

中欧瑾利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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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..... | 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..... | 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等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)..... | 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..... | 53 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 53 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 54 |
| 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..... | 55 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 59 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 61 |
| 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..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 62 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 62 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 63 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 64 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 64 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 65 |

| | |
|---|----|
| 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..... | 65 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 65 |
| §10 重大事件揭示..... | 66 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 66 |
| 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..... | 66 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 66 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 66 |
| 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..... | 67 |
| 10.8 其他重大事件..... | 68 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 68 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 68 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 69 |
| §12 备查文件目录..... | 69 |
| 12.1 备查文件目录..... | 69 |
| 12.2 存放地点..... | 69 |
| 12.3 查阅方式..... | 69 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金名称 | 中欧瑾利混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中欧瑾利混合 | |
| 基金主代码 | 010712 | |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020年12月30日 | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 680,356,985.13份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧瑾利混合A | 中欧瑾利混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010712 | 010713 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 218,034,889.98份 | 462,322,095.15份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金依据科学严谨的大类资产配置框架，通过把握债券、股票市场的投资机会，在控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。 |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×18%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%+中债综合财富（总值）指数收益率×80% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---------------------------|--------------------|
| 名称 | 中欧基金管理有限公司 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 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 | 95528 |
| 传真 | 021-33830351 | 021-63602540 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层 | 上海市中山东一路12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 | 上海市北京东路689号 |
| 邮政编码 | 200120 | 200001 |
| 法定代表人 | 窦玉明 | 郑杨 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|--------------------------|
| 注册登记机构 | 中欧基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号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) | |
|---------------|----------------------------------|----------------|
| | 中欧瑾利混合A | 中欧瑾利混合C |
| 本期已实现收益 | 3,138,792.49 | 7,885,580.50 |
| 本期利润 | 6,622,786.14 | 14,634,638.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0405 | 0.0290 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.00% | 2.87% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.51% | 3.46% |
| 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 | 3,575,363.67 | 7,370,519.96 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0164 | 0.0159 |
| 期末基金资产净值 | 225,855,595.02 | 478,691,423.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.0359 | 1.0354 |
| 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 | 3.59% | 3.54% |

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

中欧瑾利混合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 | 0.99% | 0.22% | -0.08% | 0.15% | 1.07% | 0.07% |
| 过去三个月 | 3.74% | 0.21% | 1.87% | 0.17% | 1.87% | 0.04% |
| 过去六个月 | 3.51% | 0.24% | 2.27% | 0.24% | 1.24% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.59% | 0.24% | 3.00% | 0.24% | 0.59% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。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。

中欧瑾利混合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 | 0.99% | 0.22% | -0.08% | 0.15% | 1.07% | 0.07% |
| 过去三个月 | 3.72% | 0.21% | 1.87% | 0.17% | 1.85% | 0.04% |
| 过去六个月 | 3.46% | 0.24% | 2.27% | 0.24% | 1.19% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.54% | 0.24% | 3.00% | 0.24% | 0.54% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%。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

中欧瑾利混合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
(2020年12月30日-2021年06月30日)



注：本基金基金合同生效日期为 2020 年 12 月 30 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

中欧瑾利混合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
(2020年12月30日-2021年06月30日)



注：本基金基金合同生效日期为 2020 年 12 月 30 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

§ 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 | | |
| 华李成 | 基金经理 | 2020-12-30 | - | 7年 | 历任浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资经理。2016/05/09加入中欧基金管理有限公司, 历任投资经理助理、投资经理。 |

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

上半年股债两类资产表现分化明显，股票冲高回落基本走平，未能延续前两年的涨势，债券则在年初普遍不看好中取得了亮眼的表现。具体来说，沪深300上半年上涨0.24%，中债新综合财富（1-3年）指数上半年上涨1.93%。尽管股债从涨跌幅来看均属正常，但其间市场经历的波动和结构转换是过去几年较为少见的。面对错综变化的市场，投资者难免会感到迷茫和困惑，映射到操作上是频繁变动的资产配置，但从结果看大量资产配置调整最终被证实为负贡献。经过上半年的市场实践，我们再次认识到了坚持稳健资产配置的重要性，后续我们会沿此方向不断努力。

上半年股票走势可谓是一波三折，年初1月份到2月初市场延续了去年核心资产领涨的风格，以食品饮料、医药为代表的相关行业大幅上涨。春节前后受海外经济数据超预期影响，全球开始交易经济复苏，再通胀交易成为主流，美债利率大幅上行。映射到国内股票市场，估值处在高位的核心资产应声下跌，相应的估值处在低位的周期和金融相关个股则获得了可观的涨幅。再通胀交易的主线延续到4月，伴随着国内经济增长动能出现见顶迹象，市场关注的目光重新转回以新能源和半导体为代表的高景气度成长股，科技板块成为5-6月股票市场的主线。

相较于股票市场走势，上半年债券走势则超市场预期的平稳。除了1月受永煤事件后央行应急式货币宽松退出的阶段性影响，剩余时间债券收益率在市场存在明显分歧的情况下平稳下行，期间面临通胀超预期的挑战也没有影响走势。21年债券市场主线我们认为有两条，明线是央行“看价不看量”引导下持续平稳的资金面，暗线是经济面临下行风险时逆周期调节思路。固收传统分析框架应用到21年的市场上面临了诸多挑战，这要求我们根据市场变化不断迭代更新自身框架。

