

中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021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	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	11
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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
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	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	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62

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	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧潜力价值灵活配置混合	
基金主代码	001810	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年09月30日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	909,004,897.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧潜力价值灵活配置混合A	中欧潜力价值灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001810	005764
报告期末下属分级基金的份额总额	838,291,211.51份	70,713,686.41份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利。并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
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，属于较高预期收益风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	基金管理人及基金托管人的住所

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333号五层

§ 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	中欧潜力价值灵活配置混合 A	中欧潜力价值灵活配置混合 C
本期已实现收益	134,731,443.18	9,389,021.37
本期利润	102,326,079.23	5,300,292.70
加权平均基金份额本期利润	0.1189	0.0736
本期加权平均净值利润率	7.04%	4.46%
本期基金份额净值增长率	9.14%	8.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中欧潜力价值灵活配置混合 A	中欧潜力价值灵活配置混合 C
期末可供分配利润	464,562,572.36	35,988,921.56
期末可供分配基金份额利润	0.5542	0.5089
期末基金资产净值	1,451,640,090.27	119,133,897.85
期末基金份额净值	1.732	1.685
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中欧潜力价值灵活配置混合 A	中欧潜力价值灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	100.86%	33.12%

- 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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
- 3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧潜力价值灵活配置混合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	-0.06%	0.68%	0.70%	0.44%	-0.76%	0.24%
过去三个月	0.00%	0.68%	5.45%	0.41%	-5.45%	0.27%
过去六个月	9.14%	0.96%	4.52%	0.60%	4.62%	0.36%
过去一年	32.21%	1.16%	9.79%	0.74%	22.42%	0.42%
过去三年	41.96%	1.33%	21.80%	0.88%	20.16%	0.45%
自基金合同 生效起至今	100.86%	1.24%	12.57%	0.90%	88.29%	0.34%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。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。

中欧潜力价值灵活配置混合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	-0.12%	0.68%	0.70%	0.44%	-0.82%	0.24%
过去三个月	-0.18%	0.68%	5.45%	0.41%	-5.63%	0.27%
过去六个月	8.71%	0.97%	4.52%	0.60%	4.19%	0.37%
过去一年	31.13%	1.16%	9.79%	0.74%	21.34%	0.42%
过去三年	38.60%	1.33%	21.80%	0.88%	16.80%	0.45%
自基金份额 运作日至今	33.12%	1.32%	10.79%	0.88%	22.33%	0.44%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。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

中欧潜力价值灵活配置混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年09月30日-2021年06月30日)



中欧潜力价值灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年03月15日-2021年06月30日)



注：自 2018 年 3 月 14 日本基金增加 C 类份额，图示日期为 2018 年 3 月 15 日至 2021 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。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、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2021年6月30日，本基金管理人共管理96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	2016-12-28	-	9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。
沈悦	基金经理	2020-05-12	-	6年	历任中国建设银行天津市开发分行管培生。2015/05/20加入中欧基金管理有限公司, 历任研究助理、研究员、投资助理。
曹名长	权益投决会委员/投资总监/基金经理	2015-11-20	-	24年	历任君安证券公司研究所研究员，闽发证券上海研发中心研究员，红塔证券资产管理总部投资经理，百瑞信托有限责任公司信托经理，新华基金管理公司总经理助理、基金经理。2015/06/18加入中欧基金

					管理有限公司。
--	--	--	--	--	---------

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

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

本基金坚持低估值价值投资策略，历史验证该策略长期跑赢市场，而从2019至2021年上半年的时间，低估值策略相对市场都表现不佳。2021年上半年申万低市盈率指数下跌3.93%，低市净率指数上涨4.68%，而申万高市盈率指数和高市净率指数则分别上涨了19.24%和11.54%。

我们认为，在中国，低估值价值投资和成长风格价值投资，长期看都是有效的。这是由中国未来的产业结构决定的，我们相信中国未来不仅会发展高科技等新兴产业，也会继续做大做强国内传统制造业。

