

中欧匠心两年持有期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	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	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
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	49
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中欧匠心两年持有期混合	
基金主代码	006529	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2019年06月11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	4,060,654,286.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	006529	006530
报告期末下属分级基金的份额总额	3,662,772,918.63份	397,881,368.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	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	沪深300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。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	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人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)	
	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C
本期已实现收益	668,578,196.37	79,213,949.08
本期利润	182,075,724.10	24,591,420.24
加权平均基金份额本期利润	0.0623	0.0746
本期加权平均净值利润率	3.71%	4.45%
本期基金份额净值增长率	5.12%	4.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C
期末可供分配利润	1,391,276,835.16	148,049,376.54
期末可供分配基金份额利润	0.3798	0.3721
期末基金资产净值	6,192,995,476.65	669,507,500.90
期末基金份额净值	1.6908	1.6827
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C
基金份额累计净值增长率	88.34%	86.79%

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

中欧匠心两年持有期混合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	0.17%	0.80%	-1.22%	0.48%	1.39%	0.32%
过去三个月	5.02%	0.91%	2.33%	0.59%	2.69%	0.32%
过去六个月	5.12%	1.47%	0.65%	0.79%	4.47%	0.68%
过去一年	48.47%	1.46%	15.09%	0.80%	33.38%	0.66%
自基金合同 生效起至今	88.34%	1.35%	26.99%	0.76%	61.35%	0.59%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 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。

中欧匠心两年持有期混合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	0.14%	0.80%	-1.22%	0.48%	1.36%	0.32%
过去三个月	4.92%	0.91%	2.33%	0.59%	2.59%	0.32%
过去六个月	4.91%	1.47%	0.65%	0.79%	4.26%	0.68%
过去一年	47.88%	1.46%	15.09%	0.80%	32.79%	0.66%
自基金合同 生效起至今	86.79%	1.35%	26.99%	0.76%	59.80%	0.59%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 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

中欧匠心两年持有期混合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

(2019年06月11日-2021年06月30日)



中欧匠心两年持有期混合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

(2019年06月11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		
周蔚文	权益投决会主席/投资总监/基金经理	2019-06-11	-	22年	历任光大证券研究所研究员，富国基金研究员、高级研究员、基金经理。2011/01/10加入中欧基金管理有限公司，历任研究部总监、副总经理、权益投决会委员。
凌莉	基金经理助理	2019-06-19	-	13年	2008/01/07加入中欧基金管理有限公司，历任培训生、助理研究员、研究员、金融工程研究员兼风控专员、基金经理助理、基金经理、交易员。

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

回顾上半年，疫苗接种的大范围铺开强化了市场对国内经济持续恢复和海外经济快速反弹的预期，而全球总需求向好叠加疫情带来的供给约束导致了全球大宗商品价格飙涨，PPI的快速上行提高了输入型通胀的可能，也使市场对货币政策紧缩的担忧进一步加剧。2月中旬到3月下旬，美国10年期国债收益率快速上行，包括A股在内的全球股市大震荡，市场资金纷纷从高估值的TMT、汽车、食品饮料板块逃离涌入了低估值的钢铁、银行等板块。但4月之后，美元指数走弱，国债收益率下行，流动性紧缩压力缓解，国内的货币政策也是持续保持相对宽松状态。与之相对应，一季度流入低估值板块的资金出现回流，电气设备、新能源汽车、半导体等板块迅速收复失地并迭创新高，市场的风险偏好重回成长类股票，而银行地产等低估值板块再受冷落。

本基金净值在报告期内弹性相对较弱，主要原因是组合中配置了较多受疫情影响大，估值仍处于低位的板块，但由于市场流动性好于预期，市场偏好出现了变化，同时部分地区疫情出现反复，导致部分行业的复苏速度不达预期，而使组合中个股表现不佳。

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5.12%，同期业绩比较基准收益率为0.65%；C类份额净值增长率为4.91%，同期业绩比较基准收益率为0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为：首先，全球宏观经济仍在复苏轨道，但由于疫情的持续演变增加了复苏的不确定性，中国经济增长在四季度开始环比钝化，总量稳增长有压力；其次，配合经济“稳增长、调结构”的目标，预计国内流动性会保持合理充裕，呈现相对宽松的货币政策和结构性紧信用相结合的局面，而海外全球资本市场受美联储回收流动性影响较大；最后，目前股市经过两年结构性牛市，整体估值不低，有部分结构性泡沫，也有估值合理或低估的板块，还存在结构性机会。

