

中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

§ 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	12
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	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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58

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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12	投资组合报告附注.....	58
§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§ 9	开放式基金份额变动	60
§ 10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4	基金投资策略的改变.....	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8	其他重大事件.....	63
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§ 12	备查文件目录	63
12.1	备查文件目录.....	63
12.2	存放地点.....	63
12.3	查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中欧新兴价值一年持有混合	
基金主代码	013220	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 6 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,621,566,989.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧新兴价值一年持有混合 A	中欧新兴价值一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	013220	013221
报告期末下属分级基金的份额总额	3,226,119,618.67 份	1,395,447,370.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置,确定股票、债券、现金等资产的投资比例,重点通过跟踪宏观经济数据(包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等)和政策环境的变化趋势,来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+银行活期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金还可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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	李帅帅
	联系电话	021-68609600	0755-25878287
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95511-3
传真		021-33830351	0755-82080387
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区陆	广东省深圳市福田区益田路 5023

	家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	窦玉明	谢永林

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)		
	中欧新兴价值一年持有混合 A	中欧新兴价值一年持有混合 C	
本期已实现收益	-121,050,359.45	-57,338,423.45	
本期利润	-400,067,810.69	-176,500,071.16	
加权平均基金份额本期利润	-0.1168	-0.1177	
本期加权平均净值利润率	-12.58%	-12.84%	
本期基金份额净值增长率	-12.95%	-13.30%	
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	-520,190,334.85	-241,887,907.59
	期末可供分配基金份额利润	-0.1612	-0.1733
	期末基金资产净值	2,705,929,283.82	1,153,559,463.16
	期末基金份额净值	0.8388	0.8267

值		
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	-16.12%	-17.33%

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

中欧新兴价值一年持有混合 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	0.26%	1.38%	0.55%	0.74%	-0.29%	0.64%
过去三个月	-10.61%	1.22%	-3.43%	0.65%	-7.18%	0.57%
过去六个月	-12.95%	1.03%	1.26%	0.63%	-14.21%	0.40%
过去一年	-16.51%	1.28%	-5.09%	0.76%	-11.42%	0.52%
自基金合同生效起至今	-16.12%	1.51%	-14.23%	0.90%	-1.89%	0.61%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+银行活期存款利率(税后)*20%。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。

中欧新兴价值一年持有混合 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	0.19%	1.38%	0.55%	0.74%	-0.36%	0.64%

过去三个月	-10.79%	1.22%	-3.43%	0.65%	-7.36%	0.57%
过去六个月	-13.30%	1.03%	1.26%	0.63%	-14.56%	0.40%
过去一年	-17.18%	1.28%	-5.09%	0.76%	-12.09%	0.52%
自基金合同生效起至今	-17.33%	1.51%	-14.23%	0.90%	-3.10%	0.61%

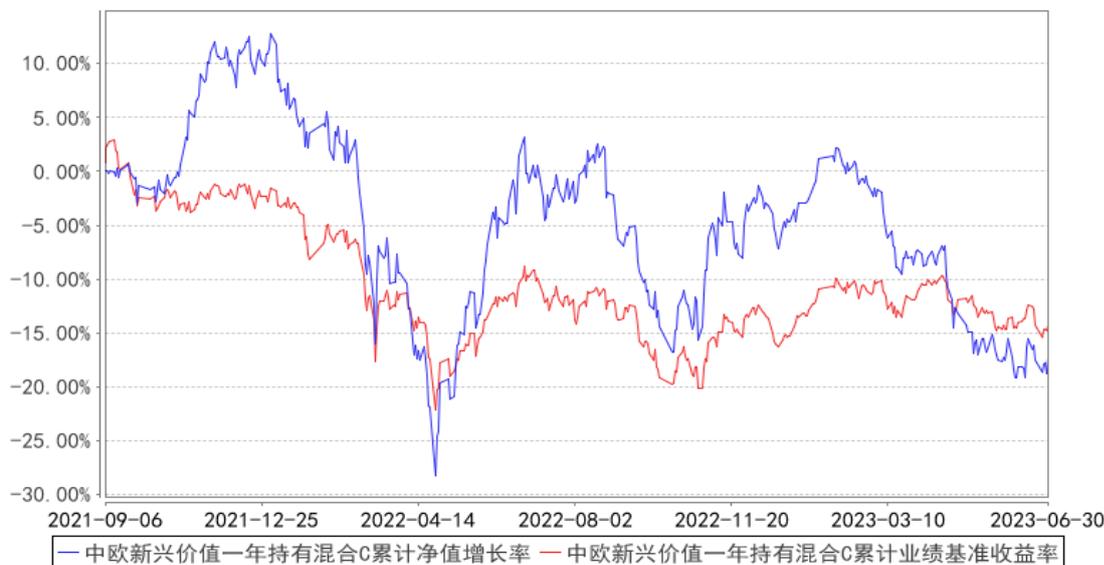
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+银行活期存款利率(税后)*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧新兴价值一年持有混合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