我们认为，价值回归可能迟到，但不会不到来，有价值的投资品种最终会显现它应有的价值，不必过于关注短期哪种风格表现更好。当然，我们也不会坐等不动，而是不停地去挖掘有更大价值空间的投资品种。考虑整个市场估值较低的标的数量，目前市场的分化，对做低估值价值投资的投资者来说是一种馈赠。目前全市场市盈率（TTM）低于30倍的标的数量接近1500个，低于20倍的接近1000个，这两个数字均处于历史高位。我们并非认为所有静态低估值品种都具有投资价值，但低估值品种的数量越多，我们从中选出真正有价值的低估值品种的概率也越大。基于以上几点，我们对未来较长时期的低估值价值投资都是有信心的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值增长率为9.14%，同期业绩比较基准收益率为4.52%；C类份额净值增长率为8.71%，同期业绩比较基准收益率为4.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场方面，目前整体估值相比2020年底及2021年初的时点已有明显下降，沪深300指数估值已经略低于历史1/2分位水平，因此从估值角度看，市场整体的风险是有限的。从业绩基本面来看，今年以来上市公司业绩持续增长，加上政策从偏紧转向平稳甚至逐步趋松，因此我们对市场由谨慎开始向乐观转变一些。

我们在这里再次强调，虽然我们长期看好A股市场，长期看好中国发展，但我们对市场短期大幅推高一些品种持非常谨慎的态度。即使这些品种具备长期投资价值，但短期市值大幅升高会使其逐渐缺乏安全边际，并增加短期大幅波动的可能性。我们希望市场走向健康平稳的发展方向，发挥资本市场合理调配资源与实体经济协同发展的价值，达到实体经济和参与资本市场的各方都长期受益共赢的局面，因此，我们认为，我们规避对短期市场产生大幅扰动的投资行为，如追涨杀跌，是必要的。

投资方向上，从短期来看，我们认为包括金融在内的整个低估值板块在未来一段时间可能都会有比较好的表现，从更长的时间维度来考虑，我们更看好中小盘上市公司中的部分细分行业的龙头，尤其是制造业。

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、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有

人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	85,044,063.24	101,851,836.05
结算备付金		7,113,975.71	955,843.06
存出保证金		18,556,809.47	231,386.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,433,921,324.74	1,656,760,456.83
其中：股票投资		1,428,472,124.74	1,653,215,935.33
基金投资		-	-
债券投资		5,449,200.00	3,544,521.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,661,810.39	28,337,918.94
应收利息	6.4.7.5	10,420.62	12,273.55
应收股利		-	-
应收申购款		1,991,505.95	715,893.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,577,299,910.12	1,788,865,608.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,284,923.01	23,079,999.49
应付管理人报酬		1,992,910.71	2,433,763.40
应付托管费		332,151.75	405,627.24
应付销售服务费		81,229.57	107,716.36
应付交易费用	6.4.7.7	722,515.42	837,582.53
应交税费		1.57	44.98
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	112,189.97	136,220.95
负债合计		6,525,922.00	27,000,954.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	909,004,897.92	1,112,755,069.62
未分配利润	6.4.7.10	661,769,090.20	649,109,583.71
所有者权益合计		1,570,773,988.12	1,761,864,653.33
负债和所有者权益总计		1,577,299,910.12	1,788,865,608.28

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值为人民币1.728元，基金份额总额909,004,897.92份，其中A类基金份额净值为人民币1.732元，份额总额838,291,211.51份；C类基金份额净值为人民币1.685元，份额总额70,713,686.41份。

6.2 利润表

会计主体：中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至	上年度可比期间 2020年01月01日至202
-----	-----	--------------------	----------------------------

