，而恰恰也是市场的极端演绎，给价值投资者收益率最大化的机会。

有效市场假说认为股票价格反映了市场上有关公司的所有可用信息，投资者无法通过挑选股票来获得优于市场指数的表现，因此很多人认为市场永远是对的。但实际情况是大多数人都会受贪婪、恐惧、妒忌及其他破坏客观性、导致重大失误的情绪驱动，市场往往将涨跌演绎到极致，本质上是投资者情绪的波动所致。上半年宏观经济的羸弱致使投资者将长期问题短期化，以最极端的思维去推演未来经济的走势，错杀了众多优质的公司。

市场短期往往是失效的，应对失效最好的办法是能够准确估计公司的内含价值，并且借助或利用价格和价值背离的机会，最大化收益率。市场的极度悲观提供了低风险高收益的机会，市场的狂热也提供了良好的兑现收益的机会。建立基本面——价值——价格之间的健康关系是长期成功投资的核心。

对内含价值的准确评估需要管理人深度自上而下审视公司的基本面，严谨的研究不仅有助于准确评估价值，更重要的是在价格和价值背离的时候，坚持做该做的事，抵御市场噪音的消极影响，避免随波逐流。随着时间的推移，资产价格终会与资产价值趋于一致，我们追求的长期收益率也有望得以实现。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——中欧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、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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中欧消费主题股票型证券投资基金

2023 年中期报告中财务指标、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：中欧消费主题股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	94,527,252.99	112,472,810.91
结算备付金		366,867.22	1,943,380.65
存出保证金		317,914.57	336,584.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,162,669,137.42	1,470,444,275.81
其中：股票投资		1,162,669,137.42	1,470,444,275.81
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		-	7,802,047.41
应收股利		-	-
应收申购款		558,926.97	1,069,451.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,258,440,099.17	1,594,068,551.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	26,254,625.51
应付赎回款		973,438.80	892,205.27
应付管理人报酬		1,549,280.94	2,069,676.77
应付托管费		258,213.51	344,946.11
应付销售服务费		324,537.18	379,418.49
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	668,663.38	1,032,925.01
负债合计		3,774,133.81	30,973,797.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	706,852,972.24	806,966,480.11
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	547,812,993.12	756,128,273.90
净资产合计		1,254,665,965.36	1,563,094,754.01
负债和净资产总计		1,258,440,099.17	1,594,068,551.17

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 706,852,972.24 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.7923 元，基金份额总额 424,097,163.42 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.7490 元，基金份额总额 282,755,808.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧消费主题股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-95,008,421.03	-412,377,111.81
1. 利息收入		230,495.86	362,158.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	230,495.86	338,872.19
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		-	23,286.16
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-173,100,814.45	-281,528,614.65

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-188,375,050.37	-288,412,228.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	15,274,235.92	6,883,613.38
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	77,505,794.99	-132,146,048.16
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	356,102.57	935,392.65
<b>减：二、营业总支出</b>		14,668,550.38	20,462,445.20
1. 管理人报酬		10,653,484.87	15,209,019.74
2. 托管费		1,775,580.79	2,534,836.60
3. 销售服务费		2,130,453.89	2,602,370.71
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	109,030.83	116,218.15
<b>三、利润总额（亏损总     额以“-”号填列）</b>		-109,676,971.41	-432,839,557.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以     “-”号填列）</b>		-109,676,971.41	-432,839,557.01
<b>五、其他综合收益的税     后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-109,676,971.41	-432,839,557.01