中欧新兴价值一年持有混合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



§ 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		
袁维德	基金经理 / 投资经理	2021-09-06	-	11年	历任新华基金行业研究员。2015-07-24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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
袁维德	公募基金	4	14,680,876,848.67	2018年3月28日
	私募资产管理计划	1	1,343,794,771.57	2021年12月8日
	其他组合	-	-	-
	合计	5	16,024,671,620.24	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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

当前市场关于汇率和权益市场估值所隐含的信息呈现越来越大的差异。在这轮美国加息周期中，中美利差达到历史新高，人民币汇率表现相对坚挺，显示出投资者对人民币资产长期竞争力的信心。虽然今年国内经济复苏低于预期，并且在美国产业政策调整下，人民币贬值，但相较近 2% 的息差，汇率市场相比权益市场的投资者对人民币资产更为乐观。与此同时，权益市场估值不断

走低，以创业板为代表，无论是绝对市盈率和市净率，还是相对全球可比公司的相对市盈率都达到历史低位，反映出当前权益投资者对于短期景气度给予的权重远高于企业长期的商业竞争力。

今年以来美国的对华政策从“全面脱钩”向以“去风险化”为名义的精准脱钩调整，以“友岸外包”策略对中国以新能源、医药生物为代表的具备全球技术、成本竞争力的高端制造行业，采用产业补贴等形式进行限制。我国的高端制造业吸纳的就业人数已在近千万量级，人均创利、人均薪酬在中国所有行业中名列翘楚，是带动中国经济增长的核心动力。在当前的体量上继续向前发展，海外尤其是欧美市场尤为重要。与此同时国内产能仍在继续扩大，而国内的需求不足以支持其产能扩张，如果海外市场拓展受阻，也必然面临盈利下滑、投资意愿降低、员工数量和薪酬增长放缓。这不仅对领先的高端制造，对一般制造业的投资信心也形成一定抑制。

今年上半年以来，国内经济复苏力度总体上低于年初预期。二季度以来，PPI、CPI 等价格指数不断走低，企业和居民的投资消费信心不足。上半年个税增速相比 2022 年下降，反映中产收入增长减缓，对服务业的需求也形成制约。因此，财政政策虽有余力，但也不在最佳发力时点。上半年汇率和权益市场的估值都出现调整，而权益市场估值隐含的悲观预期更加充分。

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-12.95%，同期业绩比较基准收益率为 1.26%；基金 C 类份额净值增长率为-13.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对中国制造业长期发展我们并不悲观。从商业的角度，中国制造业的成本优势难以颠覆，一个国家的市场若对此拒绝，除了需要长期的财政补贴外，还需要被扶持的供应商对其政策的连续性、货币的长期价值有长期信心，愿意投资扩产予以配合，而这几个条件只要有一项不满足，当前情况就会出现逆转，进入负向循环，届时中国的汇率、权益市场估值也将得以修复，企业和员工的收入空间打开，员工消费信心增强，国内财政政策也将迎来合适的发力时机。

制造业中，组合重点持有具备全球技术、成本领先优势的优质制造企业。当前估值中，对于国内竞争加剧，海外市场拓展困难的悲观预期已较为充分，海外竞争对手的市盈率普遍是国内公司的数倍。随着时间推移，这些公司的全球竞争力将不断提升，意味着海外拒绝中国公司的成本将越来越高。将所有资产进行对比，在当前的估值水平下，我相信这类资产依然是中国最有价值的资产之一。

服务业中，我管理的可以投资港股的产品重点增持了零售渠道品牌公司。中国存在大量优质食品制造工厂，生产出的产品无法低成本触达消费者。很多年销售额 20 亿以下的品类，往往需要付出 20%以上的销售费用。如果存在一个可以把消费者和供应商的利益置于首位的渠道品牌，

