

中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) 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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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 | 6 |
| 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 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| § 7 投资组合报告 | 51 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 51 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 51 |
| 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 | 52 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 55 |
| 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 | 57 |

| | |
|--|-----------|
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 57 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 57 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 57 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 58 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 58 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 58 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 59 |
| 8.4 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..... | 59 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 59 |
| § 10 重大事件揭示 | 60 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 60 |
| 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..... | 60 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 60 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 60 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 60 |
| 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..... | 60 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 60 |
| 10.8 其他重大事件..... | 62 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| 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 | 62 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 62 |
| § 12 备查文件目录 | 62 |
| 12.1 备查文件目录..... | 62 |
| 12.2 存放地点..... | 63 |
| 12.3 查阅方式..... | 63 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|---------------------|-----------------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) | | |
| 基金简称 | 中欧盛世成长混合 (LOF) | | |
| 基金主代码 | 166011 | | |
| 基金运作方式 | 契约型上市开放式 (LOF) | | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 3 月 29 日 | | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 广发银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份 额总额 | 337,222,007.09 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 基金份额上市的 证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 上市日期 | 2015 年 4 月 21 日 | | |
| 下属分级基金的基 金简称 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 中欧盛世成长混合 (LOF) E |
| 下属分级基金的场 内简称 | 中欧盛世 LOF | - | - |
| 下属分级基金的交 易代码 | 166011 | 004233 | 001888 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 303,047,476.43 份 | 23,035,045.77 份 | 11,139,484.89 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25% |

| | |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金 |
|--------|--|

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 | 广发银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 黎忆海 |
| | 联系电话 | 021-68609600 |
| | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com |
| 客户服务电话 | 021-68609700、400-700-9700 | 4008308003 |
| 传真 | 021-33830351 | 010-65169555 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层 | 广东省广州市越秀区东风东路 713 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 | 北京市东城区东长安街甲 2 号 广发银行大厦 |
| 邮政编码 | 200120 | 100053 |
| 法定代表人 | 窦玉明 | 王凯 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.zofund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--|--|
| 注册登记机构 | A 类：中国证券登记结算有限责任公司 C 类、E 类：中欧基金管理有限公司 | A 类：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类、E 类：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 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | | |
|----------|-------------------------------------|------------------|------------------|
| 数据和指标 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 中欧盛世成长混合 (LOF) E |
| 本期已实现收益 | -33,642,209.43 | -3,033,734.82 | -1,328,340.47 |
| 本期利润 | 8,084,910.24 | -647,245.67 | -58,259.96 |
| 加权平均基 | 0.0287 | -0.0248 | -0.0050 |

| | | | |
|----------------------|------------------------|---------------|---------------|
| 金份额本期 利润 | | | |
| 本期加权平 均净值利润 率 | 1.49% | -1.34% | -0.26% |
| 本期基金份 额净值增长 率 | -0.16% | -0.56% | -0.17% |
| 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 | 458,317,506.99 | 33,007,303.42 | 11,376,081.71 |
| 期末可供分 配基金份额 利润 | 1.5124 | 1.4329 | 1.0212 |
| 期末基金资 产净值 | 609,944,043.76 | 44,452,390.95 | 22,515,566.60 |
| 期末基金份 额净值 | 2.0127 | 1.9298 | 2.0212 |
| 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 | 398.48% | 60.66% | 85.26% |

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

中欧盛世成长混合 (LOF) A

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

| | 率① | 准差② | | ④ | | |
|----------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去一个月 | 8.29% | 1.47% | 1.02% | 0.65% | 7.27% | 0.82% |
| 过去三个月 | 6.33% | 1.39% | -3.37% | 0.62% | 9.70% | 0.77% |
| 过去六个月 | -0.16% | 1.24% | 0.25% | 0.63% | -0.41% | 0.61% |
| 过去一年 | -12.04% | 1.73% | -9.74% | 0.74% | -2.30% | 0.99% |
| 过去三年 | 0.53% | 1.81% | -1.92% | 0.90% | 2.45% | 0.91% |
| 自基金合同生效起 至今 | 398.48% | 1.64% | 65.98% | 1.04% | 332.50% | 0.60% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。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。

中欧盛世成长混合 (LOF) 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 | 8.22% | 1.48% | 1.02% | 0.65% | 7.20% | 0.83% |
| 过去三个月 | 6.12% | 1.39% | -3.37% | 0.62% | 9.49% | 0.77% |
| 过去六个月 | -0.56% | 1.24% | 0.25% | 0.63% | -0.81% | 0.61% |
| 过去一年 | -12.74% | 1.73% | -9.74% | 0.74% | -3.00% | 0.99% |
| 过去三年 | -1.83% | 1.81% | -1.92% | 0.90% | 0.09% | 0.91% |
| 自基金份额运作日 至今 | 60.66% | 1.58% | 22.26% | 0.89% | 38.40% | 0.69% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。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。

中欧盛世成长混合 (LOF) E

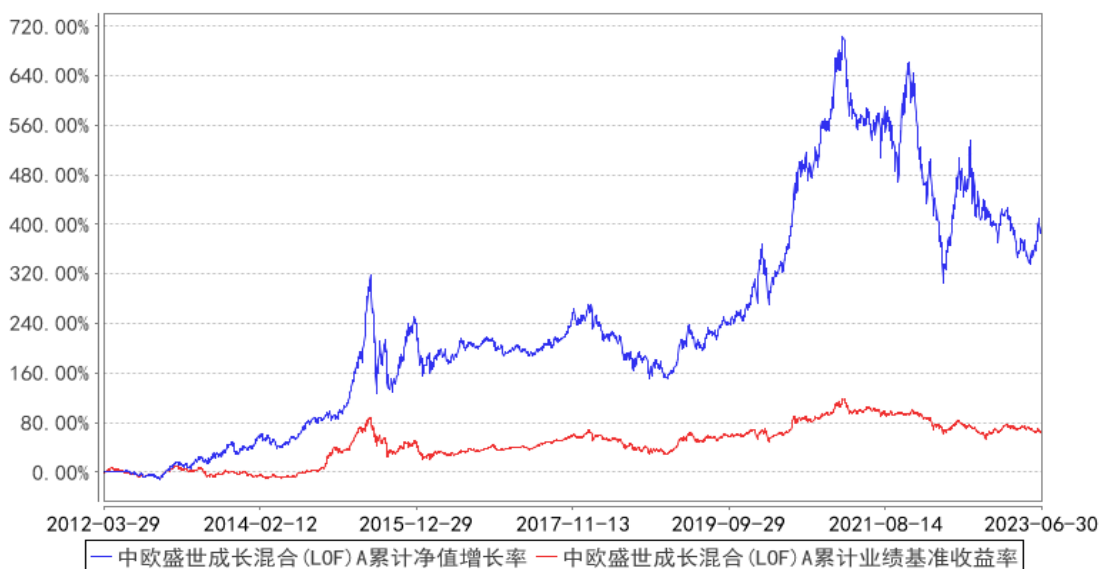
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 8.29% | 1.47% | 1.02% | 0.65% | 7.27% | 0.82% |
| 过去三个月 | 6.33% | 1.39% | -3.37% | 0.62% | 9.70% | 0.77% |
| 过去六个月 | -0.17% | 1.24% | 0.25% | 0.63% | -0.42% | 0.61% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | -12.05% | 1.73% | -9.74% | 0.74% | -2.31% | 0.99% |
| 过去三年 | 0.53% | 1.81% | -1.92% | 0.90% | 2.45% | 0.91% |
| 自基金份额运作日 至今 | 85.26% | 1.58% | 20.86% | 0.92% | 64.40% | 0.66% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%。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。

