

# 中欧创新成长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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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	14
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	14
§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 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	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
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	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧创新成长灵活配置混合	
基金主代码	005275	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018年03月26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	3,944,589,878.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧创新成长灵活配置混合A	中欧创新成长灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	005275	005276
报告期末下属分级基金的份额总额	3,140,358,955.86份	804,230,922.86份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>在严格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。</p>
投资策略	<p>本基金持续跟踪宏观经济面、政策面等重要指标，进行自上而下宏观分析，并结合市场环境趋势分析，综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。本基金为混合型基金，长期来看整体将积极配置于股票类资产，并根据市场环境动态调整。</p> <p>宏观经济面的主要指标：包括但不限于国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、固定资产投资总量及增速、社会消费品零售总额及增长率、进出口额及增长率、发电量、PMI等主要宏观经济统计数据；</p> <p>政策面的主要指标：包括但不限于货币政策、财政政策、资本市场相关的各项政策、经济各领域中改革、转型推进等相关政策等；</p>

	市场环境趋势分析的主要指标：包括但不限于市场资金面趋势、市场估值水平、市场情绪、开户数、市场仓位水平等；
业绩比较基准	中证500指数收益率×50%+恒生指数收益率×10%+中债综合债券指数收益率×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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
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5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5号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.zofund.com

址	
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5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)	
	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C
本期已实现收益	672,672,362.67	171,103,388.65
本期利润	666,974,757.96	175,456,880.16
加权平均基金份额本期利润	0.2024	0.1962
本期加权平均净值利润率	8.93%	8.86%
本期基金份额净值增长率	11.89%	11.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	1,407,359,340.35	324,537,470.30
期末可供分配基金份额利润	0.4482	0.4035
期末基金资产净值	7,646,548,610.46	1,909,440,322.56
期末基金份额净值	2.4349	2.3742
3.1.3 累计期末指标	报告期末	

	(2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	143.49%	137.42%

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

中欧创新成长灵活配置混合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	1.83%	1.18%	0.47%	0.40%	1.36%	0.78%
过去三个月	16.83%	1.27%	4.74%	0.40%	12.09%	0.87%
过去六个月	11.89%	1.73%	4.45%	0.58%	7.44%	1.15%
过去一年	36.78%	1.60%	10.06%	0.68%	26.72%	0.92%
过去三年	147.40%	1.54%	18.82%	0.81%	128.58%	0.73%
自基金合同生效起至今	143.49%	1.49%	12.98%	0.80%	130.51%	0.69%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*50%+中债综合债券指数收益率\*40%+恒生指数收益率\*10%。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。

中欧创新成长灵活配置混合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	1.76%	1.19%	0.47%	0.40%	1.29%	0.79%
过去三个月	16.59%	1.27%	4.74%	0.40%	11.85%	0.87%
过去六个月	11.44%	1.73%	4.45%	0.58%	6.99%	1.15%
过去一年	35.70%	1.60%	10.06%	0.68%	25.64%	0.92%
过去三年	141.82%	1.54%	18.82%	0.81%	123.00%	0.73%
自基金合同生效起至今	137.42%	1.49%	12.98%	0.80%	124.44%	0.69%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*50%+中债综合债券指数收益率\*40%+恒生指数收益率\*10%。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

中欧创新成长灵活配置混合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



中欧创新成长灵活配置混合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26日-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		

王培	权益投决会副主席/投资总监/基金经理/投资经理	2018-03-26	-	13年	历任国泰君安证券研究所助理研究员, 银河基金管理有限公司投资副总监兼基金经理。2016/02/18加入中欧基金管理有限公司, 历任投资经理、权益投决会委员。
尹为醇	基金经理助理	2020-06-24	2021-03-19	10年	历任国泰君安证券研究员, 海通证券投资经理, 申港证券投资经理, 深圳天风天成资产部门经理。2019/10/09加入中欧基金管理有限公司, 历任高级研究员、投资助理。
尹为醇	基金经理	2021-03-20	-	10年	历任国泰君安证券研究员, 海通证券投资经理, 申港证券投资经理, 深圳天风天成资产部门经理。2019/10/09加入中欧基金管理有限公司, 历任高级研究员、投资助理、基金经理助理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王培	公募基金	5	37,655,517,095.19	2017-07-26
	私募资产管理计划	1	510,973,635.59	2021-05-14
	其他组合	-	-	-
	合计	6	38,166,490,73	-