投资机会分为两类，一是未来多年景气持续向好的新兴行业，如新能源、自动驾驶、物联网、AI、云计算、创新药、创新医疗器械、医疗服务等，但这些行业大部分估值偏高；第二类是是市值与景气处于低位的行业，如餐饮、酒店、旅游、航空、博彩、银行、地产等，这些行业受疫情影响大，估值还处于低位。第一类是长期性机会，我们将耐心等待，寻找长期成长性配得上高估值的个股，寻找合适的买点；第二类投资机会在未来一段时间获取超额收益的概率更高。我们尽力寻找未来行业好转的中长期机会，在合适的价格买入受益行业好转而业绩高增长的股票，尽力创造更大的超额收益率。

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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

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匠心两年持有期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，中欧匠心两年持有期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匠心两年持有期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匠心两年持有期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：中欧匠心两年持有期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	632,266,122.38	262,197,593.32
结算备付金		47,612,390.70	1,140,028.26
存出保证金		643,952.58	6,571,436.33
交易性金融资产	6.4.7.2	5,496,066,366.86	3,462,248,515.53
其中: 股票投资		5,494,361,158.76	3,460,460,911.83
基金投资		-	-
债券投资		1,705,208.10	1,787,603.70
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	685,800,000.00	-
应收证券清算款		-	27,689,505.36
应收利息	6.4.7.5	91,531.27	38,414.20
应收股利		6,474,337.73	-
应收申购款		28,146,713.37	3,777,934.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,897,101,414.89	3,763,663,427.83
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		7,284,658.59	44,770,161.24
应付赎回款		13,329,306.69	-
应付管理人报酬		8,849,319.53	4,302,469.05
应付托管费		1,474,886.57	717,078.18

应付销售服务费		222,545.55	125,991.72
应付交易费用	6.4.7.7	3,323,596.18	1,008,361.42
应交税费		66.37	15.27
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,057.86	215,000.00
负债合计		34,598,437.34	51,139,076.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,060,654,286.84	2,184,313,079.47
未分配利润	6.4.7.10	2,801,848,690.71	1,528,211,271.48
所有者权益合计		6,862,502,977.55	3,712,524,350.95
负债和所有者权益总计		6,897,101,414.89	3,763,663,427.83

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值为人民币1.6900元，基金份额总额4,060,654,286.84份。其中下属A类基金份额参考净值为人民币1.6908元，基金份额总额3,662,772,918.63份；下属C类基金份额参考净值为人民币1.6827元，基金份额总额397,881,368.21份。

6.2 利润表

会计主体：中欧匠心两年持有期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
一、收入		268,556,475.22	414,578,419.53
1. 利息收入		3,098,594.66	645,359.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,153,760.00	596,759.01
债券利息收入		4,203.22	801.98
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		1,940,631.44	47,798.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		806,582,881.67	165,057,209.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	776,814,397.28	143,974,150.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	191,726.24
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	29,768,484.39	20,891,332.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-541,125,001.11	248,875,850.90
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	-	-
减：二、费用		61,889,330.88	26,711,954.99
1. 管理人报酬		40,514,304.07	16,171,503.74
2. 托管费		6,752,383.98	2,695,250.60
3. 销售服务费		1,092,057.99	309,607.66
4. 交易费用	6.4.7.18	13,414,590.15	7,427,549.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		15.06	2.91
7. 其他费用	6.4.7.19	115,979.63	108,041.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		206,667,144.34	387,866,464.54

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		206,667,144.34	387,866,464.54