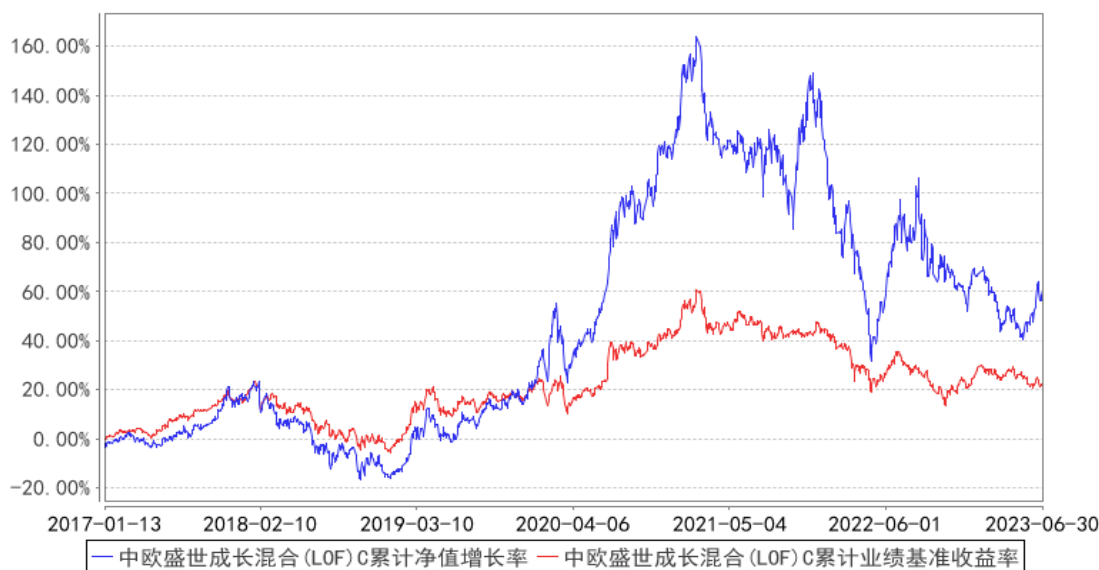
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧盛世成长混合 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



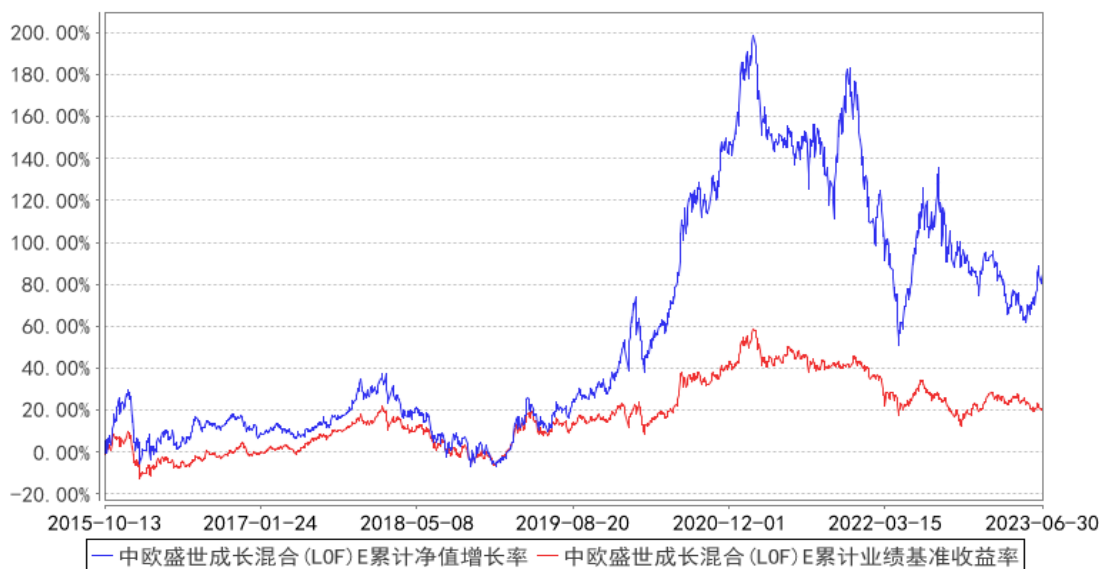
注：本基金转型日期为 2015 年 3 月 30 日。

中欧盛世成长混合 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2017 年 1 月 12 日新增 C 类份额，图示日期为 2017 年 1 月 13 日至 2023 年 06 月 30 日。

中欧盛世成长混合 (LOF) E 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2015 年 10 月 8 日新增 E 份额，图示日期为 2015 年 10 月 13 日至 2023 年 06 月 30 日。

§ 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 | | |
| 凌莉 | 基金经理助理 | 2017-03-23 | - | 15 年 | 2008-01-07 加入中欧基金管理有限公司，历任培训生、助理研究员、研究员、金融工程研究员兼风控专员、基金经理助理、基金经理、交易员。 |
| 张跃鹏 | 投资运营部副总监 / 基金经理 | 2022-12-16 | - | 13 年 | 历任上海永邦投资有限公司投资经理，上海涌泉亿信投资发展中心（有限合伙）策略分析师。2013-09-23 加入中欧基金管理有限公司，历任交易员。 |