充分获得消费者的信任，便可以将众多腰部优质商品以更低成本介绍给消费者，为零售行业做出贡献。

周期行业中，组合重点持有投资意愿不足，新增供给有限的有色行业。未来随着中国经济、需求从底部回升，工业金属价格受限于有限供给和较低库存，可能存在上行空间。当前组合的行业分布在有色、新能源汽车产业链、军工、电子、医药以及出口制造业当中的优质公司。未来将根据不同公司的估值变化动态调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,034,771.70	112,101,627.20
结算备付金		36,453,525.73	1,418,073.64
存出保证金		4,958,754.59	1,373,158.86
交易性金融资产	6.4.7.2	3,844,963,605.17	5,169,050,498.24
其中：股票投资		3,642,937,351.60	4,918,054,479.25
基金投资		-	-
债券投资		202,026,253.57	250,996,018.99
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		12,140,130.12	-
应收股利		5,476,765.95	-
应收申购款		142,306.85	276,495.11

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,908,169,860.11	5,284,219,853.05
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		38,901,823.72	280.76
应付赎回款		1,238,905.90	3,116,323.89
应付管理人报酬		4,796,929.38	6,819,641.37
应付托管费		799,488.21	1,136,606.91
应付销售服务费		766,520.39	1,112,745.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	34.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,177,445.53	3,727,235.78
负债合计		48,681,113.13	15,912,868.13
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	4,621,566,989.42	5,484,894,509.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-762,078,242.44	-216,587,524.74
净资产合计		3,859,488,746.98	5,268,306,984.92
负债和净资产总计		3,908,169,860.11	5,284,219,853.05

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,621,566,989.42 份，其中下属 A 基金份额净值为人民币 0.8388 元，基金份额总额 3,226,119,618.67 份；下属 C 基金份额净值为人民币 0.8267 元，基金份额总额 1,395,447,370.75 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-531,157,324.16	-662,355,135.90
1. 利息收入		288,252.63	332,756.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	288,252.63	332,756.50
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-133,266,477.84	59,299,237.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-178,813,127.83	23,787,295.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,712,138.50	2,191,300.28
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	6,137,279.44	-
股利收益	6.4.7.14	34,697,232.05	33,320,642.06
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	-398,179,098.95	-721,987,130.25
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	-	-
减：二、营业总支出		45,410,557.69	55,200,589.86
1. 管理人报酬		34,065,525.24	41,263,249.23
2. 托管费		5,677,587.50	6,877,208.23
3. 销售服务费		5,485,725.41	6,910,715.94
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		22,274.48	-
8. 其他费用	6.4.7.18	159,445.06	149,416.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-576,567,881.85	-717,555,725.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-576,567,881.85	-717,555,725.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-576,567,881.85	-717,555,725.76
----------	--	-----------------	-----------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金

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）	5,484,894,509.66	-	-216,587,524.74	5,268,306,984.92
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）	5,484,894,509.66	-	-216,587,524.74	5,268,306,984.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-863,327,520.24	-	-545,490,717.70	-1,408,818,237.94
（一）、综合收益总额	-	-	-576,567,881.85	-576,567,881.85
（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）	-863,327,520.24	-	31,077,164.15	-832,250,356.09
其中：1. 基金申购款	55,155,049.71	-	-4,920,567.66	50,234,482.05
2. 基金赎回款	-918,482,569.95	-	35,997,731.81	-882,484,838.14
（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)	4,621,566,989.42	-	-762,078,242.44	3,859,488,746.98
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)	5,603,706,494.03	-	729,528,164.73	6,333,234,658.76
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)	5,603,706,494.03	-	729,528,164.73	6,333,234,658.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	382,502,502.65	-	-713,635,593.15	-331,133,090.50
(一)、综合收益总额	-	-	-717,555,725.76	-717,555,725.76
(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)	382,502,502.65	-	3,920,132.61	386,422,635.26
其中: 1. 基金申购款	382,502,502.65	-	3,920,132.61	386,422,635.26
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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）	5,986,208,996.68	-	15,892,571.58	6,002,101,568.26
-----------------	------------------	---	---------------	------------------

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：

<u>刘建平</u>	<u>杨毅</u>	<u>王音然</u>
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

中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金（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[2021]2448 号文《关于准予中欧新兴价值一年持有期混合型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《中欧新兴价值一年持有期混合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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,308,294,690.94 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 61362990_B30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,308,938,706.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 644,015.15 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 3,582,918,948.75 份，包含认购资金利息折合 470,480.22 份；C 类基金的基金份额总额为 1,726,019,757.34 份，包含认购资金利息折合 173,534.93 份。本基金的基金管理人与注册登记机构为中欧基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（投资于港股