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧匠心两年持有期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）	2,184,313,079.47	1,528,211,271.48	3,712,524,350.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	206,667,144.34	206,667,144.34
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）	1,876,341,207.37	1,289,865,995.59	3,166,207,202.96
其中：1. 基金申购款	2,485,517,872.41	1,695,539,495.75	4,181,057,368.16
2. 基金赎回款	-609,176,665.04	-405,673,500.16	-1,014,850,165.20
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）	-	-222,895,720.70	-222,895,720.70
五、期末所有者权益（基金净值）	4,060,654,286.84	2,801,848,690.71	6,862,502,977.55
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)	1,894,945,953.36	127,514,652.72	2,022,460,606.08
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	387,866,464.54	387,866,464.54
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)	97,446,588.19	13,004,506.41	110,451,094.60
其中: 1. 基金申购款	97,446,588.19	13,004,506.41	110,451,094.60
2. 基金赎回 款	-	-	-
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)	-	-122,612,665.25	-122,612,665.25
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,992,392,541.55	405,772,958.42	2,398,165,499.97

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

中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1506号文《关于准予中欧匠心两年持有期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《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资

金利息共募集人民币1,125,824,848.98元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第61336106_B07号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2019年6月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,126,266,286.12份基金份额,其中包含认购利息折合441,437.14份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为1,023,282,930.85份,包含认购利息折合392,221.38份;C类基金的基金份额总额为102,983,355.27份,包含认购利息折合49,215.76份。本基金的基金管理人与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》和《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、衍生工具(包括权证、股指期货、股票期权、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)。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%。在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中债综合指数收益率 $\times$ 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. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	632,266,122.38
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	632,266,122.38

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		5,038,687,753.33	5,494,361,158.76	455,673,405.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,731,000.00	1,705,208.10	-25,791.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,731,000.00	1,705,208.10	-25,791.90
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,040,418,753.33	5,496,066,366.86	455,647,613.53

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

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		685,800,000.00	-
银行间市场		-	-
合计		685,800,000.00	-

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	58,203.37
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	32,446.34
应收债券利息	591.86
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	289.70
合计	91,531.27

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	3,323,596.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,323,596.18

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	54,547.97
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出补差费	2.52
合计	114,057.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧匠心两年持有期混合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	1,938,307,512.56	1,938,307,512.56
本期申购	2,313,363,646.36	2,313,363,646.36
本期赎回（以“-”号填列）	-588,898,240.29	-588,898,240.29
本期末	3,662,772,918.63	3,662,772,918.63

金额单位：人民币元

项目 (中欧匠心两年持有期混合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	246,005,566.91	246,005,566.91
本期申购	172,154,226.05	172,154,226.05
本期赎回（以“-”号填列）	-20,278,424.75	-20,278,424.75
本期末	397,881,368.21	397,881,368.21

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 中欧匠心两年持有期混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(中欧匠心两年持有期混合A)			
上年度末	392,841,949.30	964,246,522.93	1,357,088,472.23
本期利润	668,578,196.37	-486,502,472.27	182,075,724.10
本期基金份额交易产生的变动数	526,585,332.35	661,201,672.20	1,187,787,004.55
其中：基金申购款	740,073,018.67	840,039,923.65	1,580,112,942.32
基金赎回款	-213,487,686.32	-178,838,251.45	-392,325,937.77
本期已分配利润	-196,728,642.86	-	-196,728,642.86
本期末	1,391,276,835.16	1,138,945,722.86	2,530,222,558.02

6.4.7.10.2 中欧匠心两年持有期混合C

单位：人民币元

项目 (中欧匠心两年持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,996,681.24	122,126,118.01	171,122,799.25
本期利润	79,213,949.08	-54,622,528.84	24,591,420.24
本期基金份额交易产生的变动数	46,005,824.06	56,073,166.98	102,078,991.04
其中：基金申购款	53,240,567.89	62,185,985.54	115,426,553.43
基金赎回款	-7,234,743.83	-6,112,818.56	-13,347,562.39
本期已分配利润	-26,167,077.84	-	-26,167,077.84
本期末	148,049,376.54	123,576,756.15	271,626,132.69

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	978,204.05
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	137,725.58
其他	37,830.37
合计	1,153,760.00

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	3,595,485,790.23
减：卖出股票成本总额	2,818,671,392.95
买卖股票差价收入	776,814,397.28

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	29,768,484.39
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	29,768,484.39

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	-541,125,001.11
——股票投资	-541,042,605.51
——债券投资	-82,395.60
——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	-541,125,001.11