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧消费主题股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 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(基金净值)	806,966,480.11	-	756,128,273.90	1,563,094,754.01
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	806,966,480.11	-	756,128,273.90	1,563,094,754.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-100,113,507.87	-	-208,315,280.78	-308,428,788.65
(一)、综合收益总额	-	-	-109,676,971.41	-109,676,971.41
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-100,113,507.87	-	-98,638,309.37	-198,751,817.24
其中: 1. 基金申购款	72,876,552.45	-	66,844,773.94	139,721,326.39
2. 基金赎回款	-172,990,060.32	-	-165,483,083.31	-338,473,143.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	706,852,972.24	-	547,812,993.12	1,254,665,965.36
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	951,867,254.25	-	1,652,956,581.28	2,604,823,835.53
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	951,867,254.25	-	1,652,956,581.28	2,604,823,835.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-112,861,957.69	-	-550,025,601.58	-662,887,559.27
(一)、综合收益总额	-	-	-432,839,557.01	-432,839,557.01
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-112,861,957.69	-	-117,186,044.57	-230,048,002.26
其中: 1. 基金申购款	127,161,684.78	-	160,916,697.93	288,078,382.71
2. 基金赎回款	-240,023,642.47	-	-278,102,742.50	-518,126,384.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	839,005,296.56	-	1,102,930,979.70	1,941,936,276.26

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

中欧消费主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 631 号《关于准予中欧消费主题股票型证券投资基金注册的批复》核准,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《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 643,240,697.30 份基金份额,包含认购资金利息折合 157,608.09 份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人中国工商银行股份有限公司。

根据《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》和《中欧消费主题股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,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;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。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不得互相转换。

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 2023 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》、《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2023 年 06 月 30 日的财

务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[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。

(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。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	94,527,252.99
等于：本金	94,518,099.74
加：应计利息	9,153.25
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	94,527,252.99

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,453,185,294.43	-	1,162,669,137.42	-290,516,157.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,453,185,294.43	-	1,162,669,137.42	-290,516,157.01

#### 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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	741.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	488,722.95
其中：交易所市场	488,722.95
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	119,671.58
应付转出费	10.29
补差费	9.23
合计	668,663.38

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧消费主题股票 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	523,145,082.16
本期申购	29,503,928.50	29,503,928.50
本期赎回（以“-”号填列）	-128,551,847.24	-128,551,847.24
本期末	424,097,163.42	424,097,163.42

##### 中欧消费主题股票 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	283,821,397.95
本期申购	43,372,623.95	43,372,623.95
本期赎回（以“-”号填列）	-44,438,213.08	-44,438,213.08
本期末	282,755,808.82	282,755,808.82

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

##### 中欧消费主题股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	202,919,702.65	294,557,634.86	497,477,337.51
本期利润	-117,168,190.34	52,347,830.80	-64,820,359.54
本期基金份额交易产生的变动数	-26,554,290.69	-70,072,616.10	-96,626,906.79
其中：基金申购款	6,636,006.15	21,275,995.30	27,912,001.45
基金赎回款	-33,190,296.84	-91,348,611.40	-124,538,908.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,197,221.62	276,832,849.56	336,030,071.18

##### 中欧消费主题股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,976,482.79	160,674,453.60	258,650,936.39
本期利润	-70,014,576.06	25,157,964.19	-44,856,611.87
本期基金份额交易产生的变动数	-1,178,988.50	-832,414.08	-2,011,402.58

其中：基金申购款	7,654,806.09	31,277,966.40	38,932,772.49
基金赎回款	-8,833,794.59	-32,110,380.48	-40,944,175.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,782,918.23	185,000,003.71	211,782,921.94

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	213,676.61	
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	14,135.91	
其他	2,683.34	
合计	230,495.86	

#### 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	1,286,135,993.71	
减：卖出股票成本总额	1,471,313,112.51	
减：交易费用	3,197,931.57	
买卖股票差价收入	-188,375,050.37	

#### 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

无。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,274,235.92
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	15,274,235.92

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	77,505,794.99
股票投资	77,505,794.99
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	77,505,794.99

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	344,655.25
基金转换费收入	11,447.32
合计	356,102.57

## 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-



汇划手续费	851.88
账户维护费	9,000.00
合计	109,030.83

#### 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

本报告期内，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：  
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）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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
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
自然人股东	基金管理人的股东

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国都证券	-	-	4,298,876.26	0.21

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	3,143.79	0.21	-	-

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,653,484.87	15,209,019.74
其中：支付销售机构的客户维护费	4,217,774.24	4,927,918.31