上半年组合坚持资产配置纪律，维持了稳健的股债配置，取得了较好效果。股票方面，组合一季度适时进行了不同板块间的再平衡，凭借均衡的配置结构降低了春节后组合回撤幅度，二季度在均衡配置的基础上加大了对以新能源、半导体为代表的成长股的配置力度，基本把握了股票市场的结构性机会；债券方面，组合坚持高等级信用债配置策略，并适时参与了长久期利率债波段交易，较好把握了债券市场上涨行情。除此之外，组合还积极参与股票打新和可转债交易，有效增厚了组合收益。

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3.51%，同期业绩比较基准收益率为2.27%；C类份额净值增长率为3.46%，同期业绩比较基准收益率为2.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场已就经济增长动能放缓达成共识，7月意外降准体现了决策层在跨周期调节框架下的前瞻判断和灵活操作，短期看需密切关注通胀和海外货币政策变化的潜在风险，中期看我们则应把更多的关注力放在宏观结构研究而非方向判断上，适应宏观波动率下降背景下资产价格运动规律，寻找结构性矛盾隐含的投资线索。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧瑾利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中欧瑾利混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：中欧瑾利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 | 12,481,242.28 | 268,141,504.84 |
| 结算备付金 | | 2,633,553.57 | - |
| 存出保证金 | | 131,246.77 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 894,775,292.03 | 51,609,600.00 |
| 其中：股票投资 | | 139,736,380.98 | 26,642,100.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 755,038,911.05 | 24,967,500.00 |
| 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 | | 3,223,742.11 | 100,441,535.71 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 12,060,619.31 | 236,465.56 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 925,305,696.07 | 420,429,106.11 |
| 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 | | 219,999,530.00 | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付证券清算款 | | 0.36 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 344,403.63 | 6,887.29 |
| 应付托管费 | | 57,400.58 | 1,147.88 |
| 应付销售服务费 | | 39,008.42 | 1,011.10 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 122,156.31 | 24,495.79 |
| 应交税费 | | 43,304.29 | - |
| 应付利息 | | 63,118.19 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 89,756.01 | 980.94 |
| 负债合计 | | 220,758,677.79 | 34,523.00 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 680,356,985.13 | 420,061,642.76 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 24,190,033.15 | 332,940.35 |
| 所有者权益合计 | | 704,547,018.28 | 420,394,583.11 |
| 负债和所有者权益总计 | | 925,305,696.07 | 420,429,106.11 |

注：1. 报告截止日2021年06月30日，基金份额净值为人民币1.0356元，基金份额总额为680,356,985.13份，其中下属A类基金份额参考净值为人民币1.0359元，份额总额为218,034,889.98份；下属C类基金份额参考净值为人民币1.0354元，份额总额为462,322,095.15份。

2. 本基金合同于2020年12月30日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧瑾利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0 6月30日 |
|------|-----|-----------------------------------|
| 一、收入 | | 25,894,332.98 |

| | | |
|----------------------------|------------|---------------|
| 1. 利息收入 | | 9,923,983.46 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 176,092.16 |
| 债券利息收入 | | 9,568,162.12 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 179,729.18 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 5,737,278.52 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 4,626,376.50 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 492,317.00 |
| 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 | 618,585.02 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 10,233,051.39 |
| 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 | 19.61 |
| 减：二、费用 | | 4,636,908.60 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,020,043.16 |
| 2. 托管费 | | 336,673.85 |
| 3. 销售服务费 | | 254,744.65 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 463,331.58 |
| 5. 利息支出 | | 1,436,692.17 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,436,692.17 |
| 6. 税金及附加 | | 26,703.22 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 98,719.97 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 21,257,424.38 |
| 减：所得税费用 | | - |

| | | |
|-------------------|--|---------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 21,257,424.38 |
|-------------------|--|---------------|

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧瑾利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) | 420,061,642.76 | 332,940.35 | 420,394,583.11 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | 21,257,424.38 | 21,257,424.38 |
| 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) | 260,295,342.37 | 2,599,668.42 | 262,895,010.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 402,229,922.01 | 3,351,931.46 | 405,581,853.47 |
| 2. 基金赎回 款 | -141,934,579.64 | -752,263.04 | -142,686,842.68 |
| 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) | 680,356,985.13 | 24,190,033.15 | 704,547,018.28 |

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

中欧瑾利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[2020]2920号文《关于准予中欧瑾利混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾利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420,061,642.76元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第61336106_B43号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧瑾利混合型证券投资基金基金合同》于2020年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为420,061,642.76份基金份额,有效认购资金在募集期内未产生利息。其中A类基金的基金份额总额为50,054,755.76份,无利息折合基金份额;C类基金的基金份额总额为370,006,887.00份,无利息折合基金份额。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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾利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、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债的纯债部分等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具(包括国债期货、股指期货、股票期权)、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-50%;港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的50%;每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。本基金投资于可转换债券(含可分离交易可转换债券)及可交换债券的比例不超过基金资产的20%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2%+中债综合财富(总值)指数收益率×80%。

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6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年1月1日至2021年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资等；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

（5）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（6）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计

量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3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。

6.4.6.4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。

6.4.6.5个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.6.6 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 | 12,481,242.28 |
| 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 | 12,481,242.28 |