通标的股票不超过股票资产的 50%)。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,保持现金(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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+银行活期存款利率(税后) ×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	4,034,771.70
等于：本金	4,033,024.07
加：应计利息	1,747.63
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	4,034,771.70

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	4,285,744,563.79	-	3,642,937,351.60	-642,807,212.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	49,670,431.00	956,438.65	50,571,048.65	-55,821.00
	银行间市场	149,848,950.00	1,185,204.92	151,455,204.92	421,050.00
	合计	199,519,381.00	2,141,643.57	202,026,253.57	365,229.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,485,263,944.79	2,141,643.57	3,844,963,605.17	-642,441,983.19

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,068,349.59
其中：交易所市场	2,068,349.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	49,588.57
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	2,177,445.53

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧新兴价值一年持有混合 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	3,796,267,065.04	3,796,267,065.04
本期申购	39,960,843.06	39,960,843.06
本期赎回（以“-”号填列）	-610,108,289.43	-610,108,289.43
本期末	3,226,119,618.67	3,226,119,618.67

中欧新兴价值一年持有混合 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	1,688,627,444.62	1,688,627,444.62
本期申购	15,194,206.65	15,194,206.65
本期赎回（以“-”号填列）	-308,374,280.52	-308,374,280.52
本期末	1,395,447,370.75	1,395,447,370.75

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

中欧新兴价值一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,728,568.41	-127,363,209.07	-138,091,777.48
本期利润	-121,050,359.45	-279,017,451.24	-400,067,810.69
本期基金份额交易产生的变动数	3,344,611.41	14,624,641.91	17,969,253.32
其中：基金申购款	-618,616.76	-2,947,003.54	-3,565,620.30
基金赎回款	3,963,228.17	17,571,645.45	21,534,873.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-128,434,316.45	-391,756,018.40	-520,190,334.85

中欧新兴价值一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,919,393.20	-56,576,354.06	-78,495,747.26
本期利润	-57,338,423.45	-119,161,647.71	-176,500,071.16
本期基金份额交易产生的变动数	5,134,863.79	7,973,047.04	13,107,910.83
其中：基金申购款	-396,760.34	-958,187.02	-1,354,947.36
基金赎回款	5,531,624.13	8,931,234.06	14,462,858.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-74,122,952.86	-167,764,954.73	-241,887,907.59

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	89,634.65
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	183,292.81	
其他	15,325.17	
合计	288,252.63	

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	4,176,364,569.32
减：卖出股票成本总额	4,343,499,362.46
减：交易费用	11,678,334.69
买卖股票差价收入	-178,813,127.83

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,141,055.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,571,083.04
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	4,712,138.50

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	209,311,500.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	204,996,099.00
减：应计利息总额	1,742,852.51
减：交易费用	1,465.65
买卖债券差价收入	2,571,083.04

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	6,137,279.44

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	34,697,232.05
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	34,697,232.05

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	-398,179,098.95
股票投资	-396,789,435.55
债券投资	-1,389,663.40
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	-398,179,098.95

6.4.7.16 其他收入

无。

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

账户维护费	9,000.00
证券组合费	41,349.12
合计	159,445.06

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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
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
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

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	34,065,525.24	41,263,249.23
其中：支付销售机构的客户维护费	15,670,605.99	18,495,708.33

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

2、基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	5,677,587.50	6,877,208.23

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

2、基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基

金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	中欧新兴价值一年持有混合 A	中欧新兴价值一年持有混合 C	合计
平安银行	-	4,650,958.08	4,650,958.08
国都证券	-	18,155.32	18,155.32
中欧基金	-	0.00	0.00
中欧财富	-	4,806.84	4,806.84
合计	-	4,673,920.24	4,673,920.24
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		
	中欧新兴价值一年持有混合 A	中欧新兴价值一年持有混合 C	合计
平安银行	-	5,825,974.52	5,825,974.52
国都证券	-	33,861.12	33,861.12
中欧基金	-	4,325.46	4,325.46
合计	-	5,864,161.10	5,864,161.10

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费率为 0.80%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 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 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。如遇法定节假日、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

中欧新兴价值一年持有混合 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	9,816,301.77	0.30%	98,881.19	0.00%

注：1、上年度末，自然人股东持有的本基金 A 类份额占 A 类基金总份额比例为 0.0026%，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。