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,775,580.79	2,534,836.60

注：支付基金托管人 中国工商银行股份有限公司 的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧消费主题股票 A	中欧消费主题股票 C	合计
工商银行	-	54,865.32	54,865.32
国都证券	-	4,201.27	4,201.27
中欧财富	-	30,261.05	30,261.05
合计	-	89,327.64	89,327.64
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧消费主题股票 A	中欧消费主题股票 C	合计
工商银行	-	60,990.74	60,990.74
国都证券	-	4,641.73	4,641.73
中欧基金	-	45,529.12	45,529.12
合计	-	111,161.59	111,161.59

注：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率为 0.80%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

中欧消费主题股票 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	569,254.78	0.13%	569,254.78	0.11%

份额单位：份

中欧消费主题股票 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	254.50	0.00%	254.50	0.00%

注：1、截止本报告期末，本基金自然人股东持有本基金 C 类份额的实际比例为 0.0001%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

2、截止上年度末，本基金自然人股东持有本基金 C 类份额的实际比例为 0.0001%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国工商银行股份有限公司	94,527,252.99	213,676.61	164,107,545.18	320,887.76

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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（2023 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
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑	2023 年 3 月	6 个月	新股	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

	科技	月 1 日		流通受限						
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	2,975	91,778.75	70,299.25	-

				限						
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生	2022年12月20日	6个月	新股流	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

	物	日		通受限						
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-



				限						
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	1,817	43,190.09	77,931.13	-
301360	荣	2023	6个月	新	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

	旗科技	年 4 月 17 日		股流通受限						
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-

				受限						
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩	2023年6月	6个月	新股	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

	汽电	月 26 日		流通受限						
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

				受限						
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	2,210	83,714.80	65,172.90	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,510	76,871.90	73,089.10	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	5,245	58,219.50	89,374.80	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688486	龙迅股份	2023年2月10日	6个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-

688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天	2023年5月	6个月	新股	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

	软件	月 15 日		流通受限						
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

				受 限						
688629	华 丰 科 技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱 斯 信 息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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 2023 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 2023 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。本基金主要投资于消费主题相关的具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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 2023 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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	94,527,252.99	-	-	-	94,527,252.99
结算备付金	366,867.22	-	-	-	366,867.22
存出保证金	317,914.57	-	-	-	317,914.57

交易性金融资产	-	-	-	-1,162,669,137.42	1,162,669,137.42
应收申购款	-	-	-	558,926.97	558,926.97
资产总计	95,212,034.78	-	-	-1,163,228,064.39	1,258,440,099.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	973,438.80	973,438.80
应付管理人报酬	-	-	-	1,549,280.94	1,549,280.94
应付托管费	-	-	-	258,213.51	258,213.51
应付销售服务费	-	-	-	324,537.18	324,537.18
其他负债	-	-	-	668,663.38	668,663.38
负债总计	-	-	-	3,774,133.81	3,774,133.81
利率敏感度缺口	95,212,034.78	-	-	-1,159,453,930.58	1,254,665,965.36
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	112,472,810.91	-	-	-	112,472,810.91
结算备付金	1,943,380.65	-	-	-	1,943,380.65
存出保证金	336,584.65	-	-	-	336,584.65
交易性金融资产	-	-	-	-1,470,444,275.81	1,470,444,275.81
应收清算款	-	-	-	7,802,047.41	7,802,047.41
应收申购款	-	-	-	1,069,451.74	1,069,451.74
资产总计	114,752,776.21	-	-	-1,479,315,774.96	1,594,068,551.17
负债					
应付清算款	-	-	-	26,254,625.51	26,254,625.51
应付赎回款	-	-	-	892,205.27	892,205.27
应付管理人报酬	-	-	-	2,069,676.77	2,069,676.77
应付托管费	-	-	-	344,946.11	344,946.11
应付销售服务费	-	-	-	379,418.49	379,418.49
其他负债	-	-	-	1,032,925.01	1,032,925.01
负债总计	-	-	-	30,973,797.16	30,973,797.16
利率敏感度缺口	114,752,776.21	-	-	-1,448,341,977.80	1,563,094,754.01

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 2023 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%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 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。

### 6.4.13.4.3 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 2023年6月30日		上年度末 2022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	1,162,669,137.42	92.67	1,470,444,275.81	94.07
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	1,162,669,137.42	92.67	1,470,444,275.81	94.07