			0.78	
--	--	--	------	--

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有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

上半年A股上证区间震荡，沪深300上涨0.24%，创业板指数上涨17.22%，连续创出近五年来新高，港股表现低迷，恒生科技受宏观和政策影响跌幅较多。从结果看，以新能源和半导体为主体的科技公司和以医疗服务为主体的医疗医药公司表现靓丽，而整个市场风格也基本上在这两个主题上演绎。虽然整个周期股依然处于非常景气的阶段，但是出于对未来通胀的担心，周期性行业估值提升困难，而家电食品板块增长乏力，也基本呈现震荡格局。虽然整体国内经济稳定运行，情况良好，但是对未来的担忧在逐步增加，投资者更多的开始关注长期，出现了估值大幅分化的局面，中长期的优势行业估值大幅提升，而过去几年的一部分核心投资标的则明显后继乏力，出现了估值下移。随着

时间推移，估值的分化会更加明显，在变化越来越快的未来，整个市场的估值体系也会更多地呈现出这种两极分化的态势，进而也增加了投资者的辨识难度和投资难度。

#### 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11.89%，同期业绩比较基准收益率为4.45%；C类份额净值增长率为11.44%，同期业绩比较基准收益率为4.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，本基金判断市场整体维持震荡格局，本组合一贯以竞争力为核心选择标的公司。随着时间推移，投资机会更显匮乏，部分行业维持高速增长和多数行业基本面疲软将会持续，而这种状态下的估值分化会愈演愈烈，这种分化也基本符合社会发展规律。从稳健角度出发，在目前市场找寻确定性和估值大幅分化的阶段，本组合会逐步进行组合调整，尽可能在市场大幅波动下保持一定稳定性。虽然投资难度较以往会有所提升，但是个股机会依然很多，尤其是一些最近几年新上市的科技公司，本基金也会积极的通过审慎研究，选择未来更有增长潜力的公司来完善组合。另外，2021年的投资相对来说需要更深度的思考，进而对未来商业化变革和各个领域相互渗透需要有更清晰的理解，在此阶段需要对未来更有潜力公司的辨识能力，也需要投资本身具备更强的定力。

#### 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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧创新成长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，中欧创新成长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创新成长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创新成长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：中欧创新成长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	1,081,823,977.18	591,640,946.56
结算备付金		252,746,289.95	70,228,225.33
存出保证金		2,941,328.89	8,253,378.76
交易性金融资产	6.4.7.2	8,388,693,178.77	8,372,949,378.87
其中：股票投资		8,388,693,178.77	8,372,949,378.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	77,858,786.21
应收利息	6.4.7.5	125,625.77	77,045.68
应收股利		-	-
应收申购款		11,046,006.71	17,701,267.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,737,376,407.27	9,138,709,028.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		56,086,070.38	83,843,807.34
应付赎回款		105,365,975.95	94,398,192.19
应付管理人报酬		11,714,080.91	11,017,909.67
应付托管费		1,952,346.80	1,836,318.26
应付销售服务费		1,264,622.64	1,257,721.28

应付交易费用	6.4.7.7	4,596,705.57	4,632,463.33
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	407,672.00	369,110.69
负债合计		181,387,474.25	197,355,522.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,944,589,878.72	4,127,436,187.54
未分配利润	6.4.7.10	5,611,399,054.30	4,813,917,318.35
所有者权益合计		9,555,988,933.02	8,941,353,505.89
负债和所有者权益总计		9,737,376,407.27	9,138,709,028.65

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额3,944,589,878.72份。其中A类基金份额净值2.4349元，基金份额3,140,358,955.86份；C类基金份额净值2.3742元，基金份额804,230,922.86份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧创新成长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 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		954,086,765.28	961,631,287.67
1. 利息收入		1,759,198.35	1,306,313.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,745,004.16	1,295,773.31
债券利息收入		-	2,327.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,194.19	8,212.96