3、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
平安银行股份有限公司	4,034,771.70	89,634.65	145,595,807.77	183,617.24

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

				限						
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
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	-
301210	金杨	2023年6	6个月	新股	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-

	股份	月 21 日		流通受限						
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	3,121	96,282.85	73,749.23	-
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	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
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	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
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	2023年1	6个月	新股	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

	股份	月 12 日		流通受限						
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	-
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	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

				受限						
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	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
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	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
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	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-

	技	日		上市						
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	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601133	柏诚系统股份有限公司	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	江苏常青树科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	浙江万	2023年4月28日	6个月	新股流	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

	丰股份	日		通受限						
688146	中船派瑞特气	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	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯阳光电力	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
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	用友汽车信息科技	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	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-

				受限						
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	慧智微电子	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	航天环宇科技	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	日联科技股份	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	华海诚科新材料	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	-

688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	限 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	安杰思医学	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	安凯微电子	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 受 限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	四	2023	6个月	新	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

	川 华 丰 科 技	年 6 月 16 日		股 流 通 受 限						
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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。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于约定开放日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于开放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发行的证券不得超过该证券的 10%。在开放期，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	4,034,771.70	-	-	-	4,034,771.70
结算备付金	36,453,525.73	-	-	-	36,453,525.73
存出保证金	4,958,754.59	-	-	-	4,958,754.59
交易性金融资产	202,026,253.57	-	-	-3,642,937,351.60	3,844,963,605.17
应收股利	-	-	-	5,476,765.95	5,476,765.95
应收申购款	-	-	-	142,306.85	142,306.85

应收清算款	-	-	-	12,140,130.12	12,140,130.12
资产总计	247,473,305.59	-	-	-3,660,696,554.52	3,908,169,860.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,238,905.90	1,238,905.90
应付管理人报酬	-	-	-	4,796,929.38	4,796,929.38
应付托管费	-	-	-	799,488.21	799,488.21
应付清算款	-	-	-	38,901,823.72	38,901,823.72
应付销售服务费	-	-	-	766,520.39	766,520.39
其他负债	-	-	-	2,177,445.53	2,177,445.53
负债总计	-	-	-	48,681,113.13	48,681,113.13
利率敏感度缺口	247,473,305.59	-	-	-3,612,015,441.39	3,859,488,746.98
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	112,101,627.20	-	-	-	112,101,627.20
结算备付金	1,418,073.64	-	-	-	1,418,073.64
存出保证金	1,373,158.86	-	-	-	1,373,158.86
交易性金融资产	244,447,133.53	-	6,548,885.46	4,918,054,479.25	5,169,050,498.24
应收申购款	-	-	-	276,495.11	276,495.11
资产总计	359,339,993.23	-	6,548,885.46	4,918,330,974.36	5,284,219,853.05
负债					
应付清算款	-	-	-	280.76	280.76
应付赎回款	-	-	-	3,116,323.89	3,116,323.89
应付管理人报酬	-	-	-	6,819,641.37	6,819,641.37
应付托管费	-	-	-	1,136,606.91	1,136,606.91
应付销售服务费	-	-	-	1,112,745.39	1,112,745.39
应交税费	-	-	-	34.03	34.03
其他负债	-	-	-	3,727,235.78	3,727,235.78
负债总计	-	-	-	15,912,868.13	15,912,868.13
利率敏感度缺口	359,339,993.23	-	6,548,885.46	4,902,418,106.23	5,268,306,984.92

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 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 5.23%（2022 年 12 月 31 日：4.76%），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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理

人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	766,433,362.71	-	766,433,362.71
应收股利	-	5,476,765.95	-	5,476,765.95
资产合计	-	771,910,128.66	-	771,910,128.66
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	771,910,128.66	-	771,910,128.66
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,280,279,450.81	-	1,280,279,450.81
资产合计	-	1,280,279,450.81	-	1,280,279,450.81
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	1,280,279,450.81	-	1,280,279,450.81

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	港币相对人民币贬值 5%		-38,321,668.14
港币相对人民币升值 5%		38,321,668.14	64,013,972.54

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	3,642,937,351.60	94.39	4,918,054,479.25	93.35
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	3,642,937,351.60	94.39	4,918,054,479.25	93.35

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%	211,455,527.31	395,782,708.74
	业绩比较基准下降 5%	-211,455,527.31	-395,782,708.74