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 | 134,478,554.45 | 139,736,380.98 | 5,257,826.53 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 329,226,930.58 | 330,958,911.05 |
| | 银行间市场 | 420,519,730.39 | 424,080,000.00 |
| | 合计 | 749,746,660.97 | 755,038,911.05 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 884,225,215.42 | 894,775,292.03 | 10,550,076.61 |

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 | 2,786.65 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |

| | |
|------------|---------------|
| 应收结算备付金利息 | 1,271.71 |
| 应收债券利息 | 12,056,501.95 |
| 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 | 59.00 |
| 合计 | 12,060,619.31 |

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 | 114,711.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,444.49 |
| 合计 | 122,156.31 |

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 | 29,918.67 |
| 预提费用-信息披露费 | 59,837.34 |
| 合计 | 89,756.01 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 (中欧瑾利混合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 | 50,054,755.76 | 50,054,755.76 |
| 本期申购 | 167,985,411.10 | 167,985,411.10 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -5,276.88 | -5,276.88 |
| 本期末 | 218,034,889.98 | 218,034,889.98 |

金额单位：人民币元

| 项目 (中欧瑾利混合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 | 370,006,887.00 | 370,006,887.00 |
| 本期申购 | 234,244,510.91 | 234,244,510.91 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -141,929,302.76 | -141,929,302.76 |
| 本期末 | 462,322,095.15 | 462,322,095.15 |

注：

- 1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。
- 2、本基金自2020年12月25日至2020年12月25日止期间公开发售，共募集有效净认购资金420,061,642.76元（其中A类50,054,755.76元，C类370,006,887.00元）；本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入0.00元，在本基金成立后，折算为0.00份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 中欧瑾利混合A

单位：人民币元

| 项目 (中欧瑾利混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末 | 2,016.94 | 37,776.88 | 39,793.82 |
| 本期利润 | 3,138,792.49 | 3,483,993.65 | 6,622,786.14 |

| | | | |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 434,554.24 | 723,570.84 | 1,158,125.08 |
| 其中：基金申购款 | 434,568.78 | 723,535.96 | 1,158,104.74 |
| 基金赎回款 | -14.54 | 34.88 | 20.34 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,575,363.67 | 4,245,341.37 | 7,820,705.04 |

6.4.7.10.2 中欧瑾利混合C

单位：人民币元

| 项目 (中欧瑾利混合C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|--------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 13,898.19 | 279,248.34 | 293,146.53 |
| 本期利润 | 7,885,580.50 | 6,749,057.74 | 14,634,638.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -528,958.73 | 1,970,502.07 | 1,441,543.34 |
| 其中：基金申购款 | 283,742.85 | 1,910,083.87 | 2,193,826.72 |
| 基金赎回款 | -812,701.58 | 60,418.20 | -752,283.38 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 7,370,519.96 | 8,998,808.15 | 16,369,328.11 |

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 | 112,067.35 |
| 定期存款利息收入 | 44,333.33 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 18,951.29 |
| 其他 | 740.19 |
| 合计 | 176,092.16 |

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 | 110,488,671.12 |
| 减：卖出股票成本总额 | 105,862,294.62 |
| 买卖股票差价收入 | 4,626,376.50 |

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 492,317.00 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 492,317.00 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 263,335,429.21 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 258,209,899.07 |
| 减：应收利息总额 | 4,633,213.14 |
| 买卖债券差价收入 | 492,317.00 |

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

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 | 618,585.02 |
| 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 | 618,585.02 |

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 | 10,233,051.39 |
| ——股票投资 | 4,918,301.31 |
| ——债券投资 | 5,314,750.08 |
| ——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 | 10,233,051.39 |

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 | 19.61 |
| 合计 | 19.61 |

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 | 458,531.58 |
| 银行间市场交易费用 | 4,800.00 |
| 合计 | 463,331.58 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 审计费用 | 29,591.69 |
| 信息披露费 | 59,183.38 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 6,844.90 |
| 账户维护费 | 3,000.00 |
| 其他 | 100.00 |
| 合计 | 98,719.97 |

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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 |
|-----------------|-------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,020,043.16 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 87,995.02 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、本基金合同于2020年12月30日生效，故无上年度可比期间数据。

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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 336,673.85 |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、本基金合同于2020年12月30日生效，故无上年度可比期间数据。

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 | | |
| | 中欧瑾利混合A | 中欧瑾利混合C | 合计 |
| 中欧基金 | 0.00 | 156,969.84 | 156,969.84 |
| 合计 | 0.00 | 156,969.84 | 156,969.84 |

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0.10%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧瑾利混合A

份额单位：份

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 146,811.83 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 146,811.83 |

| | |
|---------------------|-------|
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.07% |
|---------------------|-------|

中欧瑾利混合C

份额单位：份

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

注：

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧瑾利混合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 | 3,017.58 | 0.00% | 8,013.58 | 0.02% |

中欧瑾利混合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 | 持有的基金份额 | 持有的基金份 |

| | | 额占基金总份 额的比例 | | 额占基金总份 额的比例 |
|-----------|-------|----------------|-------|----------------|
| 自然人股 东 | 10.00 | 0.00% | 10.00 | 0.00% |

注：

- 1、截至本报告期末，自然人股东持有本基金A类份额占A类基金总份额的0.0014%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。
- 2、截至本报告期末，自然人股东持有本基金C类份额占C类基金总份额的0.000002%，截至上年度末，自然人股东持有本基金C类份额占C类基金总份额的0.000003%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。
- 3、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 | |
|----------------------------|-------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东 发展银行 股份有限 公司 | 12,481,242.28 | 112,067.35 |