6.4.7.17 其他收入

无。

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	13,414,590.15
银行间市场交易费用	-

合计	13,414,590.15
----	---------------

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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,924.29
合计	115,979.63

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
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东
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 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	40,514,304.07	16,171,503.74
其中：支付销售机构的客户维护费	21,403,727.93	9,548,920.89

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	6,752,383.98	2,695,250.60

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%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3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		
	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	5,341.98	5,341.98
合计	0.00	5,341.98	5,341.98
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		
	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	2,141.36	2,141.36
合计	0.00	2,141.36	2,141.36

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 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

中欧匠心两年持有期混合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	1,853,582.86	0.05%	0.00	0.00%

注：

- 1、本报告期，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、本报告期末及上年度期末，除管理人之外的其他关联方均未持有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	632,266,122.38	978,204.05	144,157,887.76	500,621.39

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

中欧匠心两年持有期混合A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-01-21	2021-01-21	1.000	196,728,642.86	-	196,728,642.86	-
合计			1.000	196,728,642.86	-	196,728,642.86	-

中欧匠心两年持有期混合C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-01-21	2021-01-21	1.000	26,167,077.84	-	26,167,077.84	-
合计			1.000	26,167,077.84	-	26,167,077.84	-

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	264,802	24,999.956.82	28,159.044.68	-
002705	新宝股份	2021-01-06	2021-07-12	非公开发 行限售	38.25	25.89	679,450	25,988.962.50	17,590.960.50	-
000063	中兴通讯	2020-02-04	2022-02-04	非公开发 行限售	30.21	31.16	564,490	17,053.242.90	17,589.508.40	-
300572	安车检测	2021-04-30	2021-11-08	非公开发 行限售	32.50	30.66	307,692	9,999.990.00	9,433.836.72	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股流 通受限	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-

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	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股流通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
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	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
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	-
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	新股流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
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	-
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	新股流通受限	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
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	-

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	-
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	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
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	-

3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 流通 受限	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 32	三友 联众	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 流通 受限	24.6 9	31.7 1	492	12,1 47.4 8	15,6 01.3 2	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 流通 受限	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	新股 流通 受限	6.87	12.0 7	1,162	7,98 2.94	14,0 25.3 4	-
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	新股 流通 受限	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	新股 流通 受限	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3009 37	药易 购	2021 -01- 20	2021 -07- 27	新股 流通 受限	12.2 5	53.7 1	244	2,98 9.00	13,1 05.2 4	-
3009 42	易瑞 生物	2021 -02- 02	2021 -08- 09	新股 流通 受限	5.31	28.5 2	443	2,35 2.33	12,6 34.3 6	-
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 流通 受限	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	-
3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	新股 流通 受限	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	-

605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
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	-

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。在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、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于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。在开放期，本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于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约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	632,266,122.38	-	-	-	632,266,122.38
结算备付金	47,612,390.70	-	-	-	47,612,390.70
存出保证金	643,952.58	-	-	-	643,952.58
交易性金融资产	-	1,705,208.10	-	5,494,361,158.76	5,496,066,366.86
买入返售金融资产	685,800,000.00	-	-	-	685,800,000.00
应收利息	-	-	-	91,531.27	91,531.27
应收股利	-	-	-	6,474,337.73	6,474,337.73
应收申购款	-	-	-	28,146,713.37	28,146,713.37
资产总计	1,366,322,465.66	1,705,208.10	-	5,529,073,741.13	6,897,101,414.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,284,658.59	7,284,658.59
应付赎回款	-	-	-	13,329,306.69	13,329,306.69
应付管理人报酬	-	-	-	8,849,319.53	8,849,319.53
应付托管费	-	-	-	1,474,886.57	1,474,886.57
应付销	-	-	-	222,545.55	222,545.55