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

上半年，国内宏观经济在一季度先经历了疫情政策转向后的脉冲式修复，然而由于“疤痕效应”的存在，进入二季度，国内经济动能开始呈现出环比逐渐趋弱的态势，同时受外需疲弱的影响，5、6 月单月出口增速（以美元计价）也分别快速下降至-7.5%、-12.4%。而另一方面，经济数据虽然呈现出一定的压力，政策层面却依旧保持着较强的定力，从而导致市场整体风险偏好边际有所下降，对经济复苏为代表的主线也逐步降低了期待。回顾上半年市场的表现，以万得全 A、沪深 300、科创创业 50、国证 1000 等不同风格的指数，整体均呈现出“倒 U 型”的走势，分别为 3.06%、-0.75%、-6.14%、-0.01%。而市场结构方面，与宏观经济周期相关性较强的资产同样呈现出“倒 U 型”的走势，而同时由于整体流动性依然维持偏宽松，具有一定产业发展事件驱动兼主题风格属性的，如人工智能相关的模型算力与应用、人型机器人等板块，以及部分带有避险风格的高股息资产，均表现出了较强的结构性机会。

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-0.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%；基金 C 类份额净值增长率为-0.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%；基金 E 类份额净值增长率为-0.17%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在 7 月下旬召开的政治局会议显示了中央高层对经济压力的确认，并释放出逆周期调节的稳增长积极信号，甚至包括提振资本市场信心相关的表述；而在海外方面，考虑到美联储加息也已大概率逐渐步入尾声，整体偏宽松的流动性环境依然有望维持。因此，此次政治局会议的积极表述或将带来资本市场整体风险偏好的修复，而对经济稳增长的具体措施，仍需要期待后续实际政策方案的推出与落地效果，同时结合宏观经济自身周期的经验规律推演，从库存周期角度也有望对宏观经济形成一定的支撑。经测算，A 股市场目前整体的风险溢价水平也处于历史均值两倍标准差的极值附近，显示其处于较强的性价比点位。

综合以上对海内外宏观策略环境与产业发展方面的跟踪分析，本基金组合依然维持较高的股

票仓位，并对组合结构进行了一定程度的调整与优化——小幅降低了与疫后复苏链相关的资产配置权重，积极增配了科技类相关的资产，包括人工智能领域中以光模块和服务器为代表的算力基础设施建设、办公软件和游戏为代表的人工智能应用；以及处于潜在周期景气拐点且国产化率持续提升逻辑下的部分半导体设备制造品种。在泛新能源相关板块方面，基于中期产业发展的视角我们依然对诸如储能、智能驾驶、电池材料新技术渗透等相关细分领域抱有坚定的信心。此外，考虑到生猪养殖板块目前的基本面情况也已大概率处于景气周期低位，将其作为本基金组合中的拐点性资产进行布局。而针对 7 月政治局会议的超预期表述，本基金组合也做出积极应对的调整，重新增配了经济顺周期相关的资产，以及受益于活跃资本市场相关的证券类资产。

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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、开放式基金份额变动、投资组合报告等数据真实、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：中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)

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 | 43,596,076.22 | 59,184,660.70 |
| 结算备付金 | | 332,259.76 | 1,021,432.75 |
| 存出保证金 | | 321,714.21 | 915,631.63 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 623,192,785.07 | 531,622,832.32 |
| 其中：股票投资 | | 623,192,785.07 | 531,622,832.32 |
| 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 | | 11,649,283.16 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 246,361.35 | 329,254.31 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 679,338,479.77 | 593,073,811.71 |
| 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 | | 618,736.70 | 15,606,890.89 |
| 应付赎回款 | | 310,860.98 | 353,498.71 |
| 应付管理人报酬 | | 811,652.09 | 726,830.88 |
| 应付托管费 | | 135,275.37 | 121,138.44 |
| 应付销售服务费 | | 29,346.60 | 36,016.61 |
| 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 | 520,606.72 | 1,888,065.30 |
| 负债合计 | | 2,426,478.46 | 18,732,440.83 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 142,815,361.80 | 122,692,405.07 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 534,096,639.51 | 451,648,965.81 |
| 净资产合计 | | 676,912,001.31 | 574,341,370.88 |
| 负债和净资产总计 | | 679,338,479.77 | 593,073,811.71 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 337,222,007.09 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 2.0127 元，基金份额总额 303,047,476.43 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.9298 元，基金份额总额 23,035,045.77 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 2.0212 元，基金份额总额 11,139,484.89 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)

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 | | 13,023,525.75 | -102,863,488.23 |
| 1. 利息收入 | | 175,489.63 | 255,554.41 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 175,489.63 | 215,142.86 |
| 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 | | - | 40,411.55 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -32,610,634.57 | -205,061,962.39 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -34,825,453.05 | -205,985,279.91 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | -219,265.55 |
| 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 | 2,214,818.48 | 1,142,583.07 |
| 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 | 45,383,689.33 | 101,653,270.23 |
| 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 | 74,981.36 | 289,649.52 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,644,121.14 | 5,560,496.58 |
| 1. 管理人报酬 | | 4,580,295.77 | 4,512,599.91 |
| 2. 托管费 | | 763,382.70 | 752,099.98 |
| 3. 销售服务费 | | 192,582.52 | 182,964.86 |
| 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 | | - | 12.28 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 107,860.15 | 112,819.55 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 7,379,404.61 | -108,423,984.81 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 7,379,404.61 | -108,423,984.81 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 7,379,404.61 | -108,423,984.81 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)

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） | 122,692,405.07 | - | 451,648,965.81 | 574,341,370.88 |
| 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） | 122,692,405.07 | - | 451,648,965.81 | 574,341,370.88 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 20,122,956.73 | - | 82,447,673.70 | 102,570,630.43 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 7,379,404.61 | 7,379,404.61 |
| （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） | 20,122,956.73 | - | 75,068,269.09 | 95,191,225.82 |
| 其中：1. 基金申购款 | 39,742,092.33 | - | 141,136,000.92 | 180,878,093.25 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -19,619,135.60 | - | -66,067,731.83 | -85,686,867.43 |
| (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) | 142,815,361.80 | - | 534,096,639.51 | 676,912,001.31 |
| 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) | 124,650,931.23 | - | 621,411,585.51 | 746,062,516.74 |
| 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) | 124,650,931.23 | - | 621,411,585.51 | 746,062,516.74 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 9,504,385.26 | - | -70,843,199.45 | -61,338,814.19 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -108,423,984.81 | -108,423,984.81 |
| (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) | 9,504,385.26 | - | 37,580,785.36 | 47,085,170.62 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 40,098,975.82 | - | 151,128,400.71 | 191,227,376.53 |
| 2. 基金赎回款 | -30,594,590.56 | - | -113,547,615.35 | -144,142,205.91 |
| (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） | 134,155,316.49 | - | 550,568,386.06 | 684,723,702.55 |