证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		940,424,573.09	97,356,739.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	917,205,930.41	84,038,327.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-3,724,340.00
股利收益	6.4.7.15	23,218,642.68	17,042,751.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,344,113.20	857,238,099.73
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	13,247,107.04	5,730,134.87
<b>减：二、费用</b>		111,655,127.16	29,880,944.49
1. 管理人报酬		70,837,884.12	20,252,487.62
2. 托管费		11,806,313.99	3,375,414.64
3. 销售服务费		7,921,711.85	554,485.59
4. 交易费用	6.4.7.18	20,960,085.60	5,579,040.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	8.42
7. 其他费用	6.4.7.19	129,131.60	119,508.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		842,431,638.12	931,750,343.18
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		842,431,638.12	931,750,343.18
-------------------	--	----------------	----------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧创新成长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）	4,127,436,187.54	4,813,917,318.35	8,941,353,505.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	842,431,638.12	842,431,638.12
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）	-182,846,308.82	-44,949,902.17	-227,796,210.99
其中：1. 基金申购款	2,712,624,917.66	3,590,129,011.83	6,302,753,929.49
2. 基金赎回款	-2,895,471,226.48	-3,635,078,914.00	-6,530,550,140.48
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）	3,944,589,878.72	5,611,399,054.30	9,555,988,933.02
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)	1,192,968,733.90	327,651,068.06	1,520,619,801.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	931,750,343.18	931,750,343.18
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)	1,375,872,659.58	736,107,962.62	2,111,980,622.20
其中: 1. 基金申购款	2,608,305,607.50	1,337,995,957.83	3,946,301,565.33
2. 基金赎回款	-1,232,432,947.92	-601,887,995.21	-1,834,320,943.13
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)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,568,841,393.48	1,995,509,373.86	4,564,350,767.34

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

中欧创新成长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[2017]第1720号《关于准予中欧创新成长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《中欧创新成长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。经向中国证监会备案,《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年3月26日正式生效,基金合

同生效日的基金份额总额为2,415,132,504.62份基金份额，其中认购资金利息折合149,076.38份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；不收取认购、申购费用，从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，各类别基金份额之间可以互相转换。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2021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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年

(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利, H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册, H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利, 由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	1,081,823,977.18
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	1,081,823,977.18

##### 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		6,190,621,072.96	8,388,693,178.77	2,198,072,105.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,190,621,072.96	8,388,693,178.77	2,198,072,105.81

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 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	108,533.66
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	16,494.81
应收债券利息	-
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	597.30
合计	125,625.77

#### 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	4,596,705.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,596,705.57

#### 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	289,563.96
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	58,019.55
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出费	581.12
合计	407,672.00

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元



项目 (中欧创新成长灵活配置混合 A)	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	3,240,022,676.26	3,240,022,676.26
本期申购	1,912,017,796.78	1,912,017,796.78
本期赎回(以“-”号填列)	-2,011,681,517.18	-2,011,681,517.18
本期末	3,140,358,955.86	3,140,358,955.86

金额单位：人民币元

项目 (中欧创新成长灵活配置混合 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	887,413,511.28	887,413,511.28
本期申购	800,607,120.88	800,607,120.88
本期赎回(以“-”号填列)	-883,789,709.30	-883,789,709.30
本期末	804,230,922.86	804,230,922.86

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 中欧创新成长灵活配置混合A

单位：人民币元

项目 (中欧创新成长灵活配 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	794,285,449.61	3,016,513,422.12	3,810,798,871.73
本期利润	672,672,362.67	-5,697,604.71	666,974,757.96
本期基金份额交易产 生的变动数	-59,598,471.93	88,014,496.84	28,416,024.91
其中：基金申购款	610,252,971.37	1,962,242,680.62	2,572,495,651.99
基金赎回款	-669,851,443.30	-1,874,228,183.78	-2,544,079,627.08

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,407,359,340.35	3,098,830,314.25	4,506,189,654.60

#### 6.4.7.10.2 中欧创新成长灵活配置混合C

单位：人民币元

项目 (中欧创新成长灵活配置混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	189,917,698.65	813,200,747.97	1,003,118,446.62
本期利润	171,103,388.65	4,353,491.51	175,456,880.16
本期基金份额交易产生的变动数	-36,483,617.00	-36,882,310.08	-73,365,927.08
其中：基金申购款	223,537,251.19	794,096,108.65	1,017,633,359.84
基金赎回款	-260,020,868.19	-830,978,418.73	-1,090,999,286.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	324,537,470.30	780,671,929.40	1,105,209,399.70

#### 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	1,506,421.41
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	203,194.84
其他	35,387.91
合计	1,745,004.16

#### 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	6,984,067,556.58
减：卖出股票成本总额	6,066,861,626.17
买卖股票差价收入	917,205,930.41

#### 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

无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 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	23,218,642.68
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	23,218,642.68

#### 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	-1,344,113.20
——股票投资	-1,344,113.20
——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	-1,344,113.20