售服务费					
应付交易费用	-	-	-	3,323,596.18	3,323,596.18
应交税费	-	-	-	66.37	66.37
其他负债	-	-	-	114,057.86	114,057.86
负债总计	-	-	-	34,598,437.34	34,598,437.34
利率敏感度缺口	1,366,322,465.66	1,705,208.10	-	5,494,475,303.79	6,862,502,977.55
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	262,197,593.32	-	-	-	262,197,593.32
结算备付金	1,140,028.26	-	-	-	1,140,028.26
存出保证金	6,571,436.33	-	-	-	6,571,436.33
交易性金融资产	-	-	1,787,603.70	3,460,460,911.83	3,462,248,515.53
应收证券清算款	-	-	-	27,689,505.36	27,689,505.36
应收利息	-	-	-	38,414.20	38,414.20
应收申购款	-	-	-	3,777,934.83	3,777,934.83
资产总计	269,909,057.91	-	1,787,603.70	3,491,966,766.22	3,763,663,427.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	44,770,161.24	44,770,161.24
应付管理人报酬	-	-	-	4,302,469.05	4,302,469.05
应付托管费	-	-	-	717,078.18	717,078.18

应付销售服务费	-	-	-	125,991.72	125,991.72
应付交易费用	-	-	-	1,008,361.42	1,008,361.42
应交税费	-	-	-	15.27	15.27
其他负债	-	-	-	215,000.00	215,000.00
负债总计	-	-	-	51,139,076.88	51,139,076.88
利率敏感度缺口	269,909,057.91	-	1,787,603.70	3,440,827,689.34	3,712,524,350.95

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0.02% (2020年12月31日:0.05%), 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	-	2,328,689.39 6.52	-	2,328,689.39 6.52
应收股利	-	6,474,337.73	-	6,474,337.73

资产合计	-	2,335,163,73 4.25	-	2,335,163,73 4.25
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	-	2,335,163,73 4.25	-	2,335,163,73 4.25
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	-	1,661,663,99 5.76	-	1,661,663,99 5.76
资产合计	-	1,661,663,99 5.76	-	1,661,663,99 5.76
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	-	1,661,663,99 5.76	-	1,661,663,99 5.76

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%	116,434,469.83	83,083,199.79
	2. 港币相对人民币贬值5%	-116,434,469.83	-83,083,199.79

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	5,494,361,158.76	80.06	3,460,460,911.83	93.21
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	5,494,361,158.76	80.06	3,460,460,911.83	93.21

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%	541,134,822.24	275,450,783.17
	2. 业绩比较基准下降5%	-541,134,822.24	-275,450,783.17

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，因其剩余期限不长，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5,420,630,810.13元，属于第二层次的余额为人民币75,435,556.73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3,420,922,156.44元，属于第二层次的余额为人民币41,326,359.09元，属于第三层次的余额为0.00元。)

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	5,494,361,158.76	79.66
	其中：股票	5,494,361,158.76	79.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,705,208.10	0.02
	其中：债券	1,705,208.10	0.02
	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	685,800,000.00	9.94
	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	679,878,513.08	9.86
8	其他各项资产	35,356,534.95	0.51
9	合计	6,897,101,414.89	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,328,689,396.52元，占基金总资产比例33.76%。

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	38,147.08	0.00
B	采矿业	50,769,795.69	0.74
C	制造业	2,032,188,262.41	29.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,047.59	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	439,448,591.62	6.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,735,080.85	0.51
J	金融业	270,253,376.07	3.94
K	房地产业	11,902,619.00	0.17
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	103,042,058.68	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	62,030,198.09	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	33,089,551.53	0.48
R	文化、体育和娱乐业	127,704,444.00	1.86
S	综合	-	-
	合计	3,165,671,762.24	46.13

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(%)
消费者非必需品	625,282,575.15	9.11
信息技术	412,845,761.37	6.02
电信服务	403,989,667.67	5.89
医疗保健	248,842,323.24	3.63
消费者常用品	185,311,496.70	2.7
工业	163,717,797.54	2.39
地产业	102,479,505.33	1.49
公用事业	89,975,140.22	1.31
基础材料	75,981,551.62	1.11