- 注：1、本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行同业利率计息。
2、本基金合同于2020年12月30日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 600905 | 三峡能源 | 2021-06-02 | 2021-12-10 | 新股流通受限 | 2.65 | 5.67 | 907,763 | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | - |
| 688076 | 诺泰生物 | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 新股流通受限 | 15.57 | 48.55 | 4,984 | 77,600.88 | 241,973.20 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 688097 | 博众精工 | 2021-04-29 | 2021-11-12 | 新股流通受限 | 11.27 | 28.01 | 3,983 | 44,888.41 | 111,563.83 | - |
| 688575 | 亚辉龙 | 2021-05-10 | 2021-11-17 | 新股流通受限 | 14.80 | 32.09 | 3,435 | 50,838.00 | 110,229.15 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021-06-06 | 2021-07-06 | 新股未上 | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.6 | 83,488.6 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|--------------------|----------------|-----------|-----------|-------|-------------------|-------------------|---|
| | | 23 | 01 | 市 | | | | 5 | 5 | |
| 3009 79 | 华利 集团 | 2021 -04- 15 | 2021 -10- 26 | 新股 流通 受限 | 33.2 2 | 87.5 0 | 925 | 30,7 28.5 0 | 80,9 37.5 0 | - |
| 6886 62 | 富信 科技 | 2021 -03- 25 | 2021 -10- 08 | 新股 流通 受限 | 15.6 1 | 29.5 1 | 2,556 | 39,8 99.1 6 | 75,4 27.5 6 | - |
| 6886 36 | 智明 达 | 2021 -03- 30 | 2021 -10- 08 | 新股 流通 受限 | 34.5 0 | 80.7 2 | 918 | 31,6 71.0 0 | 74,1 00.9 6 | - |
| 6885 33 | 上声 电子 | 2021 -04- 09 | 2021 -10- 19 | 新股 流通 受限 | 7.72 | 19.1 1 | 3,493 | 26,9 65.9 6 | 66,7 51.2 3 | - |
| 6884 68 | 科美 诊断 | 2021 -03- 31 | 2021 -10- 11 | 新股 流通 受限 | 7.15 | 16.5 0 | 3,919 | 28,0 20.8 5 | 64,6 63.5 0 | - |
| 3010 18 | 申菱 环境 | 2021 -06- 28 | 2021 -07- 07 | 新股 未上 市 | 8.29 | 8.29 | 7,029 | 58,2 70.4 1 | 58,2 70.4 1 | - |
| 6882 39 | 航宇 科技 | 2021 -06- 25 | 2021 -07- 05 | 新股 未上 市 | 11.4 8 | 11.4 8 | 4,926 | 56,5 50.4 8 | 56,5 50.4 8 | - |
| 3009 81 | 中红 医疗 | 2021 -04- 19 | 2021 -10- 27 | 新股 流通 受限 | 48.5 9 | 90.3 9 | 601 | 29,2 02.5 9 | 54,3 24.3 9 | - |
| 6880 87 | 英科 再生 | 2021 -06- 30 | 2021 -07- 09 | 新股 未上 市 | 21.9 6 | 21.9 6 | 2,469 | 54,2 19.2 4 | 54,2 19.2 4 | - |
| 6886 85 | 迈信 林 | 2021 -04- 30 | 2021 -11- 15 | 新股 流通 受限 | 9.02 | 19.5 0 | 2,612 | 23,5 60.2 4 | 50,9 34.0 0 | - |
| 3010 17 | 漱玉 平民 | 2021 -06- - | 2021 -07- - | 新股 未上 | 8.86 | 8.86 | 4,995 | 44,2 55.7 | 44,2 55.7 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 23 | 05 | 市 | | | | 0 | 0 | |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市 | 9.46 | 9.46 | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021-05-26 | 2021-12-02 | 新股流通受限 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021-05-27 | 2021-12-07 | 新股流通受限 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06- | 2021-07- | 新股未上 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.4 | 11,014.4 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|--------------------|----------------|-----------|-----------|-------|--------------|-------------------|---|
| | | 28 | 06 | 市 | | | | 4 | 4 | |
| 3009 96 | 普联 软件 | 2021 -05- 26 | 2021 -12- 03 | 新股 流通 受限 | 20.8 1 | 42.2 3 | 241 | 5,01 5.21 | 10,1 77.4 3 | - |
| 3010 16 | 雷尔 伟 | 2021 -06- 23 | 2021 -12- 30 | 新股 流通 受限 | 13.7 5 | 32.9 8 | 275 | 3,78 1.25 | 9,06 9.50 | - |
| 6051 62 | 新中 港 | 2021 -06- 29 | 2021 -07- 07 | 新股 未上 市 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,35 8.39 | 8,35 8.39 | - |
| 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 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 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- 18 | 2021 -12- 27 | 新股 流通 受限 | 7.81 | 21.9 4 | 312 | 2,43 6.72 | 6,84 5.28 | - |
| 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 | - |
| 3010 18 | 申菱 环境 | 2021 -06- - | 2022 -01- - | 新股 流通 | 8.29 | 8.29 | 782 | 6,48 2.78 | 6,48 2.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | | 28 | 07 | 受限 | | | | | | |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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- | 2022-01- | 新股流通 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |

| | | 28 | 06 | 受限 | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113050 | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 2,680 | 268,000.00 | 268,000.00 | - |
| 113626 | 伯特转债 | 2021-06-30 | 2021-07-21 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 1,330 | 133,000.00 | 133,000.00 | - |