		2021年06月30日	0年06月30日
一、收入		125,276,219.17	-29,499,172.44
1. 利息收入		198,950.27	505,908.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	193,925.27	460,174.51
债券利息收入		436.51	3,438.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,588.49	42,295.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		158,965,241.23	90,488,782.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	134,417,088.71	66,130,532.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	911,148.89	859,034.94
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	23,637,003.63	23,499,214.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-36,494,092.62	-122,209,841.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,606,120.29	1,715,977.85
减：二、费用		17,649,847.24	22,131,792.39
1. 管理人报酬		11,656,046.51	15,796,262.98
2. 托管费		1,942,674.38	2,632,710.58
3. 销售服务费		470,683.06	231,587.15
4. 交易费用	6.4.7.18	3,464,005.58	3,354,277.63

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.56	12.41
7. 其他费用	6.4.7.19	116,436.15	116,941.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,626,371.93	-51,630,964.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,626,371.93	-51,630,964.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,112,755,069.62	649,109,583.71	1,761,864,653.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,626,371.93	107,626,371.93
三、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）	-203,750,171.70	-94,966,865.44	-298,717,037.14
其中：1. 基金申购款	650,245,005.57	448,939,726.09	1,099,184,731.66
2. 基金赎回款	-853,995,177.27	-543,906,591.53	-1,397,901,768.80
四、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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	909,004,897.92	661,769,090.20	1,570,773,988.12
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,805,648,255.58	586,230,948.60	2,391,879,204.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-51,630,964.83	-51,630,964.83
三、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)	-418,232,702.85	-105,426,792.54	-523,659,495.39
其中：1. 基金申购款	616,198,057.79	206,850,074.78	823,048,132.57
2. 基金赎回款	-1,034,430,760.64	-312,276,867.32	-1,346,707,627.96
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,387,415,552.73	429,173,191.23	1,816,588,743.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧潜力价值灵活配置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[2015]1897号文《关于准予中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧潜力价值灵活配置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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集275,554,648.27元。经向中国证监会备案，《中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为275,628,363.35份基金份额，其中认购资金利息折合73,715.08份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定，为满足投资者的理财需求，经征托管人中国工商银行股份有限公司同意并报中国证监会备案，本基金管理人决定自2018年3月14日起增加本基金的场外C类基金份额类别并相应修改基金合同、托管协议。本基金在现有份额的基础上增加C类基金份额，原份额转为A类基金份额。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧潜力价值灵活配置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（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，

同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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2号《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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，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；

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，自2018年1月1日起，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。

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、营业税的单位和个人，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。

6.4.7 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 2021年06月30日
活期存款	85,044,063.24
定期存款	—
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	-
合计	85,044,063.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,493,569,690.84	1,428,472,124.74	-65,097,566.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,449,200.00	5,449,200.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,449,200.00	5,449,200.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,499,018,890.84	1,433,921,324.74	-65,097,566.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		合同/名义金额	公允价值	
			资产	负债
利率衍生工具		-	-	-
货币衍生工具		-	-	-
权益衍生工具		148,022,220.00	-	-
股指期货		148,022,220.00	-	-

	0			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	148,022,220.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码 名称 持仓量 （买/卖） 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
IF2109 IF2109 -98 -151,892,160.00 -3,869,940.00 套保

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	8,425.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,798.46
应收债券利息	47.77
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	148.40
合计	10,420.62

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	722,515.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	722,515.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,167.18
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	47,108.87
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出费	399.26
应付转出补差费	7.29
合计	112,189.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(中欧潜力价值灵活配置混合 A)	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,013,062,869.43	1,013,062,869.43
本期申购	573,703,935.25	573,703,935.25
本期赎回（以“-”号填列）	-748,475,593.17	-748,475,593.17
本期末	838,291,211.51	838,291,211.51

金额单位：人民币元

项目 (中欧潜力价值灵活配置混合 C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,692,200.19	99,692,200.19
本期申购	76,541,070.32	76,541,070.32
本期赎回（以“-”号填列）	-105,519,584.10	-105,519,584.10
本期末	70,713,686.41	70,713,686.41