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

中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) (原名为中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF)，以下简称“本基金”)是由中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型而来。根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金为契约型开放式基金，基金分级运作期为 3 年。根据深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2015]114 号)，原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金于 2015 年 3 月 27 日进行基金份额权益登记，2015 年 3 月 30 日(基金转换日)，无需召开基金份额持有人大会，即可按照基金合同的约定转换为上市开放式基金 (LOF)。自 2015 年 3 月 31 日起，原基金转型为中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF)。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》以及中欧基金管理有限公司披露的《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的公告》，中欧盛世成长分级股票型证券投资基金 A(以下简称“原盛世 A”)份额和中欧盛世成长分级股票型证券投资基金 B(以下简称“原盛世 B”)份额的基金份额到期折算日(即 2015 年 3 月 30 日)日终，基金管理人将根据原盛世 A 和原盛世 B 基金份额折算比例将基金份额持有人到期折算日登记在册的两类基金份额折算为场内中欧盛世份额并不再分拆。折算后，场内、场外中盛世份额的份额净值均调整为 1.000 元，基金份额数相应增加或减少，其后中欧盛世成长分级股票型证券投资基金更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF)。无论基金份额持有人单独持有或同时持有原盛世 A 和原盛世 B，均

无需支付转换基金份额的费用。于 2015 年 3 月 30 日 (基金份额到期折算日) 日终, 原盛世 A 折算前份额数为 25,924,294.00 份, 折算比例为 1.19535616, 原盛世 B 折算前份额数为 25,924,295.00 份, 折算比例为 2.1104178, 中欧盛世场内份额折算前份额数为 25,099,360.00 份, 折算比例为 1.65288698, 折算后中欧盛世场内份额数为 127,186,262.00 份; 中欧盛世场外份额折算前份额数为 1,610,237,758.81 份, 折算比例为 1.65288698, 折算后中欧盛世场外份额数为 2,661,541,026.46 份。本基金管理人已根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》约定, 对原盛世 A、原盛世 B 的份额持有人的基金份额进行了计算, 并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上字[2015]第 141 号文审核同意, 本基金 95,071,720.00 份基金份额于 2015 年 4 月 21 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或在封闭期满按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 在封闭期满可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》, 中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF) 于 2015 年 7 月 17 日公告后更名为中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)。

根据本基金管理人中欧基金管理有限公司 2015 年 10 月 8 日《关于旗下部分开放式基金增加 E 类份额并相应修改基金合同的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自 2015 年 10 月 8 日起对本基金增加 E 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额, 新增的基金份额类别命名为 E 类基金份额。A 类基金份额的业务规则与现行规则相同; 新增 E 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司, 只接受场外申赎, 不参与上市交易。

根据基金管理人中欧基金管理有限公司 2017 年 1 月 12 日《关于旗下部分开放式基金增加基金增加 C 类份额、提高净值精度并相应修改基金合同的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自 2017 年 1 月 12 日起对本基金增加 C 类份额、提高净值精度至小数点后 4 位并相应修改基金合同。本基金原有的 A、E 类基金份额保持不变, 新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额。新增 C 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司, 只接受场外申赎, 不参与上市交易。A 类和 E 类基金份额在投资者申购时收取申购费, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费, C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

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》、《中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 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 | 43,596,076.22 |
| 等于：本金 | 43,587,778.14 |
| 加：应计利息 | 8,298.08 |
| 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 | 43,596,076.22 |

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 | 557,424,529.04 | - | 623,192,785.07 | 65,768,256.03 |
| 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 | 557,424,529.04 | - | 623,192,785.07 | 65,768,256.03 |

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 | 546.00 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 355,370.80 |
| 其中：交易所市场 | 355,370.80 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 其他 | 15,429.77 |
| 预提费用-审计费 | 89,752.78 |
| 预提费用-信息披露费 | 59,507.37 |
| 合计 | 520,606.72 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧盛世成长混合 (LOF) 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 | 246,409,272.48 | 99,502,780.46 |
| 本期申购 | 86,604,856.11 | 34,971,392.57 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -29,966,652.16 | -12,100,806.30 |
| 本期末 | 303,047,476.43 | 122,373,366.73 |

中欧盛世成长混合 (LOF) 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 | 27,273,116.15 | 11,014,049.47 |
| 本期申购 | 8,005,630.99 | 3,233,006.97 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -12,243,701.37 | -4,944,546.26 |
| 本期末 | 23,035,045.77 | 9,302,510.18 |

中欧盛世成长混合 (LOF) E

| 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 | 12,175,575.14 | 12,175,575.14 |
| 本期申购 | 1,537,692.79 | 1,537,692.79 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -2,573,783.04 | -2,573,783.04 |
| 本期末 | 11,139,484.89 | 11,139,484.89 |

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

2、截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 5,326,155.00 份，均为本

基金 A 类基金份额(2022 年 6 月 30 日: 深交所上市的基金份额为 5,461,127.00 份, 均为本基金 A 类基金份额), 托管在场外未上市交易的基金份额为 331,895,852.09 份, 其中本基金 A 类基金份额 297,721,321.43 份, 本基金 E 类基金份额 11,139,484.89 份, 本基金 C 类基金份额 23,035,045.77 份(2022 年 6 月 30 日: 托管在场外未上市交易的基金份额为 294,526,187.62 份, 其中本基金 A 类基金份额 247,252,745.03 份, 本基金 E 类基金份额 21,832,577.07 份, 本基金 C 类基金份额 25,440,865.52 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现本基金 A 类份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.8 未分配利润

单位: 人民币元

中欧盛世成长混合 (LOF) A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 400,850,941.87 | -3,589,466.81 | 397,261,475.06 |
| 本期利润 | -33,642,209.43 | 41,727,119.67 | 8,084,910.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 91,108,774.55 | -8,884,482.82 | 82,224,291.73 |
| 其中: 基金申购款 | 138,792,442.59 | -10,743,339.81 | 128,049,102.78 |
| 基金赎回款 | -47,683,668.04 | 1,858,856.99 | -45,824,811.05 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 458,317,506.99 | 29,253,170.04 | 487,570,677.03 |

中欧盛世成长混合 (LOF) C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 上年度末 | 42,277,061.60 | -364,091.80 | 41,912,969.80 |
| 本期利润 | -3,033,734.82 | 2,386,489.15 | -647,245.67 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,236,023.36 | 120,180.00 | -6,115,843.36 |
| 其中: 基金申购款 | 12,197,540.17 | -556,534.00 | 11,641,006.17 |
| 基金赎回款 | -18,433,563.53 | 676,714.00 | -17,756,849.53 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 33,007,303.42 | 2,142,577.35 | 35,149,880.77 |