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

无。

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99,999,530.00元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|--------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 101801285 | 18闽高速MTN002 | 2021-07-05 | 102.82 | 400,000 | 41,128,000.00 |
| 102002212 | 20广州地铁MTN003 | 2021-07-05 | 101.65 | 78,000 | 7,928,700.00 |
| 102100254 | 21广州地铁MTN003 | 2021-07-05 | 100.51 | 300,000 | 30,153,000.00 |
| 132100005 | 21苏国信GN001 | 2021-07-07 | 100.70 | 316,000 | 31,821,200.00 |
| 合计 | | | | 1,094,000 | 111,030,900.00 |

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币120,000,000.00元，分别于2021年7月1日和7日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金依据科学严谨的大类资产配置框架，通过把握债券、股票市场的投资机会，在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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 40,084,000.00 | - |
| 合计 | 40,084,000.00 | 0.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以内未有三方评级的政策性金融债。3. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 660,343,687.50 | - |
| AAA以下 | 14,111,223.55 | - |
| 未评级 | 40,500,000.00 | - |
| 合计 | 714,954,911.05 | 0.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的政策性金融债。3. 债券投资以净价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有长期信用评级的同业存单。

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于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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

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 | 12,481,242.28 | - | - | - | 12,481,242.28 |
| 结算备付金 | 2,633,553.57 | - | - | - | 2,633,553.57 |
| 存出保证金 | 131,246.77 | - | - | - | 131,246.77 |
| 交易性金融资产 | 40,084,000.00 | 657,410,131.75 | 57,544,779.30 | 139,736,380.98 | 894,775,292.03 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 3,223,742.11 | 3,223,742.11 |
| 应收利息 | - | - | - | 12,060,619.31 | 12,060,619.31 |
| 资产总计 | 55,330,042.62 | 657,410,131.75 | 57,544,779.30 | 155,020,742.40 | 925,305,696.07 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 219,999,530.00 | - | - | - | 219,999,530.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 0.36 | 0.36 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 344,403.63 | 344,403.63 |
| 应付托 | - | - | - | 57,400.58 | 57,400.58 |

| | | | | | |
|---------------------|-----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 管费 | | | | | |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 39,008.42 | 39,008.42 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 122,156.31 | 122,156.31 |
| 应交税费 | - | - | - | 43,304.29 | 43,304.29 |
| 应付利息 | - | - | - | 63,118.19 | 63,118.19 |
| 其他负债 | - | - | - | 89,756.01 | 89,756.01 |
| 负债总计 | 219,999,530.00 | - | - | 759,147.79 | 220,758,677.79 |
| 利率敏感度缺口 | -164,669,487.38 | 657,410,131.75 | 57,544,779.30 | 154,261,594.61 | 704,547,018.28 |
| 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 | 268,141,504.84 | - | - | - | 268,141,504.84 |
| 交易性金融资产 | 24,967,500.00 | - | - | 26,642,100.00 | 51,609,600.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 100,441,535.71 | 100,441,535.71 |
| 应收利息 | - | - | - | 236,465.56 | 236,465.56 |
| 资产总计 | 293,109,004.84 | - | - | 127,320,101.27 | 420,429,106.11 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 6,887.29 | 6,887.29 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,147.88 | 1,147.88 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,011.10 | 1,011.10 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 24,495.79 | 24,495.79 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|----------------|----------------|
| 其他负债 | - | - | - | 980.94 | 980.94 |
| 负债总计 | - | - | - | 34,523.00 | 34,523.00 |
| 利率敏感度缺口 | 293,109,004.84 | - | - | 127,285,578.27 | 420,394,583.11 |

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

| 假设 | 除市场利率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 |
| | 利率下降25BP | 5,538,763.74 | - |
| | 利率上升25BP | -5,446,228.92 | - |

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 | - | 1,584,280.32 | - | 1,584,280.32 |
| 资产合计 | - | 1,584,280.32 | - | 1,584,280.32 |

| | | | | |
|---------------|---------------------|--------------|-----------|--------------|
| 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 | - | 1,584,280.32 | - | 1,584,280.32 |
| 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 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |

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% | 79,214.02 | - |
| | 2. 港币相对人民币贬值5% | -79,214.02 | - |

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 | 139,736,380.98 | 19.83 | 26,642,100.00 | 6.34 |
| 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 | 139,736,380.98 | 19.83 | 26,642,100.00 | 6.34 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年06月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为19.83%(2020年12月31日:6.34%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日:同）。

6.4.14 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160,675,840.92元，属于第二层次的余额为734,099,451.11元，第三层次的余额为0.00元（2020年12月31日：本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币26,642,100.00元，属于第二层次的余额为人民币24,967,500.00元，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 | 139,736,380.98 | 15.10 |
| | 其中：股票 | 139,736,380.98 | 15.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 755,038,911.05 | 81.60 |
| | 其中：债券 | 755,038,911.05 | 81.60 |
| | 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 | 15,114,795.85 | 1.63 |
| 8 | 其他各项资产 | 15,415,608.19 | 1.67 |
| 9 | 合计 | 925,305,696.07 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股机制的公允价值为1,584,280.32元，占基金总资产比例0.17%。