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 中欧潜力价值灵活配置混合A

单位：人民币元

项目 (中欧潜力价值灵活配置混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	394,734,427.70	199,559,281.21	594,293,708.91
本期利润	134,731,443.18	-32,405,363.95	102,326,079.23
本期基金份额交易产生的变动数	-64,903,298.52	-18,367,610.86	-83,270,909.38
其中：基金申购款	260,305,596.63	137,919,505.88	398,225,102.51
基金赎回款	-325,208,895.15	-156,287,116.74	-481,496,011.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	464,562,572.36	148,786,306.40	613,348,878.76

6.4.7.10.2 中欧潜力价值灵活配置混合C

单位：人民币元

项目 (中欧潜力价值灵活配置混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,412,872.79	19,403,002.01	54,815,874.80
本期利润	9,389,021.37	-4,088,728.67	5,300,292.70
本期基金份额交易产生的变动数	-8,812,972.60	-2,882,983.46	-11,695,956.06
其中：基金申购款	31,731,394.75	18,983,228.83	50,714,623.58
基金赎回款	-40,544,367.35	-21,866,212.29	-62,410,579.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,988,921.56	12,431,289.88	48,420,211.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	165,244.51
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	26,156.40
其他	2,524.36
合计	193,925.27

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,239,428,499.97
减：卖出股票成本总额	1,105,011,411.26

买卖股票差价收入	134,417,088.71
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	911,148.89
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	911,148.89

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,368,440.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,456,500.00
减：应收利息总额	791.88
买卖债券差价收入	911,148.89

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	23,637,003.63
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	23,637,003.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-32,624,152.62
——股票投资	-32,536,131.12
——债券投资	-88,021.50
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	-3,869,940.00
——权证投资	—
——期货投资	-3,869,940.00
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	-36,494,092.62

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	2,200,085.09
转换费收入	406,035.20
合计	2,606,120.29

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	3,460,322.04
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	3,683.54
合计	3,464,005.58

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	47,108.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	819.91
账户维护费	9,000.00
合计	116,436.15

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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，未发生重大关联方关系变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度同期均无应向关联方支付佣金。

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------	------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	11,656,046.51	15,796,262.98
其中：支付销售机构的客户维护费	4,554,971.63	6,136,031.08

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的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

基金管理费每日计算，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基金管理费划款指令，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、公休假等，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 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,942,674.38	2,632,710.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。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

基金托管费每日计算，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基金托管费划款指令，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取。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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧潜力价值灵活配置混合 A	中欧潜力价值灵活配置混合 C	合计
中欧基金	0.00	297,570.55	297,570.55

合计	0.00	297,570.55	297,570.55
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧潜力价值灵活配置混合 A	中欧潜力价值灵活配置混合 C	合计
中欧基金	0.00	227,033.04	227,033.04
合计	0.00	227,033.04	227,033.04

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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧潜力价值灵活配置混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中欧潜力价值灵活配置混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	102,110.28	102,110.28
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	102,110.28	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	102,110.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.25%

注： 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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

中欧潜力价值灵活配置混合A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	316,994.74	0.04%	549,626.87	0.05%

注：1、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。

2、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类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	85,044,063.24	165,244.51	103,246,233.61	435,438.50

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2021年06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	可流通日	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
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	新股流通受限	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	新股流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	新股流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	新股流通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-

300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	新股流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	新股流通受限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-

688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.4	11,014.4	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127039	北港转债	2021-06-29	2021-07-23	新债未上市	100.00	100.00	54,492	5,449,200.00	5,449,200.00	-