#### 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	13,004,984.01
转换费收入	242,123.03
合计	13,247,107.04

#### 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	20,960,085.60
银行间市场交易费用	-
合计	20,960,085.60

#### 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	58,019.55
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,604.68
账户维护费	9,000.00
合计	129,131.60

#### 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，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
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

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 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	
	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	340,188.11	0.00%	40,306,885.45	0.99%

#### 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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	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	170.09	-	-	-
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	34,473.92	0.95%	30,921.33	2.03%

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 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	70,837,884.12	20,252,487.62
其中：支付销售机构的客户维护费	20,267,938.93	5,996,530.97

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 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	11,806,313.99	3,375,414.64

注：支付基金托管人工商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 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		
	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C	合计
中国工商	0.00	94,204.98	94,204.98

银行股份有限公司			
国都证券	0.00	6,972.01	6,972.01
中欧基金	0.00	231,215.44	231,215.44
合计	0.00	332,392.43	332,392.43
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		
	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	50,441.64	50,441.64
国都证券	0.00	11,183.79	11,183.79
中欧基金	0.00	56,574.82	56,574.82
合计	0.00	118,200.25	118,200.25

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，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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

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

中欧创新成长灵活配置混合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	160,387.13	0.01%	385,282.03	0.01%

中欧创新成长灵活配置混合C

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	520,517.84	0.06%	520,517.84	0.06%

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 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	1,081,823,977.18	1,506,421.41	634,990,775.51	1,037,377.47

注：本基金的银行存款由基金托管人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。资产负债表日之后，本报告报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)

#### 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
300724	捷佳伟创	2021-04-26	2021-10-27	非公开发行限售	94.41	106.34	1,271,052	120,000,019.32	135,163,669.68	-
002555	三七互娱	2021-03-08	2021-09-10	非公开发行限	27.77	23.07	1,800,504	49,999,996.0	41,537,627.2	-

				售				8	8	
688383	新益昌	2021-04-21	2021-10-28	新股流通受限	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
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	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
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	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	新股流通受限	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
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	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股流通受限	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688533	上声电子	2021-04-	2021-10-	新股流通	7.72	19.11	3,493	26,965.9	66,751.2	-

		09	19	受限				6	3	
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	新股流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
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	-
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	-
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	-
688517	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
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-	2021-09-	新股流通	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

		11	22	受限					0	
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-	2021-08-	新股流通	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.3	-

		02	09	受限					6	
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	-
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-	2021-07-	新股流通	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

		13	21	受限						
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	新股 流通 受限	8.48	22.0 7	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	新股 流通 受限	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	新股 流通 受限	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	新股 流通 受限	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	新股 流通 受限	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	新股 流通 受限	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 12	新股 流通 受限	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	新股 流通 受限	12.1 0	19.2 9	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 流通 受限	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	新股 流通 受限	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3010 04	嘉益 股份	2021 -06- -	2021 -12- -	新股 流通	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-

		18	27	受限						
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	新股 流通 受限	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 流通 受限	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	新股 流通 受限	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	新股 流通 受限	5.48	13.0 3	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	新股 流通 受限	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	新股 流通 受限	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3009 43	春晖 智控	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	9.79	23.0 1	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
3009 67	晓鸣 股份	2021 -04- 02	2021 -10- 13	新股 流通 受限	4.54	11.5 4	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	新股 流通 受限	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 29	华骐 环保	2021 -01- 12	2021 -07- 21	新股 流通 受限	13.8 7	29.5 5	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- -	2021 -09- -	新股 流通	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-



		22	29	受限						
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,91 7.30	4,91 7.30	-
3009 95	奇德 新材	2021 -05- 17	2021 -11- 26	新股 流通 受限	14.7 2	23.3 2	191	2,81 1.52	4,45 4.12	-
3010 07	德迈 仕	2021 -06- 04	2021 -12- 16	新股 流通 受限	5.29	14.4 4	303	1,60 2.87	4,37 5.32	-
3009 98	宁波 方正	2021 -05- 25	2021 -12- 02	新股 流通 受限	6.02	21.3 2	201	1,21 0.02	4,28 5.32	-
3010 12	扬电 科技	2021 -06- 15	2021 -12- 22	新股 流通 受限	8.05	24.2 6	170	1,36 8.50	4,12 4.20	-
3009 92	泰福 泵业	2021 -05- 17	2021 -11- 25	新股 流通 受限	9.36	20.3 2	200	1,87 2.00	4,06 4.00	-
3010 10	晶雪 节能	2021 -06- 09	2021 -12- 20	新股 流通 受限	7.83	17.6 1	218	1,70 6.94	3,83 8.98	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 流通 受限	9.46	9.46	290	2,74 3.40	2,74 3.40	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，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。在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险