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 | 5,439.50 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 1,841,100.00 | 0.26 |
| C | 制造业 | 80,449,150.11 | 11.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60 | 0.73 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 306,699.54 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,553,000.00 | 0.79 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,278,000.00 | 0.32 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,783,479.74 | 1.67 |
| J | 金融业 | 22,221,111.10 | 3.15 |
| K | 房地产业 | 2,857,200.00 | 0.41 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,879,080.00 | 0.27 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 13,285.02 | 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 | 1,378,147.68 | 0.20 |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,401,000.00 | 0.34 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 138,152,100.66 | 19.61 |

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 (%) |
|--------|--------------|---------------|
| 消费者常用品 | 1,584,280.32 | 0.22 |
| 合计 | 1,584,280.32 | 0.22 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 3,000 | 6,170,100.00 | 0.88 |
| 2 | 600741 | 华域汽车 | 200,000 | 5,254,000.00 | 0.75 |
| 3 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.73 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 80,000 | 5,142,400.00 | 0.73 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 156,000 | 5,115,240.00 | 0.73 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 125,000 | 4,871,250.00 | 0.69 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 200,000 | 4,524,000.00 | 0.64 |
| 8 | 688099 | 晶晨股份 | 40,000 | 4,488,000.00 | 0.64 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 60,000 | 4,282,200.00 | 0.61 |
| 10 | 300454 | 深信服 | 15,000 | 3,892,200.00 | 0.55 |
| 11 | 601012 | 隆基股份 | 42,000 | 3,731,280.00 | 0.53 |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 80,000 | 3,680,000.00 | 0.52 |
| 13 | 603517 | 绝味食品 | 40,000 | 3,371,600.00 | 0.48 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 14 | 603806 | 福斯特 | 31,145 | 3,274,273.85 | 0.46 |
| 15 | 600309 | 万华化学 | 30,000 | 3,264,600.00 | 0.46 |
| 16 | 002311 | 海大集团 | 40,000 | 3,264,000.00 | 0.46 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 48,000 | 3,262,560.00 | 0.46 |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 50,000 | 3,225,000.00 | 0.46 |
| 19 | 300750 | 宁德时代 | 6,000 | 3,208,800.00 | 0.46 |
| 20 | 600315 | 上海家化 | 50,000 | 3,007,000.00 | 0.43 |
| 21 | 000858 | 五粮液 | 10,000 | 2,978,900.00 | 0.42 |
| 22 | 000002 | 万科A | 120,000 | 2,857,200.00 | 0.41 |
| 23 | 601021 | 春秋航空 | 50,000 | 2,845,000.00 | 0.40 |
| 24 | 688396 | 华润微 | 30,000 | 2,730,600.00 | 0.39 |
| 25 | 002352 | 顺丰控股 | 40,000 | 2,708,000.00 | 0.38 |
| 26 | 300413 | 芒果超媒 | 35,000 | 2,401,000.00 | 0.34 |
| 27 | 600754 | 锦江酒店 | 40,000 | 2,278,000.00 | 0.32 |
| 28 | 002821 | 凯莱英 | 6,000 | 2,235,600.00 | 0.32 |
| 29 | 603596 | 伯特利 | 60,000 | 2,145,000.00 | 0.30 |
| 30 | 002709 | 天赐材料 | 20,000 | 2,131,600.00 | 0.30 |
| 31 | 688111 | 金山办公 | 5,000 | 1,974,000.00 | 0.28 |
| 32 | 000661 | 长春高新 | 5,000 | 1,935,000.00 | 0.27 |
| 33 | 603259 | 药明康德 | 12,000 | 1,879,080.00 | 0.27 |
| 34 | 601899 | 紫金矿业 | 190,000 | 1,841,100.00 | 0.26 |
| 35 | 601658 | 邮储银行 | 300,000 | 1,506,000.00 | 0.21 |
| 36 | 002304 | 洋河股份 | 7,000 | 1,450,400.00 | 0.21 |
| 37 | 300015 | 爱尔眼科 | 19,416 | 1,378,147.68 | 0.20 |
| 38 | 603612 | 索通发展 | 75,000 | 1,347,750.00 | 0.19 |
| 39 | 000932 | 华菱钢铁 | 200,000 | 1,320,000.00 | 0.19 |
| 40 | 600346 | 恒力石化 | 50,000 | 1,312,000.00 | 0.19 |
| 41 | 300188 | 美亚柏科 | 75,000 | 1,305,000.00 | 0.19 |
| 42 | 601100 | 恒立液压 | 15,000 | 1,288,800.00 | 0.18 |
| 43 | 002541 | 鸿路钢构 | 20,000 | 1,167,000.00 | 0.17 |
| 44 | 603236 | 移远通信 | 6,500 | 1,108,965.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|--------|--------------|------|
| 45 | 600104 | 上汽集团 | 50,000 | 1,098,500.00 | 0.16 |
| 46 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,000 | 1,039,300.00 | 0.15 |
| 47 | 601166 | 兴业银行 | 50,000 | 1,027,500.00 | 0.15 |
| 48 | 603501 | 韦尔股份 | 3,000 | 966,000.00 | 0.14 |
| 49 | 603317 | 天味食品 | 30,000 | 882,900.00 | 0.13 |
| 50 | H01579 | 颐海国际 | 20,000 | 867,859.44 | 0.12 |
| 51 | 603799 | 华友钴业 | 7,500 | 856,500.00 | 0.12 |
| 52 | H06969 | 思摩尔国际 | 20,000 | 716,420.88 | 0.10 |
| 53 | 688686 | 奥普特 | 1,000 | 451,000.00 | 0.06 |
| 54 | 688161 | 威高骨科 | 3,069 | 325,467.45 | 0.05 |
| 55 | 301015 | 百洋医药 | 4,614 | 251,115.78 | 0.04 |
| 56 | 688076 | 诺泰生物 | 4,984 | 241,973.20 | 0.03 |
| 57 | 688613 | 奥精医疗 | 2,617 | 237,597.43 | 0.03 |
| 58 | 688079 | 美迪凯 | 10,622 | 195,444.80 | 0.03 |
| 59 | 301002 | 崧盛股份 | 2,001 | 159,001.62 | 0.02 |
| 60 | 605499 | 东鹏饮料 | 632 | 158,505.60 | 0.02 |
| 61 | 688700 | 东威科技 | 3,049 | 117,264.54 | 0.02 |
| 62 | 301016 | 雷尔伟 | 2,747 | 115,711.58 | 0.02 |
| 63 | 688097 | 博众精工 | 3,983 | 111,563.83 | 0.02 |
| 64 | 688575 | 亚辉龙 | 3,435 | 110,229.15 | 0.02 |
| 65 | 688216 | 气派科技 | 2,000 | 95,280.00 | 0.01 |
| 66 | 688109 | 品茗股份 | 1,301 | 93,802.10 | 0.01 |
| 67 | 688217 | 睿昂基因 | 1,040 | 86,736.00 | 0.01 |
| 68 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 83,488.65 | 0.01 |
| 69 | 300979 | 华利集团 | 925 | 80,937.50 | 0.01 |
| 70 | 605117 | 德业股份 | 627 | 80,005.20 | 0.01 |
| 71 | 688662 | 富信科技 | 2,556 | 75,427.56 | 0.01 |
| 72 | 688636 | 智明达 | 918 | 74,100.96 | 0.01 |
| 73 | 688533 | 上声电子 | 3,493 | 66,751.23 | 0.01 |
| 74 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.01 |
| 75 | 688468 | 科美诊断 | 3,919 | 64,663.50 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 76 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 77 | 300981 | 中红医疗 | 601 | 54,324.39 | 0.01 |
| 78 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 79 | 688685 | 迈信林 | 2,612 | 50,934.00 | 0.01 |
| 80 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.01 |
| 81 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.01 |
| 82 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 83 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 84 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 85 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 86 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 87 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 88 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 89 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 90 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 91 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 92 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 93 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 94 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 95 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 96 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 97 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 98 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 99 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 100 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 101 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 102 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 103 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 104 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 105 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 106 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 107 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 108 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 109 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 110 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 111 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 112 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 601398 | 工商银行 | 8,448,257.45 | 2.01 |
| 2 | 002142 | 宁波银行 | 8,369,988.00 | 1.99 |
| 3 | 000002 | 万科A | 6,147,265.92 | 1.46 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 5,481,421.00 | 1.30 |
| 5 | 600741 | 华域汽车 | 5,351,639.00 | 1.27 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 5,103,987.00 | 1.21 |
| 7 | 002821 | 凯莱英 | 5,071,508.94 | 1.21 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 4,657,629.00 | 1.11 |
| 9 | 000001 | 平安银行 | 4,653,757.99 | 1.11 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 4,645,492.00 | 1.11 |
| 11 | 300454 | 深信服 | 4,277,636.00 | 1.02 |
| 12 | 600050 | 中国联通 | 4,205,000.00 | 1.00 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 4,115,377.00 | 0.98 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 3,946,563.00 | 0.94 |
| 15 | 601021 | 春秋航空 | 3,932,736.00 | 0.94 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,877,811.00 | 0.92 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 3,741,499.46 | 0.89 |
| 18 | 002352 | 顺丰控股 | 3,540,697.00 | 0.84 |
| 19 | 600905 | 三峡能源 | 3,436,527.95 | 0.82 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 20 | 603517 | 绝味食品 | 3,315,241.66 | 0.79 |
|----|--------|------|--------------|------|