中欧盛世成长混合 (LOF) E

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 14,954,585.81 | -2,480,064.86 | 12,474,520.95 |
| 本期利润 | -1,328,340.47 | 1,270,080.51 | -58,259.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,223,957.43 | 183,778.15 | -1,040,179.28 |
| 其中: 基金申购款 | 1,845,349.32 | -399,457.35 | 1,445,891.97 |
| 基金赎回款 | -3,069,306.75 | 583,235.50 | -2,486,071.25 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|---------------|---------------|---------------|
| 本期末 | 12,402,287.91 | -1,026,206.20 | 11,376,081.71 |
|-----|---------------|---------------|---------------|

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 | 153,160.53 | |
| 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 | 10,440.66 | |
| 其他 | 11,888.44 | |
| 合计 | 175,489.63 | |

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 | 478,028,629.81 | |
| 减：卖出股票成本总额 | 511,544,702.48 | |
| 减：交易费用 | 1,309,380.38 | |
| 买卖股票差价收入 | -34,825,453.05 | |

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 | 2,214,818.48 |
| 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 | 2,214,818.48 |

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 | 45,383,689.33 |
| 股票投资 | 45,383,689.33 |
| 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 | 45,383,689.33 |

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 | 73,998.59 |
| 基金转换费收入 | 982.77 |
| 合计 | 74,981.36 |

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 107,860.15 |

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 |
| 广发银行股份有限公司（“广发银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 国都证券股份有限公司（“国都证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 自然人股东 | 基金管理人的股东 |
| 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 |

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 | 26,859,126.42 | 2.63 | 116,021,172.68 | 3.68 |

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 (%) |
| 国都证券 | 19,641.66 | 2.63 | - | - |
| 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 | 108,051.86 | 4.64 | - | - |

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 | 4,580,295.77 | 4,512,599.91 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 1,744,386.91 | 1,622,106.02 |

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费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：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 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 | 763,382.70 | 752,099.98 |

注：支付基金托管人广发银行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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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 | | | |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 中欧盛世成长混合 (LOF) E | 合计 |
| 中欧财富 | - | 4,730.23 | - | 4,730.23 |
| 合计 | - | 4,730.23 | - | 4,730.23 |
| 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 | | | |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 中欧盛世成长混合 (LOF) E | 合计 |
| 中欧基金 | - | 10,301.85 | - | 10,301.85 |
| 合计 | - | 10,301.85 | - | 10,301.85 |

注：本基金 A 类、E 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%，销售服务费按照前一日 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基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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支付到指定账户。基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法

定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

中欧盛世成长混合 (LOF) 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 | 203,978.01 | 0.07% | 149,916.82 | 0.06% |

份额单位：份

中欧盛世成长混合 (LOF) 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 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |

份额单位：份

中欧盛世成长混合 (LOF) E

| 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 | 355,376.07 | 3.19% | 341,091.93 | 2.80% |

注：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 |
| 广发银行股份有限公司 | 43,596,076.22 | 153,160.53 | 58,077,108.05 | 184,501.08 |

注：本基金的银行存款由基金托管人广发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 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | | | | 限 | | | | | | |
| 001287 | 中电港 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02 | 715 | 8,494.20 | 15,029.30 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87 | 177 | 2,722.26 | 2,631.99 | - |
| 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 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023年5月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80 | 5,232.60 | - |
| 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 | 2023 | 6个月 | 新 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | 塑科技 | 年3月1日 | | 股流通受限 | | | | | | |
| 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 | 664 | 33,200.00 | 20,391.44 | - |
| 301260 | 格力博 | 2023年1月20日 | 6个月 | 新股流通 | 30.85 | 23.63 | 1,122 | 34,613.70 | 26,512.86 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 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 | - |
| 301305 | 朗坤 | 2023年5 | 6个月 | 新股 | 25.25 | 19.69 | 753 | 19,013.25 | 14,826.57 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| | 环境 | 月 15 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 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 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023 年 5 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通 | 76.80 | 107.95 | 332 | 25,497.60 | 35,839.40 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 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 | 213 | 15,644.85 | 9,934.32 | - |
| 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 | 699 | 16,615.23 | 29,980.11 | - |
| 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 | 2023年2月22日 | 6个月 | 新股流 | 16.24 | 16.95 | 879 | 14,274.96 | 14,899.05 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | 康 | 日 | | 通受限 | | | | | | |
| 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 | 721 | 14,412.79 | 12,184.90 | - |
| 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 | 4,023 | 231,966.18 | 231,966.18 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年6月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 447 | 25,774.02 | 25,774.02 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 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 | 豪恩汽电 | 2023年6月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.78 | 39.78 | 262 | 10,422.36 | 10,422.36 | - |
| 601061 | 中 | 2023 | 6个月 | 新 | 6.58 | 7.58 | 1,591 | 10,468.78 | 12,059.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | 信金属 | 年3月30日 | | 股流通受限 | | | | | | |
| 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 | 543 | 6,331.38 | 6,657.18 | - |
| 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 | 571 | 10,163.80 | 10,215.19 | - |
| 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 | 浙江万丰股份 | 2023年4月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.58 | 16.13 | 122 | 1,778.76 | 1,967.86 | - |
| 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 | 549 | 19,846.35 | 20,933.37 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 688249 | 晶合集成 | 2023年4月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.86 | 18.06 | 3,690 | 73,283.40 | 66,641.40 | - |
| 688307 | 中润光学 | 2023年2月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.88 | 31.73 | 2,455 | 58,625.40 | 77,897.15 | - |
| 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 | 顾中科技 | 2023年4月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.10 | 12.07 | 1,633 | 19,759.30 | 19,710.31 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.60 | 64.67 | 675 | 15,930.00 | 43,652.25 | - |
| 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 | 2023年6月 | 6个月 | 新股 | 37.88 | 29.49 | 1,101 | 41,705.88 | 32,468.49 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-----------------|------|--------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| | 金泰 | 月 13 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 688469 | 中芯集成 | 2023 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.69 | 5.41 | 6,590 | 37,497.10 | 35,651.90 | - |
| 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 | 2,532 | 28,105.20 | 43,145.28 | - |
| 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 | 568 | 22,714.32 | 20,851.28 | - |
| 688502 | 茂莱光学 | 2023 年 2 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 69.72 | 178.59 | 1,509 | 105,207.48 | 269,492.31 | - |
| 688507 | 索 | 2023 | 6 个月 | 新 | 165.41 | 122.11 | 144 | 23,819.32 | 17,583.84 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|---------|------------|-----|--------|--------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| | 辰科技 | 年4月10日 | | 股流通受限 | | | | | | |
| 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 | 168 | 25,599.84 | 22,842.96 | - |
| 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 | 878 | 18,587.26 | 20,633.00 | - |
| 688562 | 航天 | 2023年5 | 6个月 | 新股 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205.68 | 16,197.06 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-------|-----------------|------|--------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | 软件股份 | 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 | 696 | 21,060.96 | 17,629.68 | - |
| 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 | 160 | 20,128.00 | 18,884.80 | - |
| 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 | 125.88 | 86.79 | 166 | 20,896.08 | 14,407.14 | - |

| | | | | 受限 | | | | | | |
|--------|--------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| 688629 | 四川华丰科技 | 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。本基金把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。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和反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例