注：上述流通受限证券所披露的可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

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2021年6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2021年6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。在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核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提出意见和建议。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，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，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 2021年0 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	85,044,063.24	-	-	-	85,044,063.24
结算备付金	7,113,975.71	-	-	-	7,113,975.71
存出保证金	329,750.27	-	-	18,227,059.20	18,556,809.47
交易性金融资产	-	-	5,449,200.00	1,428,472,124.74	1,433,921,324.74
应收证券清算款	-	-	-	30,661,810.39	30,661,810.39
应收利息	-	-	-	10,420.62	10,420.62
应收申购款	-	-	-	1,991,505.95	1,991,505.95
资产总计	92,487,789.22	-	5,449,200.00	1,479,362,920.90	1,577,299,910.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,284,923.01	3,284,923.01
应付管理人报酬	-	-	-	1,992,910.71	1,992,910.71
应付托管费	-	-	-	332,151.75	332,151.75
应付销售服务费	-	-	-	81,229.57	81,229.57
应付交易费用	-	-	-	722,515.42	722,515.42
应交税费	-	-	-	1.57	1.57
其他负债	-	-	-	112,189.97	112,189.97
负债总计	-	-	-	6,525,922.00	6,525,922.00
利率敏感度缺	92,487,789.22	-	5,449,200.00	1,472,836,998.90	1,570,773,988.12

口					
上年度末 2020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	101,851,836.05	-	-	-	101,851,836.05
结算备付金	955,843.06	-	-	-	955,843.06
存出保证金	231,386.12	-	-	-	231,386.12
交易性金融资产	-	1,333,021.50	2,211,500.00	1,653,215,935.33	1,656,760,456.83
应收证券清算款	-	-	-	28,337,918.94	28,337,918.94
应收利息	-	-	-	12,273.55	12,273.55
应收申购款	-	-	-	715,893.73	715,893.73
资产总计	103,039,065.23	1,333,021.50	2,211,500.00	1,682,282,021.55	1,788,865,608.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,079,999.49	23,079,999.49
应付管理人报酬	-	-	-	2,433,763.40	2,433,763.40
应付托管费	-	-	-	405,627.24	405,627.24
应付销售服务费	-	-	-	107,716.36	107,716.36
应付交易费用	-	-	-	837,582.53	837,582.53
应交税费	-	-	-	44.98	44.98
其他负债	-	-	-	136,220.95	136,220.95
负债总计	-	-	-	27,000,954.95	27,000,954.95
利率敏感度缺	103,039,065.23	1,333,021.50	2,211,500.00	1,655,281,066.60	1,761,864,653.33

□					
---	--	--	--	--	--

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2021年06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0.35% (2020年12月31日:0.20%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,428,472,124.74	90.94	1,653,215,935.33	93.83

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,428,472,124.74	90.94	1,653,215,935.33	93.83

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	89,000,998.80	114,460,268.86
	2. 业绩比较基准下降5%	-89,000,998.80	-114,460,268.86

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,424,648,442.59 元，属于第二层次的余额为人民币9,272,882.15 元，无划分为第三层次的余额(2020年12月31日：本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,602,012,009.76元，属于第二层次的余额为人民币54,748,447.07元，无划分为第三层次的余额。)

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

3. 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

4. 财务报表的批准

本财务报表已于2021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	1,428,472,124.74	90.56
	其中：股票	1,428,472,124.74	90.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,449,200.00	0.35
	其中：债券	5,449,200.00	0.35
	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	92,158,038.95	5.84

8	其他各项资产	51,220,546.43	3.25
9	合计	1,577,299,910.12	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

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	7,003,314.12	0.45
C	制造业	799,832,067.68	50.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,472.71	0.01
E	建筑业	69,077,874.83	4.40
F	批发和零售业	199,133,156.38	12.68
G	交通运输、仓储和邮政业	24,490,071.30	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,815,767.14	4.00
J	金融业	792,635.10	0.05
K	房地产业	164,372,817.95	10.46
L	租赁和商务服务业	7,235,276.40	0.46
M	科学研究和技术服务业	86,343,864.12	5.50
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,196,078.40	0.46
S	综合	-	-
	合计	1,428,472,124.74	90.94