金融	20,202,669.42	0.29
能源	60,908.26	0.00
合计	2,328,689,396.52	33.93

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	600346	恒力石化	14,535,536	381,412,464.64	5.56
2	H00700	腾讯控股	652,500	317,072,404.80	4.62
3	002142	宁波银行	6,932,411	270,156,056.67	3.94
4	H02382	舜宇光学科技	1,306,600	266,797,831.65	3.89
5	H00027	银河娱乐	4,838,000	250,191,228.94	3.65
6	600519	贵州茅台	121,494	249,876,709.80	3.64
7	000858	五粮液	809,103	241,023,692.67	3.51
8	600660	福耀玻璃	4,259,300	237,881,905.00	3.47
9	H00175	吉利汽车	10,516,000	213,941,247.70	3.12
10	601012	隆基股份	2,239,160	198,926,974.40	2.90
11	H00763	中兴通讯	7,238,000	146,047,929.72	2.13
11	000063	中兴通讯	564,790	17,599,477.40	0.26
12	H00291	华润啤酒	2,778,000	161,228,397.24	2.35
13	002460	赣锋锂业	700,032	84,766,874.88	1.24
13	H01772	赣锋锂业	787,200	75,981,551.62	1.11
14	601021	春秋航空	2,715,415	154,507,113.50	2.25
15	H01138	中远海能	38,894,000	117,153,768.66	1.71
15	600026	中远海能	4,816,500	29,669,640.00	0.43
16	300014	亿纬锂能	1,395,978	145,083,993.54	2.11
17	300144	宋城演艺	7,601,455	127,704,444.00	1.86
18	603885	吉祥航空	8,056,937	122,948,858.62	1.79

19	600887	伊利股份	2,787,738	102,672,390.54	1.50
20	H01995	永升生活服务	6,388,000	102,479,505.33	1.49
21	H02020	安踏体育	667,000	101,453,517.41	1.48
22	002352	顺丰控股	1,483,027	100,400,927.90	1.46
23	H00902	华能国际电力股份	35,570,000	89,975,140.22	1.31
24	H00728	中国电信	35,802,000	86,689,272.95	1.26
25	300724	捷佳伟创	740,128	83,301,613.94	1.21
26	300012	华测检测	2,612,300	83,280,124.00	1.21
27	000301	东方盛虹	3,861,768	80,710,951.20	1.18
28	H02500	启明医疗－B	1,394,500	75,131,727.51	1.09
29	H06198	青岛港	13,075,000	46,564,028.88	0.68
29	601298	青岛港	4,572,620	28,258,791.60	0.41
30	002493	荣盛石化	3,542,585	61,180,442.95	0.89
31	H09996	沛嘉医疗－B	2,015,000	60,610,579.38	0.88
32	H01928	金沙中国有限公司	2,194,000	59,696,581.10	0.87
33	H01789	爱康医疗	5,044,000	57,499,057.82	0.84
34	H01873	维亚生物	6,722,500	55,600,958.53	0.81
35	601899	紫金矿业	5,239,401	50,769,795.69	0.74
36	300613	富瀚微	221,623	34,546,593.24	0.50
37	600054	黄山旅游	3,480,739	34,250,471.76	0.50
38	002044	美年健康	3,632,223	33,089,551.53	0.48
39	600201	生物股份	1,777,711	31,021,056.95	0.45
40	002705	新宝股份	1,122,950	29,232,835.50	0.43
41	300572	安车检测	856,861	27,248,879.08	0.40
42	300816	艾可蓝	284,200	24,264,996.00	0.35
43	H01579	颐海国际	555,000	24,083,099.46	0.35
44	H06886	HTSC	2,129,800	20,202,669.42	0.29
45	688133	泰坦科技	58,369	18,553,754.03	0.27
46	002920	德赛西威	154,599	17,018,257.92	0.25

47	688200	华峰测控	35,270	16,694,349.10	0.24
48	300487	蓝晓科技	156,800	13,265,280.00	0.19
49	000002	万科 A	499,900	11,902,619.00	0.17
50	002928	华夏航空	242,600	3,663,260.00	0.05
51	002033	丽江股份	550,840	3,470,292.00	0.05
52	605089	味知香	23,900	2,079,778.00	0.03
53	002812	恩捷股份	6,800	1,591,880.00	0.02
54	688538	和辉光电	375,156	1,429,344.36	0.02
55	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.01
56	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.01
57	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.01
58	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
59	688085	三友医疗	8,807	384,249.41	0.01
60	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
61	688221	前沿生物	16,148	341,045.76	0.00
62	688166	博瑞医药	8,041	336,194.21	0.00
63	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
64	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.00
65	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.00
66	002967	广电计量	5,800	254,040.00	0.00
67	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
68	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
69	H02400	心动公司	4,000	227,989.92	0.00
70	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.00
71	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
72	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.00
73	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.00
74	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
75	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.00
76	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.00
77	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00