要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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 | 43,596,076.22 | - | - | - | 43,596,076.22 |
| 结算备付金 | 332,259.76 | - | - | - | 332,259.76 |
| 存出保证金 | 321,714.21 | - | - | - | 321,714.21 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -623,192,785.07 | 623,192,785.07 |
| 应收申购款 | - | - | - | 246,361.35 | 246,361.35 |
| 应收清算款 | - | - | - | 11,649,283.16 | 11,649,283.16 |
| 资产总计 | 44,250,050.19 | - | - | -635,088,429.58 | 679,338,479.77 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 310,860.98 | 310,860.98 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 811,652.09 | 811,652.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | 135,275.37 | 135,275.37 |
| 应付清算款 | - | - | - | 618,736.70 | 618,736.70 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 29,346.60 | 29,346.60 |
| 其他负债 | - | - | - | 520,606.72 | 520,606.72 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,426,478.46 | 2,426,478.46 |
| 利率敏感度缺口 | 44,250,050.19 | - | - | -632,661,951.12 | 676,912,001.31 |
| 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 | 59,184,660.70 | - | - | - | 59,184,660.70 |
| 结算备付金 | 1,021,432.75 | - | - | - | 1,021,432.75 |
| 存出保证金 | 915,631.63 | - | - | - | 915,631.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -531,622,832.32 | 531,622,832.32 |
| 应收申购款 | - | - | - | 329,254.31 | 329,254.31 |
| 资产总计 | 61,121,725.08 | - | - | -531,952,086.63 | 593,073,811.71 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 15,606,890.89 | 15,606,890.89 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 353,498.71 | 353,498.71 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 726,830.88 | 726,830.88 |
| 应付托管费 | - | - | - | 121,138.44 | 121,138.44 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 36,016.61 | 36,016.61 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,888,065.30 | 1,888,065.30 |
| 负债总计 | - | - | - | 18,732,440.83 | 18,732,440.83 |
| 利率敏感度缺口 | 61,121,725.08 | - | - | -513,219,645.80 | 574,341,370.88 |

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 | 623,192,785.07 | 92.06 | 531,622,832.32 | 92.56 |
| 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 | 623,192,785.07 | 92.06 | 531,622,832.32 | 92.56 |

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 | 37,823,188.20 | 21,860,421.14 |

| | | | |
|--|----------|----------------|----------------|
| | 5% | | |
| | 业绩比较基准下降 | | |
| | 5% | -37,823,188.20 | -21,860,421.14 |

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 | 620,839,817.97 | 531,003,441.88 |
| 第二层次 | 768,748.18 | - |
| 第三层次 | 1,584,218.92 | 619,390.44 |
| 合计 | 623,192,785.07 | 531,622,832.32 |

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。本财务报表已于 2023 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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 | 623,192,785.07 | 91.74 |
| | 其中：股票 | 623,192,785.07 | 91.74 |
| 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 | 43,928,335.98 | 6.47 |
| 8 | 其他各项资产 | 12,217,358.72 | 1.80 |
| 9 | 合计 | 679,338,479.77 | 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 | 30,464,789.00 | 4.50 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 452,125,964.39 | 66.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 9,032.69 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 6,197,122.33 | 0.92 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,933,954.00 | 1.62 |
| H | 住宿和餐饮业 | 8,861,762.00 | 1.31 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 87,275,159.28 | 12.89 |
| 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 | 14,275,284.48 | 2.11 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,566.57 | 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 | 12,967,920.00 | 1.92 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 623,192,785.07 | 92.06 |

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 | 688111 | 金山办公 | 104,011 | 49,116,074.42 | 7.26 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 316,200 | 46,623,690.00 | 6.89 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 397,300 | 46,337,099.00 | 6.85 |
| 4 | 002992 | 宝明科技 | 718,700 | 44,760,636.00 | 6.61 |
| 5 | 601689 | 拓普集团 | 404,700 | 32,659,290.00 | 4.82 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 629,200 | 28,653,768.00 | 4.23 |
| 7 | 688072 | 拓荆科技 | 57,323 | 24,417,878.31 | 3.61 |
| 8 | 688120 | 华海清科 | 96,049 | 24,209,150.45 | 3.58 |
| 9 | 603477 | 巨星农牧 | 595,900 | 19,873,265.00 | 2.94 |
| 10 | 603019 | 中科曙光 | 375,800 | 19,128,220.00 | 2.83 |
| 11 | 300502 | 新易盛 | 271,320 | 18,441,620.40 | 2.72 |
| 12 | 601965 | 中国汽研 | 690,600 | 14,260,890.00 | 2.11 |
| 13 | 002555 | 三七互娱 | 401,500 | 14,004,320.00 | 2.07 |
| 14 | 688599 | 天合光能 | 327,156 | 13,940,117.16 | 2.06 |
| 15 | 000425 | 徐工机械 | 2,001,300 | 13,548,801.00 | 2.00 |
| 16 | 300144 | 宋城演艺 | 1,045,800 | 12,967,920.00 | 1.92 |
| 17 | 600522 | 中天科技 | 773,800 | 12,311,158.00 | 1.82 |
| 18 | 300118 | 东方日升 | 458,000 | 11,738,540.00 | 1.73 |
| 19 | 001322 | 箭牌家居 | 677,500 | 11,341,350.00 | 1.68 |
| 20 | 688200 | 华峰测控 | 71,036 | 10,868,508.00 | 1.61 |
| 21 | 688630 | 芯碁微装 | 128,837 | 10,824,884.74 | 1.60 |
| 22 | 600975 | 新五丰 | 1,107,900 | 10,591,524.00 | 1.56 |