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	002048	宁波华翔	6,079,490	118,550,055.00	7.55
2	600383	金地集团	7,009,163	71,773,829.12	4.57
3	600297	广汇汽车	24,766,633	71,327,903.04	4.54
4	000910	大亚圣象	5,742,849	68,225,046.12	4.34
5	603444	吉比特	118,100	62,593,000.00	3.98
6	601965	中国汽研	3,598,914	62,189,233.92	3.96
7	601677	明泰铝业	3,168,780	61,949,649.00	3.94
8	002045	国光电器	4,300,029	53,492,360.76	3.41
9	603108	润达医疗	4,709,888	52,892,042.24	3.37
10	002327	富安娜	6,642,236	51,410,906.64	3.27
11	000028	国药一致	1,317,148	49,840,880.32	3.17
12	000401	冀东水泥	3,757,671	46,407,236.85	2.95
13	002713	东易日盛	6,579,118	45,856,452.46	2.92
14	002398	垒知集团	6,398,559	45,621,725.67	2.90
15	002035	华帝股份	5,811,566	41,959,506.52	2.67
16	000537	广宇发展	7,479,545	39,118,020.35	2.49
17	600987	航民股份	6,899,620	36,223,005.00	2.31
18	002206	海利得	5,654,972	35,117,376.12	2.24
19	600048	保利地产	2,563,507	30,864,624.28	1.96
20	300464	星徽股份	2,116,674	24,976,753.20	1.59
21	002318	久立特材	2,041,178	24,534,959.56	1.56
22	000582	北部湾港	2,950,611	24,490,071.30	1.56
23	603018	华设集团	3,020,020	24,009,159.00	1.53
24	600352	浙江龙盛	1,616,400	22,209,336.00	1.41
25	600166	福田汽车	5,632,600	19,432,470.00	1.24
26	000030	富奥股份	2,995,486	19,081,245.82	1.21

27	600970	中材国际	2,065,500	18,940,635.00	1.21
28	603808	歌力思	1,169,884	18,484,167.20	1.18
29	601311	骆驼股份	1,379,470	15,960,467.90	1.02
30	603699	纽威股份	1,400,000	14,700,000.00	0.94
31	002043	兔宝宝	1,362,333	13,432,603.38	0.86
32	000002	万科A	481,704	11,469,372.24	0.73
33	300232	洲明科技	1,253,900	11,197,327.00	0.71
34	603725	天安新材	1,528,300	11,110,741.00	0.71
35	002088	鲁阳节能	463,100	10,646,669.00	0.68
36	002250	联化科技	340,700	9,505,530.00	0.61
37	002833	弘亚数控	217,707	8,436,146.25	0.54
38	002078	太阳纸业	616,900	8,235,615.00	0.52
39	601155	新城控股	188,200	7,829,120.00	0.50
40	002818	富森美	599,940	7,235,276.40	0.46
41	603096	新经典	216,880	7,196,078.40	0.46
42	600985	淮北矿业	573,572	7,003,314.12	0.45
43	002068	黑猫股份	778,800	5,911,092.00	0.38
44	603997	继峰股份	613,900	5,046,258.00	0.32
45	002081	金螳螂	537,300	4,255,416.00	0.27
46	002947	恒铭达	130,000	3,510,000.00	0.22
47	603326	我乐家居	318,600	3,437,694.00	0.22
48	000961	中南建设	538,849	3,189,986.08	0.20
49	600567	山鹰国际	917,000	3,163,650.00	0.20
50	603757	大元泵业	153,349	3,045,511.14	0.19
51	603788	宁波高发	156,065	1,972,661.60	0.13
52	000786	北新建材	34,700	1,361,975.00	0.09
53	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.07
54	688198	佰仁医疗	4,151	946,428.00	0.06
55	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
56	000333	美的集团	4,227	301,680.99	0.02
57	600036	招商银行	5,000	270,950.00	0.02

58	601336	新华保险	5,800	266,278.00	0.02
59	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.02
60	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.02
61	300445	康斯特	17,560	230,914.00	0.01
62	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
63	000581	威孚高科	9,100	189,553.00	0.01
64	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.01
65	002601	龙蟠佰利	5,170	178,778.60	0.01
66	601318	中国平安	2,600	167,128.00	0.01
67	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
68	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
69	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.01
70	600116	三峡水利	13,212	110,452.32	0.01
71	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.01
72	002643	万润股份	5,950	105,791.00	0.01
73	002884	凌霄泵业	4,388	102,196.52	0.01
74	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
75	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
76	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
77	002353	杰瑞股份	1,935	86,494.50	0.01
78	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
79	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
80	603612	索通发展	4,400	79,068.00	0.01
81	002563	森马服饰	6,408	76,575.60	0.00
82	002146	荣盛发展	11,535	65,057.40	0.00
83	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
84	600426	华鲁恒升	2,085	64,530.75	0.00
85	000069	华侨城 A	8,442	62,808.48	0.00
86	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
87	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
88	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00