管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	1,081,823,977.18	-	-	-	1,081,823,977.18
结算备付金	252,746,289.95	-	-	-	252,746,289.95
存出保证金	2,941,328.89	-	-	-	2,941,328.89
交易性金融资产	-	-	-	8,388,693,178.77	8,388,693,178.77
应收利息	-	-	-	125,625.77	125,625.77
应收申购款	-	-	-	11,046,006.71	11,046,006.71
资产总计	1,337,511,596.02	-	-	8,399,864,811.25	9,737,376,407.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	56,086,070.38	56,086,070.38
应付赎回款	-	-	-	105,365,975.95	105,365,975.95
应付管理人报酬	-	-	-	11,714,080.91	11,714,080.91
应付托管费	-	-	-	1,952,346.80	1,952,346.80
应付销售服务费	-	-	-	1,264,622.64	1,264,622.64

应付交易费用	-	-	-	4,596,705.57	4,596,705.57
其他负债	-	-	-	407,672.00	407,672.00
负债总计	-	-	-	181,387,474.25	181,387,474.25
利率敏感度缺口	1,337,511,596.02	-	-	8,218,477,337.00	9,555,988,933.02
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	591,640,946.56	-	-	-	591,640,946.56
结算备付金	70,228,225.33	-	-	-	70,228,225.33
存出保证金	8,253,378.76	-	-	-	8,253,378.76
交易性金融资产	-	-	-	8,372,949,378.87	8,372,949,378.87
应收证券清算款	-	-	-	77,858,786.21	77,858,786.21
应收利息	-	-	-	77,045.68	77,045.68
应收申购款	-	-	-	17,701,267.24	17,701,267.24
资产总计	670,122,550.65	-	-	8,468,586,478.00	9,138,709,028.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	83,843,807.34	83,843,807.34
应付赎回款	-	-	-	94,398,192.19	94,398,192.19
应付管理人报酬	-	-	-	11,017,909.67	11,017,909.67
应付托管费	-	-	-	1,836,318.26	1,836,318.26
应付销售服务	-	-	-	1,257,721.28	1,257,721.28

费					
应付交易费用	-	-	-	4,632,463.33	4,632,463.33
其他负债	-	-	-	369,110.69	369,110.69
负债总计	-	-	-	197,355,522.76	197,355,522.76
利率敏感度缺口	670,122,550.65	-	-	8,271,230,955.24	8,941,353,505.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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0.00% (2020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 (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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,387,332,522.31	-	1,387,332,522.31
资产合计	-	1,387,332,522.31	-	1,387,332,522.31
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,387,332,522.31	-	1,387,332,522.31
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	455,904,857.53	-	455,904,857.53
资产合计	-	455,904,857.53	-	455,904,857.53
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	455,904,857.53	-	455,904,857.53

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
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. 港币相对人民币升值5%	69,366,626.12	22,795,242.88
	2. 港币相对人民币贬值5%	-69,366,626.12	-22,795,242.88

#### 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	8,388,693,178.77	87.78	8,372,949,378.87	93.64
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	8,388,693,178.77	87.78	8,372,949,378.87	93.64

#### 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%	1,084,028,933.88	702,549,032.04
	2. 业绩比较基准下降5%	-1,084,028,933.88	-702,549,032.04



#### 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

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 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8,209,781,709.50元，属于第二层次的余额为178,911,469.27元，第三层次的余额为0.00元(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币8,244,574,702.93元，属于第二层次的余额为人民币128,374,675.94元，属于第三层次的余额为0.00元。)

##### (ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

##### (d) 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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,388,693,178.77	86.15
	其中：股票	8,388,693,178.77	86.15
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	1,334,570,267.13	13.71
8	其他各项资产	14,112,961.37	0.14
9	合计	9,737,376,407.27	100.00

注：权益投资中通过港股机制的公允价值为1,387,332,522.31元，占基金总资产比例14.25%。

## 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	-	-
C	制造业	4,607,719,402.55	48.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	262,132,272.48	2.74
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	335,292.06	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	141,433,017.80	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,858,871.93	0.58
J	金融业	136,452,945.11	1.43
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	811,146,345.94	8.49
N	水利、环境和公共设施管理业	47,993.78	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	465,912,477.00	4.88
R	文化、体育和娱乐业	509,396,508.60	5.33
S	综合	10,899,882.00	0.11
	合计	7,001,360,656.46	73.27