#### 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%		41,570,995.42
业绩比较基准下降5%		-41,570,995.42	-59,475,080.24

## 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,160,132,544.79	1,448,518,420.69
第二层次	788,929.18	-
第三层次	1,747,663.45	21,925,855.12
合计	1,162,669,137.42	1,470,444,275.81

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	1,162,669,137.42	92.39
	其中：股票	1,162,669,137.42	92.39
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	94,894,120.21	7.54
8	其他各项资产	876,841.54	0.07
9	合计	1,258,440,099.17	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	36,930,559.95	2.94
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,012,075,602.36	80.66
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	113,458,818.25	9.04
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	119,783.56	0.01
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	37,242.13	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	23,348.31	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,162,669,137.42	92.67

### 7.2.2 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

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	002991	甘源食品	1,613,681	123,769,332.70	9.86
2	688526	武汉科前生物	4,264,822	101,460,115.38	8.09
3	300767	震安科技	3,857,056	97,814,940.16	7.80
4	603345	安井食品	630,392	92,541,545.60	7.38
5	603566	普莱柯	3,842,766	89,344,309.50	7.12
6	603589	口子窖	1,729,290	85,340,461.50	6.80
7	605300	佳禾食品	3,577,642	77,777,937.08	6.20
8	603877	太平鸟	3,026,225	76,502,968.00	6.10
9	600398	海澜之家	10,360,400	71,279,552.00	5.68
10	300151	昌红科技	3,933,300	71,192,730.00	5.67
11	603708	家家悦	5,642,125	70,752,247.50	5.64
12	002705	新宝股份	3,615,070	65,179,712.10	5.19
13	600337	美克家居	13,132,990	42,682,217.50	3.40
14	300587	天铁股份	5,125,246	39,464,394.20	3.15
15	002234	民和股份	1,063,600	19,368,156.00	1.54
16	603187	海容冷链	884,117	17,673,498.83	1.41
17	002458	益生股份	1,422,057	17,562,403.95	1.40
18	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
19	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
20	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.02
21	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
22	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
23	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
24	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
25	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
26	688472	阿特斯阳光电力	5,245	89,374.80	0.01
27	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
28	301358	湖南裕能	1,817	77,931.13	0.01
29	688469	中芯集成	13,510	73,089.10	0.01
30	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
31	301260	格力博	2,975	70,299.25	0.01

32	688443	C 智翔金泰	2,210	65,172.90	0.01
33	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
34	688531	日联科技股份	346	47,045.62	0.00
35	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
36	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
37	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
38	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
39	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
40	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
41	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
42	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
43	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
44	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
45	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
46	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
47	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
48	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
49	688543	N 国科军工	410	21,750.50	0.00
50	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
51	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
52	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
53	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
54	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
55	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
56	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
57	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
58	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
59	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
60	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
61	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
62	688334	C 西高院	888	14,394.48	0.00
63	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
64	688512	慧智微电子	721	13,814.36	0.00
65	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
66	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
67	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
68	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
69	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
70	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
71	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
72	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
73	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
74	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00



75	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
76	688479	用友汽车信息科技	332	9,790.68	0.00
77	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
78	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
79	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
80	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
81	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
82	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
83	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
84	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
85	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
86	301203	国泰环保	243	8,384.22	0.00
87	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
88	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
89	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
90	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
91	000888	峨眉山 A	12	137.52	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	603589	口子窖	155,007,129.07	9.92
2	688526	武汉科前生物	144,000,430.34	9.21
3	300151	昌红科技	121,871,297.93	7.80
4	603877	太平鸟	105,894,061.71	6.77
5	605300	佳禾食品	74,885,483.00	4.79
6	600398	海澜之家	70,241,447.00	4.49
7	603345	安井食品	50,763,655.88	3.25
8	600337	美克家居	45,913,405.30	2.94
9	002508	老板电器	43,040,851.96	2.75
10	603566	普莱柯	41,430,215.48	2.65
11	300767	震安科技	34,681,466.13	2.22
12	000998	隆平高科	31,822,146.00	2.04
13	600536	中国软件	31,253,504.40	2.00
14	002234	民和股份	20,226,650.00	1.29
15	002458	益生股份	20,221,412.28	1.29
16	002991	甘源食品	19,224,834.45	1.23
17	002705	新宝股份	17,450,706.00	1.12
18	603477	巨星农牧	15,579,567.00	1.00