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	3,640,339,191.84	4,881,710,439.50
第二层次	202,711,038.71	244,453,367.29
第三层次	1,913,374.62	42,886,691.45
合计	3,844,963,605.17	5,169,050,498.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，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	3,642,937,351.60	93.21
	其中：股票	3,642,937,351.60	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	202,026,253.57	5.17
	其中：债券	202,026,253.57	5.17
	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	40,488,297.43	1.04
8	其他各项资产	22,717,957.51	0.58
9	合计	3,908,169,860.11	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 766,433,362.71 元，占基金资产净值比例 19.86%。

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	-	-
B	采矿业	168,550,753.81	4.37
C	制造业	2,628,890,416.25	68.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	386,351.25	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	29,465,305.20	0.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	5,078,634.38	0.13

业			
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	43,903,267.93	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	86,096.49	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	85,098.56	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,101.40	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,876,503,988.89	74.53

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	310,138,213.94	8.04
消费者非必需品	353,778,224.14	9.17
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	27,274,602.43	0.71
工业	-	-
信息技术	29,725,778.46	0.77
电信服务	32,651,811.06	0.85
公用事业	-	-
地产业	12,864,732.68	0.33
合计	766,433,362.71	19.86

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300750	宁德时代	1,692,540	387,236,226.60	10.03
2	02899	紫金矿业	23,736,000	251,667,348.72	6.52
2	601899	紫金矿业	11,310,713	128,602,806.81	3.33
3	300014	亿纬锂能	5,905,058	357,256,009.00	9.26
4	01797	东方甄选	14,423,000	339,091,797.27	8.79
5	603678	火炬电子	9,389,739	323,570,405.94	8.38
6	002180	纳思达	7,842,051	268,590,246.75	6.96
7	002812	恩捷股份	1,795,797	173,025,040.95	4.48
8	002984	森麒麟	5,392,680	169,653,712.80	4.40
9	000933	神火股份	12,181,464	158,359,032.00	4.10

10	603876	鼎胜新材	7,238,700	138,910,653.00	3.60
11	03993	洛阳钼业	15,468,000	58,470,865.22	1.51
11	603993	洛阳钼业	7,315,100	38,989,483.00	1.01
12	688198	佰仁医疗	655,335	69,537,596.85	1.80
13	600522	中天科技	4,337,300	69,006,443.00	1.79
14	002832	比音勒芬	1,828,565	64,749,486.65	1.68
15	300568	星源材质	3,282,500	56,426,175.00	1.46
16	603267	鸿远电子	796,532	52,013,539.60	1.35
17	688518	联赢激光	1,807,010	50,343,298.60	1.30
18	002384	东山精密	1,858,171	48,126,628.90	1.25
19	603326	我乐家居	5,975,743	46,670,552.83	1.21
20	688621	阳光诺和	745,185	43,831,781.70	1.14
21	00700	腾讯控股	106,800	32,651,811.06	0.85
22	688122	西部超导	548,031	30,541,767.63	0.79
23	01385	上海复旦	1,674,000	29,725,778.46	0.77
24	300138	晨光生物	1,648,500	29,508,150.00	0.76
25	603565	中谷物流	2,728,269	29,465,305.20	0.76
26	688636	智明达	514,138	28,277,590.00	0.73
27	01093	石药集团	4,344,000	27,274,602.43	0.71
28	300656	民德电子	697,751	21,727,966.14	0.56
29	000425	徐工机械	2,909,390	19,696,570.30	0.51
30	300382	斯莱克	1,200,400	15,833,276.00	0.41
31	02313	申洲国际	213,100	14,686,426.87	0.38
32	03900	绿城中国	1,777,500	12,864,732.68	0.33
33	300037	新宙邦	174,652	9,062,692.28	0.23
34	600276	恒瑞医药	168,511	8,071,676.90	0.21
35	600031	三一重工	463,300	7,704,679.00	0.20
36	300679	电连技术	212,235	7,014,366.75	0.18
37	688188	柏楚电子	25,105	4,733,798.80	0.12
38	002318	久立特材	266,400	4,536,792.00	0.12
39	301328	维峰电子	58,186	3,313,110.84	0.09
40	601968	宝钢包装	238,300	1,715,760.00	0.04
41	000733	振华科技	13,843	1,326,851.55	0.03
42	688271	联影医疗	7,365	1,016,443.65	0.03
43	688172	燕东微	40,177	955,409.06	0.02
44	600765	中航重机	30,100	797,951.00	0.02
45	600985	淮北矿业	42,400	488,448.00	0.01
46	601699	潞安环能	28,800	470,016.00	0.01
47	688176	亚虹医药	37,990	444,103.10	0.01
48	600546	山煤国际	20,900	302,423.00	0.01
49	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
50	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
51	000683	远兴能源	30,051	216,066.69	0.01