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
电信服务	520,853,503.04	5.45
消费者非必需品	469,108,564.65	4.91
信息技术	361,693,942.92	3.78
消费者常用品	34,029,991.80	0.36
医疗保健	1,646,519.90	0.02
合计	1,387,332,522.31	14.52

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	300012	华测检测	17,549,093	559,465,084.84	5.85
2	H00700	腾讯控股	1,071,859	520,853,503.04	5.45
3	300413	芒果超媒	7,322,121	502,297,500.60	5.26
4	600763	通策医疗	1,133,607	465,912,477.00	4.88
5	H02020	安踏体育	2,603,000	395,927,295.07	4.14
6	002821	凯莱英	1,022,154	380,854,580.40	3.99
7	002460	赣锋锂业	2,917,191	353,242,658.19	3.70
8	002709	天赐材料	2,758,812	294,034,182.96	3.08
9	002791	坚朗五金	1,496,505	290,396,795.25	3.04
10	002271	东方雨虹	5,183,038	286,725,662.16	3.00
11	H02382	舜宇光学科技	1,309,500	267,389,989.70	2.80
12	600900	长江电力	12,700,207	262,132,272.48	2.74
13	600519	贵州茅台	116,806	240,234,900.20	2.51
14	603259	药明康德	1,529,263	239,467,293.17	2.51
15	600276	恒瑞医药	3,349,556	227,669,321.32	2.38
16	300750	宁德时代	375,954	201,060,199.20	2.10
17	002812	恩捷股份	677,325	158,561,782.50	1.66
18	600309	万华化学	1,338,135	145,615,850.70	1.52
19	002352	顺丰控股	2,089,114	141,433,017.80	1.48
20	300724	捷佳伟创	1,271,052	135,163,669.68	1.41
21	000858	五粮液	418,971	124,807,271.19	1.31
22	300595	欧普康视	1,194,200	123,659,410.00	1.29
23	688029	南微医学	395,560	123,292,096.40	1.29
24	300760	迈瑞医疗	223,430	107,257,571.50	1.12
25	300059	东方财富	3,086,709	101,213,188.11	1.06
26	002250	联化科技	3,507,026	97,846,025.40	1.02
27	603456	九洲药业	1,998,118	97,068,572.44	1.02
28	002311	海大集团	1,187,120	96,868,992.00	1.01
29	601012	隆基股份	1,081,225	96,056,029.00	1.01
30	300363	博腾股份	1,126,850	94,790,622.00	0.99

31	H01810	小米集团－W	4,197,600	94,303,953.22	0.99
32	688116	天奈科技	729,000	86,022,000.00	0.90
33	H03690	美团－W	274,500	73,181,269.58	0.77
34	300957	贝泰妮	239,022	64,923,057.49	0.68
35	603517	绝味食品	748,778	63,114,497.62	0.66
36	603345	安井食品	224,000	56,900,480.00	0.60
37	688085	三友医疗	1,155,027	50,393,828.01	0.53
38	002555	三七互娱	1,978,225	45,806,485.70	0.48
39	002705	新宝股份	1,666,969	43,757,936.25	0.46
40	002415	海康威视	642,376	41,433,252.00	0.43
41	300014	亿纬锂能	389,800	40,511,914.00	0.42
42	605089	味知香	439,866	38,277,139.32	0.40
43	688696	极米科技	46,002	38,273,664.00	0.40
44	300973	立高食品	244,127	37,825,540.60	0.40
45	600779	水井坊	281,800	35,605,430.00	0.37
46	600036	招商银行	650,300	35,239,757.00	0.37
47	601677	明泰铝业	1,780,361	34,806,057.55	0.36
48	H06969	思摩尔国际	950,000	34,029,991.80	0.36
49	688016	心脉医疗	66,071	30,036,537.31	0.31
50	300782	卓胜微	50,802	27,306,075.00	0.29
51	000568	泸州老窖	113,700	26,826,378.00	0.28
52	300151	昌红科技	971,100	26,161,434.00	0.27
53	605499	东鹏饮料	100,000	25,080,000.00	0.26
54	603816	顾家家居	323,601	25,007,885.28	0.26
55	300896	爱美客	30,300	23,903,064.00	0.25
56	300037	新宙邦	221,426	22,164,742.60	0.23
57	688050	爱博医疗	35,022	13,230,611.16	0.14
58	688179	阿拉丁	81,327	11,405,298.48	0.12
59	600872	中炬高新	271,000	11,387,420.00	0.12
60	000009	中国宝安	596,600	10,899,882.00	0.11
61	603501	韦尔股份	33,500	10,787,000.00	0.11