89	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
90	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
91	603600	永艺股份	5,200	53,456.00	0.00
92	002572	索菲亚	2,200	53,240.00	0.00
93	000488	晨鸣纸业	6,300	51,282.00	0.00
94	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
95	002142	宁波银行	1,300	50,661.00	0.00
96	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
97	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
98	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
99	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
100	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
101	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
102	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
103	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
104	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
105	688056	莱伯泰科	283	19,413.80	0.00
106	600176	中国巨石	1,196	18,549.96	0.00
107	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
108	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
109	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
110	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
111	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
112	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
113	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
114	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
115	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
116	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
117	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
118	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
119	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00

120	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
121	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
122	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
123	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
124	600984	建设机械	913	9,778.23	0.00
125	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
126	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
127	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
128	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
129	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
130	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
131	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
132	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
133	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
134	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
135	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
136	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
137	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
138	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
139	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
140	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
141	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
142	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
143	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
144	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
145	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
146	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
147	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
148	002637	赞宇科技	400	6,116.00	0.00
149	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
150	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00

151	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
152	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
153	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
154	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
155	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
156	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
157	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
158	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
159	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
160	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
161	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
162	601601	中国太保	100	2,897.00	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	603444	吉比特	57,455,744.82	3.26
2	600383	金地集团	55,856,262.32	3.17
3	603108	润达医疗	53,832,468.29	3.06
4	002398	垒知集团	52,163,781.50	2.96
5	000028	国药一致	51,035,458.63	2.90
6	000401	冀东水泥	48,492,030.97	2.75
7	002045	国光电器	46,577,789.84	2.64
8	603018	华设集团	31,180,286.74	1.77
9	300464	星徽股份	29,921,327.12	1.70
10	600352	浙江龙盛	27,892,225.00	1.58
11	000910	大亚圣象	27,426,634.56	1.56
12	000582	北部湾港	24,892,463.37	1.41
13	600970	中材国际	20,880,847.00	1.19

14	002713	东易日盛	19,924,213.80	1.13
15	600036	招商银行	19,771,089.66	1.12
16	603808	歌力思	18,991,713.86	1.08
17	002645	华宏科技	17,894,924.80	1.02
18	300587	天铁股份	16,385,108.08	0.93
19	600567	山鹰国际	16,262,000.00	0.92
20	688198	佰仁医疗	15,571,177.16	0.88

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	601965	中国汽研	103,340,940.84	5.87
2	601601	中国太保	85,634,594.48	4.86
3	603008	喜临门	80,534,832.67	4.57
4	601336	新华保险	69,939,578.34	3.97
5	600340	华夏幸福	43,665,899.80	2.48
6	600466	蓝光发展	34,461,480.82	1.96
7	000910	大亚圣象	32,767,198.42	1.86
8	601677	明泰铝业	30,691,156.04	1.74
9	603444	吉比特	27,412,425.00	1.56
10	600297	广汇汽车	24,466,758.14	1.39
11	600048	保利地产	24,250,485.43	1.38
12	002048	宁波华翔	23,056,501.00	1.31
13	688198	佰仁医疗	23,020,881.99	1.31
14	002645	华宏科技	22,607,217.75	1.28
15	600036	招商银行	20,471,289.00	1.16
16	300587	天铁股份	19,582,460.59	1.11
17	002165	红宝丽	19,166,324.81	1.09
18	002563	森马服饰	18,318,643.81	1.04