52	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.01
53	600984	建设机械	32,630	147,487.60	0.00
54	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
55	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
56	600761	安徽合力	6,500	129,545.00	0.00
57	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
58	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
59	688252	天德钰	5,201	105,528.29	0.00
60	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
61	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
62	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
63	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
64	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
65	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
66	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
67	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.00
68	603601	再升科技	15,095	64,455.65	0.00
69	301267	华夏眼科	1,006	61,315.70	0.00
70	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
71	002236	大华股份	2,426	47,913.50	0.00
72	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
73	002935	天奥电子	2,292	45,335.76	0.00
74	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
75	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
76	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
77	301266	宇邦新材	517	36,350.27	0.00
78	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
79	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
80	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.00
81	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
82	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
83	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
84	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
85	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
86	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
87	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
88	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
89	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
90	301302	华如科技	699	25,723.20	0.00
91	301327	华宝新能	315	24,919.65	0.00
92	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
93	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
94	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00

95	301389	隆扬电子	1,269	23,070.42	0.00
96	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
97	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
98	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
99	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
100	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
101	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
102	301366	一博科技	482	20,942.90	0.00
103	300762	上海瀚讯	1,760	20,715.20	0.00
104	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
105	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
106	601965	中国汽研	900	18,585.00	0.00
107	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
108	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
109	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
110	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
111	001301	尚太科技	300	16,893.00	0.00
112	300792	壹网壹创	600	16,542.00	0.00
113	301139	元道通信	566	16,351.74	0.00
114	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
115	301115	建科股份	685	15,659.10	0.00
116	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
117	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
118	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
119	301280	珠城科技	418	14,947.68	0.00
120	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
121	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
122	301112	信邦智能	399	14,607.39	0.00
123	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
124	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
125	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
126	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
127	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
128	301160	翔楼新材	392	13,778.80	0.00
129	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
130	301349	信德新材	270	13,537.80	0.00
131	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
132	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
133	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
134	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
135	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
136	301277	新天地	658	12,837.58	0.00
137	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00

138	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
139	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
140	002415	海康威视	357	11,820.27	0.00
141	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
142	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
143	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
144	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
145	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
146	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
147	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
148	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
149	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
150	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
151	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
152	002837	英维克	325	9,730.50	0.00
153	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
154	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
155	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
156	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
157	301197	工大科雅	380	9,158.00	0.00
158	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
159	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
160	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
161	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
162	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
163	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
164	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
165	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
166	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
167	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
168	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
169	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
170	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
171	002777	久远银海	220	7,803.40	0.00
172	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
173	300674	宇信科技	400	7,072.00	0.00
174	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
175	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
176	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
177	301233	盛帮股份	158	6,836.66	0.00
178	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
179	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
180	300850	新强联	117	4,373.46	0.00

181	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
182	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
183	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
184	603096	新经典	140	2,850.40	0.00
185	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
186	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
187	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
188	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
189	600426	华鲁恒升	40	1,225.20	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	01797	东方甄选	546,722,543.42	10.38
2	300750	宁德时代	503,634,066.41	9.56
3	601899	紫金矿业	232,634,314.03	4.42
3	02899	紫金矿业	211,003,286.45	4.01
4	002812	恩捷股份	191,493,460.84	3.63
5	603259	药明康德	133,391,446.27	2.53
5	02359	药明康德	30,328,901.89	0.58
6	300014	亿纬锂能	162,937,125.44	3.09
7	03993	洛阳钼业	61,258,562.23	1.16
7	603993	洛阳钼业	56,959,719.00	1.08
8	000733	振华科技	100,428,840.41	1.91
9	002180	纳思达	99,890,305.46	1.90
10	300568	星源材质	87,629,035.14	1.66
11	000425	徐工机械	69,113,873.55	1.31
12	600522	中天科技	68,131,178.00	1.29
13	000933	神火股份	57,371,124.16	1.09
14	688518	联赢激光	56,313,209.54	1.07
15	00883	中国海洋石油	51,823,488.52	0.98
16	600765	中航重机	47,953,542.40	0.91
17	688122	西部超导	42,742,803.49	0.81
18	01385	上海复旦	39,646,794.35	0.75
19	002384	东山精密	39,231,370.21	0.74
20	603876	鼎胜新材	36,881,446.32	0.70