62	300725	药石科技	65,910	10,473,758.10	0.11
63	603185	上机数控	47,500	8,500,125.00	0.09
64	600570	恒生电子	89,435	8,339,813.75	0.09
65	300144	宋城演艺	422,560	7,099,008.00	0.07
66	002938	鹏鼎控股	142,900	5,127,252.00	0.05
67	688037	芯源微	33,739	5,027,111.00	0.05
68	688690	纳微科技	42,725	5,020,187.50	0.05
69	002475	立讯精密	99,500	4,577,000.00	0.05
70	688127	蓝特光学	146,791	4,082,257.71	0.04
71	300124	汇川技术	44,200	3,282,292.00	0.03
72	603486	科沃斯	12,600	2,873,808.00	0.03
73	002568	百润股份	20,940	1,984,902.60	0.02
74	H06078	海吉亚医疗	19,400	1,646,519.90	0.02
75	300866	安克创新	9,451	1,582,758.97	0.02
76	603290	斯达半导	4,800	1,536,000.00	0.02
77	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.01
78	688083	中望软件	1,837	1,014,575.10	0.01
79	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.01
80	688777	中控技术	5,794	545,505.10	0.01
81	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
82	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.00
83	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.00
84	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
85	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
86	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00
87	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.00
88	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.00
89	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.00
90	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.00
91	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
92	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.00

93	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
94	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.00
95	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.00
96	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.00
97	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.00
98	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.00
99	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
100	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.00
101	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
102	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
103	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
104	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
105	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
106	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
107	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
108	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
109	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
110	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
111	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
112	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
113	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
114	300941	创识科技	489	24,552.06	0.00
115	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
116	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
117	300937	药易购	334	18,057.04	0.00
118	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
119	300932	三友联众	525	16,662.27	0.00
120	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
121	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
122	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
123	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00

124	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
125	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
126	300922	天秦装备	363	12,643.29	0.00
127	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
128	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
129	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
130	300986	志特新材	332	10,808.84	0.00
131	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
132	300948	冠中生态	379	10,474.13	0.00
133	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
134	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
135	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
136	300931	通用电梯	713	9,360.14	0.00
137	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
138	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
139	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
140	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
141	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
142	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
143	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
144	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
145	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
146	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
147	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
148	300963	中洲特材	330	7,821.67	0.00
149	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
150	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
151	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
152	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
153	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
154	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00



155	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
156	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
157	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
158	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
159	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
160	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
161	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
162	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
163	000888	峨眉山 A	100	641.00	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	H00700	腾讯控股	581,263,771.87	6.50
2	H03690	美团-W	533,942,243.85	5.97
3	H02020	安踏体育	405,864,765.85	4.54
4	600763	通策医疗	262,318,700.28	2.93
5	600900	长江电力	260,565,721.75	2.91
6	600276	恒瑞医药	243,933,275.29	2.73
7	002460	赣锋锂业	183,405,419.23	2.05
8	002352	顺丰控股	175,999,627.86	1.97
9	600519	贵州茅台	169,782,709.98	1.90
10	H02382	舜宇光学科技	150,817,846.19	1.69
11	H00388	香港交易所	140,320,924.74	1.57
12	002271	东方雨虹	131,819,580.62	1.47
13	H06969	思摩尔国际	127,561,723.46	1.43
14	300750	宁德时代	125,915,238.50	1.41

15	300724	捷佳伟创	120,000,019.32	1.34
16	000333	美的集团	106,022,727.38	1.19
17	000858	五粮液	97,690,596.67	1.09
18	H01810	小米集团 -W	97,488,540.23	1.09
19	300413	芒果超媒	94,348,439.50	1.06
20	688029	南微医学	91,060,812.19	1.02