78	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.00
79	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
80	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.00
81	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
82	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
83	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
84	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.00
85	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.00
86	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
87	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
88	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
89	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
90	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.00
91	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
92	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
93	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
94	H01907	中国旭阳集团	15,000	60,908.26	0.00
95	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
96	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
97	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
98	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
99	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
100	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
101	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
102	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
103	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
104	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
105	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
106	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
107	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
108	300894	火星人	628	42,704.00	0.00

109	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
110	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
111	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
112	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00
113	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
114	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
115	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
116	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
117	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
118	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
119	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
120	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
121	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
122	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
123	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
124	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
125	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
126	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
127	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
128	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
129	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
130	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
131	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
132	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
133	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
134	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
135	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
136	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
137	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
138	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
139	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00

140	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
141	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
142	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
143	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
144	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
145	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
146	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
147	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
148	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
149	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
150	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
151	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
152	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
153	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
154	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
155	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
156	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
157	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
158	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
159	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
160	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
161	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
162	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
163	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
164	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
165	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
166	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
167	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
168	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
169	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
170	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

171	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
172	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
173	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
174	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	600346	恒力石化	452,734,231.71	12.19
2	000858	五粮液	231,941,229.38	6.25
3	H00027	银河娱乐	218,546,040.35	5.89
4	600660	福耀玻璃	214,651,139.76	5.78
5	601318	中国平安	196,949,567.00	5.31
6	H00175	吉利汽车	194,220,821.68	5.23
7	600519	贵州茅台	180,245,453.02	4.86
8	H01810	小米集团—W	178,677,179.22	4.81
9	603288	海天味业	172,336,847.22	4.64
10	601021	春秋航空	162,795,665.19	4.39
11	H00291	华润啤酒	161,877,384.85	4.36
12	300122	智飞生物	155,692,349.86	4.19
13	601012	隆基股份	154,727,374.57	4.17
14	H00700	腾讯控股	150,202,646.68	4.05
15	H00883	中国海洋石油	146,540,971.55	3.95
16	300014	亿纬锂能	143,620,045.06	3.87
17	300144	宋城演艺	137,185,897.67	3.70
18	600438	通威股份	133,303,769.60	3.59
19	000961	中南建设	108,482,144.16	2.92

20	002142	宁波银行	107,389,132.64	2.89
21	002460	赣锋锂业	105,810,118.40	2.85
22	H03690	美团-W	103,635,767.67	2.79
23	H01995	永升生活服务	97,726,495.27	2.63
24	H02382	舜宇光学科技	96,757,757.96	2.61
25	H01928	金沙中国有限公司	91,876,875.66	2.47
26	603799	华友钴业	88,128,283.13	2.37
27	H02500	启明医疗-B	87,755,185.33	2.36
28	H00728	中国电信	79,547,443.77	2.14

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	H01810	小米集团-W	291,427,924.84	7.85
2	H02333	长城汽车	254,289,404.26	6.85
3	H02899	紫金矿业	243,361,956.22	6.56
4	000002	万科A	238,458,669.54	6.42
5	601318	中国平安	187,709,293.93	5.06
6	H00883	中国海洋石油	176,975,926.23	4.77
7	603288	海天味业	164,018,482.42	4.42
8	601899	紫金矿业	138,746,031.63	3.74
9	H00175	吉利汽车	135,874,755.23	3.66
10	300122	智飞生物	133,623,834.75	3.60
11	600438	通威股份	110,358,034.05	2.97

12	002460	赣锋锂业	96,608,681.78	2.60
13	000961	中南建设	95,749,225.79	2.58
14	H03690	美团-W	90,568,686.68	2.44
15	H02269	药明生物	88,990,472.40	2.40
16	603799	华友钴业	88,574,697.59	2.39
17	000858	五粮液	81,706,013.66	2.20
18	H01907	中国旭阳集团	77,059,829.47	2.08
19	H01772	赣锋锂业	72,420,858.98	1.95
20	002920	德赛西威	71,913,448.45	1.94