19	300196	长海股份	17,773,449.73	1.01
20	601838	成都银行	17,652,983.06	1.00

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	912,803,731.79
卖出股票收入（成交）总额	1,239,428,499.97

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	5,449,200.00	0.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,449,200.00	0.35

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	127039	北港转债	54,492	5,449,200.00	0.35

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	-98	-151,892,160.00	-3,869,940.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-3,869,940.00
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-3,869,940.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货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,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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,556,809.47
2	应收证券清算款	30,661,810.39
3	应收股利	—
4	应收利息	10,420.62
5	应收申购款	1,991,505.95
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	51,220,546.43

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 潜力 价值 灵活 配置 混合A	187, 229	4,477.36	128,739,803.77	15.3 6%	709,551,407.74	84.64%
中欧 潜力 价值 灵活 配置 混合C	6,64 9	10,635.24	50,388,096.40	71.2 6%	20,325,590.01	28.74%
合计	193, 878	4,688.54	179,127,900.17	19.7 1%	729,876,997.75	80.29%

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	中欧潜力价值灵活	718,104.52	0.09%

持有本基金	配置混合A		
	中欧潜力价值灵活配置混合C	—	—
	合计	718,104.52	0.08%

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	中欧潜力价值灵活配置混合A	10~50
	中欧潜力价值灵活配置混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧潜力价值灵活配置混合A	0
	中欧潜力价值灵活配置混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧潜力价值灵活配置混合A	中欧潜力价值灵活配置混合C
基金合同生效日(2015年09月30日)基金份额总额	275,628,363.35	—
本报告期期初基金份额总额	1,013,062,869.43	99,692,200.19
本报告期基金总申购份额	573,703,935.25	76,541,070.32
减：本报告期基金总赎回份额	748,475,593.17	105,519,584.10
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	838,291,211.51	70,713,686.41

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
安信 证券	1	141,292,564.63	6.60%	131,586.91	6.60%	—
财通 证券	1	—	—	—	—	—
长江 证券	1	—	—	—	—	—
川财 证券	1	—	—	—	—	—
东北 证券	1	140,460,193.78	6.56%	130,814.35	6.56%	—
东方 财富	1	—	—	—	—	—
东方 证券	1	20,825,845.68	0.97%	19,395.25	0.97%	—
东吴 证券	1	73,500,473.64	3.43%	68,451.03	3.43%	—
东兴 证券	1	—	—	—	—	—
光大 证券	1	178,367,544.65	8.33%	166,116.26	8.33%	—
广发 证券	1	—	—	—	—	—
国金 证券	1	129,013,670.92	6.03%	120,151.86	6.03%	—
国泰 君安	1	4,918,672.25	0.23%	4,580.78	0.23%	—
国信 证券	1	38,310,699.81	1.79%	35,679.40	1.79%	—
海通 证券	1	—	—	—	—	—
华泰	1	97,052,257.90	4.53%	90,383.84	4.53%	—

证券						
平安 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	22,286,694.20	1.04%	20,756.80	1.04%	-
天风 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	263,546,148.72	12.31%	245,445.00	12.31%	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	89,058,497.77	4.16%	82,941.23	4.16%	-
浙商 证券	1	473,604,596.76	22.13%	441,055.54	22.13%	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中信 建投	1	154,512,917.17	7.22%	143,897.26	7.22%	-
中信 证券	1	87,829,331.01	4.10%	81,792.15	4.10%	-
中信 证券 (华 南)	1	-	-	-	-	-
国都 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	225,931,359.15	10.56%	210,409.58	10.56%	-

注：1. 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，并由公司董事会授权管理层批准。

2. 本报告期内，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

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		基金交易	
	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	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	2,997,186.77	68.61%	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	1,371,254.00	31.39%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	48,100,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-

注：1. 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，并由公司董事会授权管理层批准。
2. 本报告期内，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

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	中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
2	中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
3	中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22

§ 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、中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧潜力价值灵活配置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

基金管理人及基金托管人的住所。

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及基金托管人的住所免费查阅。

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
二〇二一年八月三十一日