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	601012	隆基股份	535,489,319.86	5.99
2	H03690	美团-W	459,611,611.83	5.14
3	000333	美的集团	457,698,388.13	5.12
4	000858	五粮液	453,386,727.25	5.07
5	600309	万华化学	397,454,433.45	4.45
6	002352	顺丰控股	349,449,323.47	3.91
7	600519	贵州茅台	341,758,259.47	3.82
8	H00700	腾讯控股	269,165,043.01	3.01
9	002460	赣锋锂业	251,352,559.33	2.81
10	300124	汇川技术	205,237,797.56	2.30
11	002271	东方雨虹	199,339,517.38	2.23
12	002555	三七互娱	143,165,654.98	1.60
13	002127	南极电商	136,776,004.01	1.53
14	600438	通威股份	132,598,054.08	1.48
15	H00388	香港交易所	130,242,038.02	1.46
16	002241	歌尔股份	119,676,167.75	1.34
17	002311	海大集团	112,035,453.21	1.25

18	300037	新宙邦	108,551,892.04	1.21
19	300274	阳光电源	102,919,944.30	1.15
20	002475	立讯精密	98,268,167.50	1.10

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	6,083,949,539.27
卖出股票收入（成交）总额	6,984,067,556.58

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 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 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。以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，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持有国债期货。

### 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 本基金投资的腾讯控股的发行主体腾讯控股有限公司于2021年4月28日受到国家市场监督管理总局的国市监处（2021）31号，于2021年4月28日受到国家市场监督管理总局的国市监处（2021）30号，于2021年3月12日受到国家市场监督管理总局的国市监处（2021）13号。罚款合计150万元人民币。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,941,328.89
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	125,625.77
5	应收申购款	11,046,006.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,112,961.37

#### 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 创新 成长 灵活 配置 混合A	161, 064	19,497.58	1,676,592,270. 60	53.3 9%	1,463,766,685. 26	46.61%

中欧创新成长灵活配置混合C	214,620	3,747.23	46,777,219.87	5.82%	757,453,702.99	94.18%
合计	375,684	10,499.75	1,723,369,490.47	43.69%	2,221,220,388.25	56.31%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧创新成长灵活配置混合A	2,582,767.19	0.08%
	中欧创新成长灵活配置混合C	526,072.25	0.07%
	合计	3,108,839.44	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	中欧创新成长灵活配置混合A	>100
	中欧创新成长灵活配置混合C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧创新成长灵活配置混合A	>100
	中欧创新成长灵活配置混合C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧创新成长灵活配置 混合A	中欧创新成长灵活配置 混合C
基金合同生效日(2018年03月26日)基金份额总额	2,309,389,951.69	105,742,552.93
本报告期期初基金份额总额	3,240,022,676.26	887,413,511.28
本报告期基金总申购份额	1,912,017,796.78	800,607,120.88
减：本报告期基金总赎回份额	2,011,681,517.18	883,789,709.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,140,358,955.86	804,230,922.86

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普华永道中天会计师事务所（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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	447,215,932.32	3.47%	416,492.10	3.91%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	897,395,128.38	6.96%	835,745.13	7.85%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	361,866,793.04	2.81%	336,999.48	3.16%	-
东吴证券	1	512,942,917.96	3.98%	477,705.12	4.49%	-
东兴	1	-	-	-	-	-



证券						
光大证券	1	1,340,349,903.01	10.40%	1,248,269.44	11.72%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	522,758,108.84	4.06%	486,845.61	4.57%	-
国泰君安	1	3,425,682,596.81	26.58%	1,839,298.32	17.27%	-
国信证券	1	370,933,190.63	2.88%	345,454.75	3.24%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	195,582,244.38	1.52%	182,146.04	1.71%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	209,401,866.79	1.62%	195,016.19	1.83%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	1,405,295,857.48	10.90%	1,308,746.38	12.29%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	169,896,507.87	1.32%	158,221.52	1.49%	-
浙商证券	1	624,168,153.20	4.84%	581,285.04	5.46%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	944,903,955.97	7.33%	879,991.28	8.26%	-

中信 证券	1	169,945,214.08	1.32%	158,270.70	1.49%	-
中信 证券 (华 南)	1	-	-	-	-	-
国都 证券	2	340,188.11	0.00%	170.09	0.00%	-
中泰 证券	2	1,288,585,548.61	10.00%	1,200,062.65	11.27%	-

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

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	中欧创新成长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	中欧管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-10
3	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2021-03-22
4	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年3月）	中国证监会指定媒介	2021-03-24

5	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-03-24
6	中欧创新成长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
7	中欧创新成长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
8	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021-04-28

## § 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、中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧创新成长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](http://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