| | | | | | |
|----|--------|------------|-----------|---------------|------|
| 23 | 603606 | 东方电缆 | 215,400 | 10,561,062.00 | 1.56 |
| 24 | 300693 | 盛弘股份 | 284,899 | 10,518,471.08 | 1.55 |
| 25 | 688408 | 中信博新能源 | 123,621 | 10,424,958.93 | 1.54 |
| 26 | 688031 | 星环科技 | 78,167 | 10,414,971.08 | 1.54 |
| 27 | 002865 | 钧达股份 | 66,800 | 10,189,004.00 | 1.51 |
| 28 | 002174 | 游族网络 | 602,400 | 10,120,320.00 | 1.50 |
| 29 | 688700 | 东威科技 | 96,308 | 9,604,796.84 | 1.42 |
| 30 | 600754 | XD 锦江酒店 | 209,300 | 8,861,762.00 | 1.31 |
| 31 | 603893 | 瑞芯微 | 119,200 | 8,683,720.00 | 1.28 |
| 32 | 000938 | 紫光股份 | 226,700 | 7,220,395.00 | 1.07 |
| 33 | 688981 | 中芯国际 | 137,458 | 6,944,378.16 | 1.03 |
| 34 | 600861 | 北京人力 | 264,900 | 6,145,680.00 | 0.91 |
| 35 | 600026 | 中远海能 | 469,900 | 5,939,536.00 | 0.88 |
| 36 | 601975 | 招商南油 | 1,746,300 | 4,994,418.00 | 0.74 |
| 37 | 002980 | 华盛昌 | 112,600 | 3,767,596.00 | 0.56 |
| 38 | 002908 | 德生科技 | 226,840 | 3,509,214.80 | 0.52 |
| 39 | 605118 | 力鼎光电 | 116,600 | 2,025,342.00 | 0.30 |
| 40 | 688582 | 芯动联科 | 6,476 | 299,402.44 | 0.04 |
| 41 | 688502 | 茂莱光学 | 1,509 | 269,492.31 | 0.04 |
| 42 | 301486 | 致尚科技 | 4,470 | 257,740.20 | 0.04 |
| 43 | 301395 | 仁信新材 | 5,196 | 138,629.28 | 0.02 |
| 44 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.02 |
| 45 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.02 |
| 46 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.01 |
| 47 | 688307 | 中润光学 | 2,455 | 77,897.15 | 0.01 |
| 48 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.01 |
| 49 | 688249 | 晶合集成 | 3,690 | 66,641.40 | 0.01 |
| 50 | 688361 | 中科飞测 | 675 | 43,652.25 | 0.01 |
| 51 | 688472 | 阿特斯阳光电力 | 2,532 | 43,145.28 | 0.01 |
| 52 | 301325 | 曼恩斯特 | 332 | 35,839.40 | 0.01 |
| 53 | 688469 | 中芯集成 | 6,590 | 35,651.90 | 0.01 |
| 54 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.01 |
| 55 | 688443 | C 智翔金泰 | 1,101 | 32,468.49 | 0.00 |
| 56 | 301355 | 南王科技 | 1,824 | 31,876.05 | 0.00 |
| 57 | 301358 | 湖南裕能 | 699 | 29,980.11 | 0.00 |
| 58 | 688576 | 西山科技 | 240 | 28,898.40 | 0.00 |
| 59 | 301310 | 鑫宏业 | 409 | 26,760.87 | 0.00 |
| 60 | 301260 | 格力博 | 1,122 | 26,512.86 | 0.00 |
| 61 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |
| 62 | 688531 | 日联科技股份有限公司 | 168 | 22,842.96 | 0.00 |
| 63 | 301307 | 美利信 | 687 | 21,887.82 | 0.00 |
| 64 | 688543 | N 国科军工 | 410 | 21,750.50 | 0.00 |
| 65 | 688146 | 中船派瑞特气 | 549 | 20,933.37 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|----------|-------|-----------|------|
| 66 | 688484 | 南芯科技 | 568 | 20,851.28 | 0.00 |
| 67 | 688552 | 航天南湖 | 878 | 20,633.00 | 0.00 |
| 68 | 301246 | 宏源药业 | 664 | 20,391.44 | 0.00 |
| 69 | 688352 | 顾中科技 | 1,633 | 19,710.31 | 0.00 |
| 70 | 688581 | 安杰思医学 | 160 | 18,884.80 | 0.00 |
| 71 | 301317 | 鑫磊股份 | 694 | 18,161.98 | 0.00 |
| 72 | 301262 | 海看股份 | 692 | 17,646.00 | 0.00 |
| 73 | 688570 | 天玛智控 | 696 | 17,629.68 | 0.00 |
| 74 | 688507 | 索辰科技 | 144 | 17,583.84 | 0.00 |
| 75 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 76 | 688562 | 航天软件股份 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 77 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 78 | 301399 | 英特科技 | 293 | 15,110.01 | 0.00 |
| 79 | 001287 | 中电港 | 715 | 15,029.30 | 0.00 |
| 80 | 301408 | 华人健康 | 879 | 14,899.05 | 0.00 |
| 81 | 301305 | 朗坤环境 | 753 | 14,826.57 | 0.00 |
| 82 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 83 | 688623 | 双元科技 | 166 | 14,407.14 | 0.00 |
| 84 | 688334 | C 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 85 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 86 | 301210 | 金杨股份 | 281 | 13,816.77 | 0.00 |
| 87 | 688512 | 慧智微电子 | 721 | 13,814.36 | 0.00 |
| 88 | 301382 | 蜂助手 | 408 | 13,398.72 | 0.00 |
| 89 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 90 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 91 | 688629 | 华丰科技 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 92 | 688620 | 安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 93 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 94 | 301439 | 泓淋电力 | 721 | 12,184.90 | 0.00 |
| 95 | 601061 | 中信金属 | 1,591 | 12,059.78 | 0.00 |
| 96 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 97 | 688523 | 航天环宇科技 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |
| 98 | 301141 | 中科磁业 | 262 | 11,184.78 | 0.00 |
| 99 | 603135 | 中重科技 | 571 | 10,215.19 | 0.00 |
| 100 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 101 | 301345 | 涛涛车业 | 213 | 9,934.32 | 0.00 |
| 102 | 688479 | 用友汽车信息科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 103 | 301376 | 致欧科技 | 420 | 9,454.20 | 0.00 |
| 104 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 105 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 106 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 107 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 108 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|----------|-----|----------|------|
| 109 | 301170 | 锡南科技 | 250 | 8,732.50 | 0.00 |
| 110 | 301281 | 科源制药 | 338 | 8,483.80 | 0.00 |
| 111 | 688535 | 华海诚科新材料 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 112 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 113 | 301203 | 国泰环保 | 225 | 7,740.00 | 0.00 |
| 114 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 115 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 116 | 601133 | 柏诚系统股份公司 | 543 | 6,657.18 | 0.00 |
| 117 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 118 | 603125 | 江苏常青树科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 119 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 120 | 001282 | 三联锻造 | 105 | 3,468.15 | 0.00 |
| 121 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 122 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 123 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 0.00 |
| 124 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |
| 125 | 603172 | 浙江万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 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 | 688111 | 金山办公 | 39,716,151.35 | 6.92 |
| 2 | 002992 | 宝明科技 | 26,516,200.20 | 4.62 |
| 3 | 688072 | 拓荆科技 | 24,651,862.54 | 4.29 |
| 4 | 601965 | 中国汽研 | 22,895,778.98 | 3.99 |
| 5 | 688120 | 华海清科 | 22,283,386.73 | 3.88 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 21,666,807.44 | 3.77 |
| 7 | 603477 | 巨星农牧 | 19,323,020.75 | 3.36 |
| 8 | 688200 | 华峰测控 | 18,047,079.29 | 3.14 |
| 9 | 300308 | 中际旭创 | 16,732,606.75 | 2.91 |
| 10 | 605117 | 德业股份 | 15,241,097.00 | 2.65 |
| 11 | 300118 | 东方日升 | 15,136,846.99 | 2.64 |
| 12 | 000425 | 徐工机械 | 13,991,271.00 | 2.44 |
| 13 | 603019 | 中科曙光 | 13,242,757.00 | 2.31 |
| 14 | 600588 | 用友网络 | 12,992,355.50 | 2.26 |
| 15 | 688981 | 中芯国际 | 12,671,672.33 | 2.21 |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 12,094,672.00 | 2.11 |
| 17 | 600975 | 新五丰 | 10,913,473.00 | 1.90 |
| 18 | 603893 | 瑞芯微 | 10,745,553.18 | 1.87 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 19 | 688031 | 星环科技 | 10,058,938.33 | 1.75 |
| 20 | 600309 | 万华化学 | 10,052,333.00 | 1.75 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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 | 002027 | 分众传媒 | 19,346,526.00 | 3.37 |
| 2 | 000739 | 普洛药业 | 18,832,924.00 | 3.28 |
| 3 | 688232 | 国泰新点软件 | 17,369,877.01 | 3.02 |
| 4 | 688032 | 禾迈股份 | 15,060,332.19 | 2.62 |
| 5 | 000002 | 万科 A | 12,783,285.99 | 2.23 |
| 6 | 300763 | 锦浪科技 | 12,084,739.50 | 2.10 |
| 7 | 605117 | 德业股份 | 12,043,209.00 | 2.10 |
| 8 | 600256 | 广汇能源 | 11,935,720.05 | 2.08 |
| 9 | 300124 | 汇川技术 | 11,635,372.48 | 2.03 |
| 10 | 600588 | 用友网络 | 11,333,313.80 | 1.97 |
| 11 | 603290 | 斯达半导 | 11,153,167.00 | 1.94 |
| 12 | 688063 | 派能科技 | 10,954,575.63 | 1.91 |
| 13 | 002992 | 宝明科技 | 10,813,757.00 | 1.88 |
| 14 | 600048 | 保利发展 | 10,711,648.00 | 1.87 |
| 15 | 688800 | 瑞可达连接系统 | 10,678,335.93 | 1.86 |
| 16 | 603737 | 三棵树 | 10,293,114.00 | 1.79 |
| 17 | 603606 | 东方电缆 | 9,614,369.39 | 1.67 |
| 18 | 301029 | 怡合达 | 9,179,583.00 | 1.60 |
| 19 | 603596 | 伯特利 | 9,017,345.00 | 1.57 |
| 20 | 600309 | 万华化学 | 8,870,755.00 | 1.54 |