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	5,393,614,245.39
卖出股票收入（成交）总额	3,595,485,790.23

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)	1,705,208.10	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,705,208.10	0.02
----	----	--------------	------

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	113584	家悦转债	17,310	1,705,208.10	0.02

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

本基金将以套期保值为目的，参与股指期货的投资。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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。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。本基金投资的宁波银行的发行主体宁波银行股份有限公司于2020-10-16受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2020）48号，于2021-06-10受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2021）36号。罚款合计55万元。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	643,952.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	6,474,337.73
4	应收利息	91,531.27
5	应收申购款	28,146,713.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	35,356,534.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113584	家悦转债	1,705,208.10	0.02

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
中欧匠心两年持有期混合A	68,729	53,292.98	21,033,782.56	0.57%	3,641,739,136.07	99.43%

中欧匠心两年持有期混合C	64,655	6,153.91	5,004,807.33	1.26%	392,876,560.88	98.74%
合计	133,384	30,443.34	26,038,589.89	0.64%	4,034,615,696.95	99.36%

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	中欧匠心两年持有期混合A	3,786,491.73	0.10%
	中欧匠心两年持有期混合C	17,892.29	0.00%
	合计	3,804,384.02	0.09%

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金C份额实际比例为0.0045%。上表中的份额占比是经过四舍五入的结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧匠心两年持有期混合A	>100
	中欧匠心两年持有期混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧匠心两年持有期混合A	>100
	中欧匠心两年持有期混合C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧匠心两年持有期混合A	中欧匠心两年持有期混合C
基金合同生效日(2019年06月11日)基金份额总额	1,023,282,930.85	102,983,355.27
本报告期期初基金份额总额	1,938,307,512.56	246,005,566.91
本报告期基金总申购份额	2,313,363,646.36	172,154,226.05
减：本报告期基金总赎回份额	588,898,240.29	20,278,424.75
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,662,772,918.63	397,881,368.21

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	315,222,715.74	3.54%	293,567.52	4.40%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	144,482,587.53	1.62%	134,557.05	2.02%	-
东方证券	1	3,208,024.44	0.04%	2,987.64	0.04%	-
东吴证券	1	295,187,344.72	3.31%	274,909.06	4.12%	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	317,503,981.76	3.56%	295,691.95	4.44%	-
广发证券	1	319,784,542.20	3.59%	297,809.55	4.47%	-
国金证券	1	399,618,964.04	4.48%	372,166.17	5.58%	-
国泰君安	1	494,567,394.83	5.55%	460,592.09	6.91%	-
国信证券	1	1,651,409,090.16	18.52%	1,537,970.98	23.07%	-
海通证券	1	20,707,378.00	0.23%	19,284.84	0.29%	-
华泰证券	1	74,677,632.30	0.84%	69,547.69	1.04%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	3,794,785,929.54	42.56%	1,897,392.94	28.46%	-
天风证券	1	181,224,150.93	2.03%	168,773.41	2.53%	-
西部证券	1	224,987,778.03	2.52%	209,528.89	3.14%	-
西南证券	1	326,875,232.63	3.67%	304,418.45	4.57%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	6,032,160.00	0.07%	5,617.15	0.08%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信	1	-	-	-	-	-

建投						
中信证券	1	130,190,974.41	1.46%	121,247.88	1.82%	-
中信证券(华南)	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	215,921,519.05	2.42%	201,091.37	3.02%	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	6,972,800.00	30.51%	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	14,982,400,000.00	65.55%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	900,000,000.00	3.94%	-	-	-	-

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	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-05
2	中欧基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-01-08

	旗下基金投资非公开发行股票的公告		
3	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2021-01-19
4	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-21
5	中欧匠心两年持有期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
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中欧钱滚滚电子交易平台开展申购定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-26
7	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
8	中欧匠心两年持有期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
9	中欧匠心两年持有期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
10	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-04-27
11	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
12	中欧基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-05-07

	旗下基金投资非公开发行股票的公告		
13	中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金开放赎回、转换转出业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-10

§ 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、中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人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

二〇二一年八月三十一日