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 | 601398 | 工商银行 | 8,456,172.00 | 2.01 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 7,747,913.87 | 1.84 |
| 3 | 000568 | 泸州老窖 | 4,779,189.00 | 1.14 |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 4,349,094.00 | 1.03 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 3,963,733.00 | 0.94 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 3,109,886.00 | 0.74 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 2,693,875.00 | 0.64 |
| 8 | 300196 | 长海股份 | 2,631,480.00 | 0.63 |
| 9 | 002080 | 中材科技 | 2,556,300.00 | 0.61 |
| 10 | 002821 | 凯莱英 | 2,474,165.75 | 0.59 |
| 11 | 600031 | 三一重工 | 2,303,178.00 | 0.55 |
| 12 | 000002 | 万科A | 2,245,744.00 | 0.53 |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 2,121,484.60 | 0.50 |
| 14 | 603005 | 晶方科技 | 2,081,604.00 | 0.50 |
| 15 | 601318 | 中国平安 | 2,013,611.00 | 0.48 |
| 16 | 603288 | 海天味业 | 1,945,191.00 | 0.46 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 1,891,309.00 | 0.45 |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 1,858,082.00 | 0.44 |
| 19 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,842,598.00 | 0.44 |
| 20 | 600009 | 上海机场 | 1,800,039.00 | 0.43 |