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 | 557,730,965.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 478,028,629.81 |

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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 | 321,714.21 |
| 2 | 应收清算款 | 11,649,283.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 246,361.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,217,358.72 |

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 |
| 中欧盛世成长混合(LOF)A | 80,408 | 3,768.87 | 56,239,540.30 | 18.56% | 246,807,936.13 | 81.44% |
| 中欧盛世成长混合(LOF)C | 10,163 | 2,266.56 | 327,506.99 | 1.42% | 22,707,538.78 | 98.58% |
| 中欧盛世成长混合(LOF)E | 3,343 | 3,332.18 | 0.00 | 0.00% | 11,139,484.89 | 100.00% |
| 合计 | 93,914 | 3,590.75 | 56,567,047.29 | 16.77% | 280,654,959.80 | 83.23% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

中欧盛世成长混合(LOF)A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|----|-------|------------|----------|
| 1 | 王波 | 357,000.00 | 6.70% |
| 2 | 高德荣 | 240,900.00 | 4.52% |
| 3 | 莫恒娟 | 220,566.00 | 4.14% |
| 4 | 吴平生 | 188,800.00 | 3.54% |
| 5 | 赵茹珊 | 146,247.00 | 2.75% |
| 6 | 吴志刚 | 123,824.00 | 2.32% |
| 7 | 李为民 | 123,400.00 | 2.32% |
| 8 | 杨修慧 | 118,200.00 | 2.22% |
| 9 | 罗凌霄 | 115,229.00 | 2.16% |
| 10 | 李昌盛 | 105,656.00 | 1.98% |

注：以上均为中欧盛世成长混合（LOF）A 的场内持有人。

8.3 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 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 411, 272. 04 | 0. 14% |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 67, 500. 26 | 0. 29% |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) E | 837, 608. 35 | 7. 52% |
| | 合计 | 1, 316, 380. 65 | 0. 39% |

8.4 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 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 0~10 |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 0 |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) E | 0~10 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 10~50 |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 0 |
| | 中欧盛世成长混合 (LOF) E | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中欧盛世成长混合 (LOF) A | 中欧盛世成长混合 (LOF) C | 中欧盛世成长混合 (LOF) E |
|---------------------------|-------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012年3月29日）基金份额总额 | 520, 524, 217. 77 | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 246, 409, 272. 48 | 27, 273, 116. 15 | 12, 175, 575. 14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 86, 604, 856. 11 | 8, 005, 630. 99 | 1, 537, 692. 79 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 29, 966, 652. 16 | 12, 243, 701. 37 | 2, 573, 783. 04 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 303, 047, 476. 43 | 23, 035, 045. 77 | 11, 139, 484. 89 |

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 | 佣金 | 占当期佣金 | |
| | | | | | | |

| | | | 交总额的比例 (%) | | 总量的比例 (%) | |
|------|---|----------------|------------|------------|-----------|------------|
| 华创证券 | 2 | 858,411,860.09 | 83.96 | 627,755.44 | 83.96 | - |
| 方正证券 | 1 | 84,194,364.03 | 8.23 | 61,571.58 | 8.23 | - |
| 国都证券 | 1 | 26,859,126.42 | 2.63 | 19,641.66 | 2.63 | - |
| 中邮证券 | 1 | 26,513,006.40 | 2.59 | 19,388.92 | 2.59 | - |
| 西南证券 | 1 | 26,427,555.71 | 2.58 | 19,326.65 | 2.58 | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期新增 1 个 |

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中邮证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 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 | 中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 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 | 中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定媒介 | 2023-04-22 |
| 7 | 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 |
| 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 | 中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 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、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) 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