19	001330	博纳影业	13,780,668.00	0.88
20	600975	新五丰	11,975,654.12	0.77

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	002268	卫士通	96,558,474.00	6.18
2	603345	安井食品	95,688,090.09	6.12
3	002475	立讯精密	86,906,331.09	5.56
4	600536	中国软件	86,472,546.29	5.53
5	002705	新宝股份	78,316,023.00	5.01
6	002549	凯美特气	77,357,080.88	4.95
7	688111	金山办公	76,559,177.30	4.90
8	002385	大北农	75,797,367.24	4.85
9	603429	集友股份	69,400,855.99	4.44
10	000998	隆平高科	54,792,512.90	3.51
11	300587	天铁股份	53,660,833.98	3.43
12	002991	甘源食品	51,378,592.14	3.29
13	603008	喜临门	46,737,222.84	2.99
14	603877	太平鸟	46,225,638.00	2.96
15	300151	昌红科技	41,472,341.00	2.65
16	002508	老板电器	38,821,337.00	2.48
17	603589	口子窖	28,789,887.00	1.84
18	603566	普莱柯	24,008,564.57	1.54
19	603708	家家悦	23,441,625.00	1.50
20	603477	巨星农牧	20,616,613.45	1.32

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	1,086,032,179.13
卖出股票收入（成交）总额	1,286,135,993.71

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

**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**

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**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收到公开谴责、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	317,914.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	558,926.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	876,841.54

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
中欧消费主题股票 A	107,849	3,932.32	317,148.34	0.07%	423,780,015.08	99.93%
中欧消费主题股票 C	143,617	1,968.82	5,056,209.98	1.79%	277,699,598.84	98.21%
合计	251,466	2,810.93	5,373,358.32	0.76%	701,479,613.92	99.24%

### 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	中欧消费主题股票 A	871,922.27	0.21%
	中欧消费主题股票 C	4,439.63	0.00%
	合计	876,361.90	0.12%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员持有本基金 C 类份额的实际比例为 0.0016%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

### 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	中欧消费主题股票 A	0
	中欧消费主题股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧消费主题股票 A	0
	中欧消费主题股票 C	0

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧消费主题股票 A	中欧消费主题股票 C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 22 日)	552,512,183.36	90,728,513.94
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	523,145,082.16	283,821,397.95
本报告期基金总申购份额	29,503,928.50	43,372,623.95
减：本报告期基金总赎回份额	128,551,847.24	44,438,213.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	424,097,163.42	282,755,808.82

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
财通证券	1	752,868,937.07	31.95	550,580.11	31.95	-
德邦证券	2	327,936,755.86	13.92	239,821.40	13.92	-
民生证券	2	267,763,892.96	11.36	195,805.26	11.36	-
中金公司	1	185,883,183.43	7.89	135,944.22	7.89	-
东北证券	2	185,770,459.20	7.88	135,855.35	7.88	-
西南证券	1	184,093,550.58	7.81	134,627.45	7.81	-
中信建投	2	166,051,730.77	7.05	121,434.20	7.05	-
中泰证券	2	142,367,161.96	6.04	104,113.41	6.04	-
东方财富	1	93,168,667.24	3.95	68,133.87	3.95	-
西部证券	1	20,320,058.00	0.86	14,860.91	0.86	-
国金证券	1	17,452,049.23	0.74	12,762.92	0.74	-
海通证券	1	11,401,978.7	0.48	8,338.47	0.48	-

		7				
国泰君安	1	976,202.16	0.04	713.92	0.04	-
东吴证券	1	115,207.53	0.00	84.27	0.00	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	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 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证	-	-	-	-	-	-

券						
中金公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证	-	-	-	-	-	-



券						
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 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	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧消费主题股票型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧消费主题股票型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
7	中欧消费主题股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
9	中欧消费主题股票型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	2023-06-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中欧消费主题股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧消费主题股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧消费主题股票型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](http://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

2023 年 8 月 31 日