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 | 214,038,274.29 |
|--------------|----------------|

| | |
|--------------|----------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 110,488,671.12 |
|--------------|----------------|

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 | 131,444,000.00 | 18.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,584,000.00 | 11.44 |
| 4 | 企业债券 | 302,404,000.00 | 42.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 292,636,000.00 | 41.54 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 28,554,911.05 | 4.05 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 755,038,911.05 | 107.17 |

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 | 1928028 | 19中国银行二级01 | 500,000 | 50,860,000.00 | 7.22 |
| 2 | 132100005 | 21苏国信GN001 | 500,000 | 50,350,000.00 | 7.15 |
| 3 | 101801285 | 18闽高速MTN002 | 400,000 | 41,128,000.00 | 5.84 |
| 4 | 210205 | 21国开05 | 400,000 | 40,500,000.00 | 5.75 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 5 | 210401 | 21农发01 | 400,000 | 40,084,000.00 | 5.69 |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|

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投资股指期货。

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

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19中国银行二级01的发行主体中国银行股份有限公司于2020-12-01受到银保监罚决字（2020）60号，于2021-05-17受到银保监罚决字（2021）11号。罚没合计13811万元人民币。本基金投资的21广州地铁MTN003的发行主体广州地铁集团有限公司于2020-08-07至2021-06-23受到广州市规划和自然资源局的处罚11次，于2020-11-23受到广州市海珠区城市管理和综合执法局的穗综海处字（2020）第1500048号。罚款合计618.33万元。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 | 131,246.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,223,742.11 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,060,619.31 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,415,608.19 |

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 |
|----|------|------|------|-------|
|----|------|------|------|-------|

| | | | | 产净值比例 (%) |
|---|--------|-------|--------------|-----------|
| 1 | 110063 | 鹰19转债 | 2,359,800.00 | 0.33 |
| 2 | 113542 | 好客转债 | 2,171,200.00 | 0.31 |
| 3 | 110067 | 华安转债 | 2,148,400.00 | 0.30 |
| 4 | 128136 | 立讯转债 | 1,754,250.00 | 0.25 |
| 5 | 128096 | 奥瑞转债 | 1,227,131.75 | 0.17 |
| 6 | 113602 | 景20转债 | 593,850.00 | 0.08 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 600905 | 三峡能源 | 5,147,016.21 | 0.73 | 新股流通受限 |

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 | 201 | 1,084,750.7 | 217,985,410.13 | 99.9 | 49,479.85 | 0.02% |

| | | | | | | |
|---------|-----|--------------|----------------|---------|-----------|-------|
| 瑾利混合A | | 0 | | 8% | | |
| 中欧瑾利混合C | 85 | 5,439,083.47 | 462,315,218.15 | 100.00% | 6,877.00 | 0.00% |
| 合计 | 286 | 2,378,870.58 | 680,300,628.28 | 99.99% | 56,356.85 | 0.01% |

注：截止本报告期末，本基金C类基金份额机构投资者的实际占比为99.9985%，个人投资者的实际占比为0.0015%，上表展示系四舍五入的结果。

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 | 中欧瑾利混合A | 31,445.96 | 0.01% |
| | 中欧瑾利混合C | 683.00 | 0.00% |
| | 合计 | 32,128.96 | 0.00% |

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金C类份额实际比例为0.0001%，基金管理人的从业人员持有份额占总份额实际比例为0.0047%，上表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 | 中欧瑾利混合A | 0~10 |
| | 中欧瑾利混合C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中欧瑾利混合A | 0~10 |
| | 中欧瑾利混合C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 中欧瑾利混合A | 中欧瑾利混合C |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2020年12月30日)基金份额总额 | 50,054,755.76 | 370,006,887.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 50,054,755.76 | 370,006,887.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 167,985,411.10 | 234,244,510.91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,276.88 | 141,929,302.76 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 218,034,889.98 | 462,322,095.15 |

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

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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 | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | 137,036,035.92 | 43.66% | 125,870.16 | 43.32% | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | 176,847,120.97 | 56.34% | 164,698.74 | 56.68% | - |

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. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

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 |

| | | | | | | | | |
|------|----------------|--------|------------------|---------|---|---|---|---|
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 140,520,913.31 | 21.68% | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 507,720,890.65 | 78.32% | 2,551,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

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. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。。

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 | 中欧瑾利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2021-01-06 |
| 2 | 中欧瑾利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 | 2021-02-09 |
| 3 | 中欧瑾利混合型证券投资基金2021年第一季度报告 | 中国证监会指定媒介 | 2021-04-22 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|------|----------------|----------------|------|------|------------|------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 |

| 别 | | 20%的时间区间 | | | | | |
|--|---|----------------------------------|---------------|---------------|------|---------------|--------|
| 机构 | 1 | 2021 年 1 月 14 日至 2021 年 1 月 19 日 | 50,000,000.00 | 49,524,564.18 | 0.00 | 99,524,564.18 | 14.63% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。 | | | | | | | |

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人及基金托管人的住所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日