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	02899	紫金矿业	303,962,559.22	5.77
1	601899	紫金矿业	107,952,848.77	2.05
2	01171	兖矿能源	322,850,067.05	6.13
2	600188	兖矿能源	9,837,092.00	0.19
3	01093	石药集团	279,062,959.73	5.30
4	600276	恒瑞医药	275,850,941.08	5.24
5	000733	振华科技	248,116,625.53	4.71
6	603267	鸿远电子	178,942,525.38	3.40
7	603259	药明康德	136,922,260.34	2.60
7	02359	药明康德	29,223,029.01	0.55
8	300014	亿纬锂能	154,403,017.52	2.93
9	002384	东山精密	130,472,976.22	2.48
10	300750	宁德时代	122,045,680.60	2.32
11	01797	东方甄选	104,147,400.72	1.98
12	03900	绿城中国	92,129,173.48	1.75
13	600309	万华化学	90,592,595.91	1.72
14	601968	宝钢包装	75,865,075.00	1.44
15	600426	华鲁恒升	72,654,559.77	1.38
16	00826	天工国际	70,005,271.35	1.33
17	01548	金斯瑞生物科技	69,829,240.26	1.33
18	00883	中国海洋石油	63,462,375.30	1.20
19	603876	鼎胜新材	62,099,730.97	1.18
20	03808	中国重汽	59,005,182.01	1.12

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	3,465,171,670.36
卖出股票收入（成交）总额	4,176,364,569.32

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	48,081,977.09	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	153,944,276.48	3.99
	其中：政策性金融债	153,944,276.48	3.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	202,026,253.57	5.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230201	23 国开 01	1,500,000	151,455,204.92	3.92
2	019679	22 国债 14	294,000	29,928,579.78	0.78
3	019638	20 国债 09	108,000	11,053,101.70	0.29
4	019694	23 国债 01	45,000	4,549,933.97	0.12
5	019663	21 国债 15	25,000	2,550,361.64	0.07

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，以套期保值为目的，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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，河南神火煤电股份有限公司在报告编制日

前一年内曾受到永城市水利局的处罚。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	4,958,754.59
2	应收清算款	12,140,130.12
3	应收股利	5,476,765.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	142,306.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,717,957.51

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
中欧新兴价值一年	33,728	95,651.08	177,887,641.90	5.51%	3,048,231,976.77	94.49%

持有混合 A						
中欧新兴价值一年持有混合 C	66,699	20,921.56	2,000,466.67	0.14%	1,393,446,904.08	99.86%
合计	100,427	46,019.17	179,888,108.57	3.89%	4,441,678,880.85	96.11%

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	中欧新兴价值一年持有混合 A	11,145,926.00	0.35%
	中欧新兴价值一年持有混合 C	31,004.43	0.00%
	合计	11,176,930.43	0.24%

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 0.0022%，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	中欧新兴价值一年持有混合 A	0~10
	中欧新兴价值一年持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧新兴价值一年持有混合 A	>100
	中欧新兴价值一年持有混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧新兴价值一年持有混合 A	中欧新兴价值一年持有混合 C
基金合同生效日 (2021 年 9 月 6 日) 基金份额总额	3,582,918,948.75	1,726,019,757.34
本报告期期初基金份额总额	3,796,267,065.04	1,688,627,444.62
本报告期基金总申购份额	39,960,843.06	15,194,206.65
减：本报告期基金总	610,108,289.43	308,374,280.52

赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,226,119,618.67	1,395,447,370.75

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 (%)	
兴业证券	1	3,997,082,78 3.22	52.43	2,481,102.13	49.60	-
浙商证券	1	1,534,361,65 4.08	20.13	1,122,086.54	22.43	-
国泰君安	1	1,018,225,43 8.56	13.36	744,636.45	14.88	-
华鑫证券	1	978,165,724. 33	12.83	584,627.08	11.69	本报告期新增 1 个
财通证券	1	96,067,670.4 7	1.26	70,254.21	1.40	本报告期新增 1 个
中信建投	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 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	4,516,752.1 2	31.72	-	-	-	-
国泰君安	9,723,854.6 3	68.28	-	-	-	-
华鑫证	-	-	-	-	-	-

券						
财通证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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	中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金 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	中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金 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	中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金 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	中欧新兴价值一年持有期混合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、中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》

- 3、《中欧新兴价值一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧新兴价值一年持有期混合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)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