

中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金

2021年第4季度报告

2021年12月31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

报告送出日期:2022年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2022年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月01日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧创新未来18个月封闭混合
场内简称	中欧创新未来
基金主代码	501208
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2020年10月09日
报告期末基金份额总额	9,133,806,132.06份
投资目标	主要通过投向创新未来主题相关股票，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	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*70%+恒生指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年10月01日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	-128,760,353.57
2. 本期利润	633,707,955.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0694
4. 期末基金资产净值	11,245,963,674.92
5. 期末基金份额净值	1.2312

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. 所述基金业绩指标不包括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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	5.96%	1.12%	0.97%	0.57%	4.99%	0.55%
过去六个月	-2.92%	1.54%	-3.58%	0.74%	0.66%	0.80%
过去一年	11.08%	1.58%	-1.65%	0.83%	12.73%	0.75%
自基金合同生效起至今	23.12%	1.45%	7.49%	0.82%	15.63%	0.63%

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

中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为2020年10月9日，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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵洁	基金经理	2020-10-09	-	9年	历任国金证券电子行业分析师，安信证券电子行业高级分析师。2016/04/15加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。
刘金辉	基金经理	2020-10-09	-	7年	历任兴业全球基金管理有限公司金融工程与专题部研究员。2015/03/30加入中欧基金管理有限公司，

					历任研究员、基金经理助理。
周应波	权益投决会委员/投资总监/基金经理	2020-10-09	-	11年	历任平安证券有限责任公司研究员，华夏基金管理有限公司研究员。2014/10/20加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理助理、投资经理。
周蔚文	权益投决会主席/投资总监/基金经理	2021-12-17	-	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。

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 公平交易专项说明

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不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16次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度A股市场，总体处于震荡格局，主要权重指数都呈现区间震荡局面，整体市场成交活跃，代表中小盘股票的国证2000指数表现最强。指数分化的背后体现了市场的“无奈”，一是四季度宏观经济向下压力加大，特别是地产行业出现销售、拿地、开工同步下滑局面，大部分行业的需求增长有压力；二是对“碳中和、碳达峰”的态度，无论在政策执行还是资本市场，“一刀切”的做法和狂热情绪都在消退，部分中上游行业单纯依靠扭曲的供给侧状态推动价格上涨的局面改变了，市场开始更务实地面对“能源革命时代”的开头；三是整体居民理财市场，投资性房地产、银行理财等原来体量庞大的市场正在萎缩，权益类基金持续扩容，市场新增资金较多，在部分中小股票中寻找突破口短期内成为市场共识。

按照季度视角来观察市场或者预判风格是比较短视的，如果回顾看2021年全年，行业景气的分化格局是很清晰的，电力设备和新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁是五个2021年涨幅超过40%的行业。2021年确认成为“能源革命时代”的启动元年，光伏、电动车本身产业技术成熟推动了大规模推广，“双碳”的全球性一致诉求进一步推动了资本市场的认可——这样的过程，伴随着“房住不炒”国策和人口出生率下降带来的20年“地产景气时代”的结束，资本市场的反应预示了经济结构的巨大变化。

四季度，港股市场继续走弱，特别是恒生科技、部分消费股等下跌较多，公用事业等经营稳定行业走势较强。从过去几年的经验看，港股市场对我们来说有如下显著特点：第一，离岸市场，流动性同时受到内地、全球的影响，市场在乐观和悲观之间的波动极大；第二，高度市场化，吸引了一批国内为主的新经济龙头企业上市，从优质上市公司供给来说是不可忽视的市场；第三，国内机构投资者自身的投资经验还不足，从过去4年我们的实践来看，投资港股的效果不甚理想。以上总结的同时，我们在投资策略上，已经将港股配置的重要性在基金组合中放低，并希望在未来几年更扎实地积累港股公司的研究经验。查理芒格说过“确定自己能力的边界是最重要的事”，现在来看香江还是我们一条挺重要的能力边界。

创新未来基金四季度净值上涨5.96%，跑赢比较基准。我们在配置上的主要调整包括：第一，较大幅度降低了港股配置仓位，聚焦A股投资；第二，行业配置上，因对汽车智能化、元宇宙等行业的看好，提升了消费电子、传媒的配置比例，同时从“防范宏观风险”出发降低了金融、有色化工的配置比例，从“降低拥挤交易方向风险”出发降低了新能源汽车、医药的配置比例；第三，坚持聚焦个股，对看得懂的确定性成长、信得过的管理层继续“委以重任”。整体上的投资策略，我们自创新未来基金2020年10月成立以来保持了连贯性，一是紧扣基金契约，真正聚焦“创新未来”主题相关行业，二是总体

上不择时，聚焦挖掘“差异化的成长股”，在基金管理团队相对擅长的新能源、TMT等领域重点配置，三是重视18个月封闭期的基金持有人久期约束，结合绝对收益的投资目标，屏蔽“排名焦虑”、紧扣“挣钱目标”。

四季度我们继续深化团队合作的工作模式，创新未来团队的两位年轻基金经理发挥了更大作用，承担了很大部分的行业和个股跟踪研究工作。未来几个月的基金管理中，我们会继续发挥团队协作，力争取得更好业绩。

展望2022年，我们的观点是“耐心等待经济筑底、细致甄别新能源泡沫、积极寻找新生动能”。过去的每次定期报告，我们都坚持用一句话描述总结下一阶段投资策略的要点，一是希望传递给基金持有人，让大家看到我们思考问题的过程，也能够在未来检验基金业绩的成功、失败时能清楚到底哪里对了、哪里错了、基金管理人是否做到了知行合一，二是提示我们自己，做好基金管理工作，投资思路要清晰，我们对经济、产业、企业发展的认知，要渗透、反馈到投资策略中去。

“耐心等待经济筑底”，主要是我们担心地产剧烈下行带来的经济硬着陆风险加大，全球央行也开始启动疫情后宽松政策的退出，高基数下的外需不容乐观，中国经济的韧性很强，但增速筑底需要过程，2022年需要保持耐心。从2015年末算起，棚改货币化和深度城镇化推动的地产景气周期已经长达5年多，人口出生率、城镇化率代表长周期压制因素，“房住不炒”国策代表中周期压制因素，2021年下半年以来的民营房企大面积爆雷代表短周期压制因素，长中短的角度理解都需要对仅下滑了2个季度的地产产业链保持谨慎。

“细致甄别新能源泡沫”，并不代表我们看空新能源行业，而是希望在市场较为拥挤的交易状态下提高对风险的警惕。在2021年我们看到了新能源汽车的爆发，光伏发电也在过去2年在发电端基本实现了平价上网，未来有望加速替代火电等传统能源。在“碳中和、碳达峰”的全球意志推动下，2020年代最明确的产业变化就是“能源革命”。第一、第二次工业革命中国基本缺席，第三次信息技术革命，中国作为分工协作、外贸加工角色深度参与，第四次能源革命中国产业链以全面拥抱、产业链领先的状态引领全球，这是近代以来的全新的局面，必然给未来的5-10年A股市场带来全面的投资机会。但同时需要看到，经历了2020-2021年的高速增长，无论新能源汽车、光伏产业链，各个环节都迎来了巨大规模的投资扩产，产业链不同环节的供需状态未来都会发生很大变化。我们看好新能源汽车渗透率突破10%之后的加速增长，也看好光伏在发电侧的全面普及替代、新型储能在改造电力系统中的巨大潜力，但2022年在产业链股票均预期乐观的情况下，我们更多地需要在泡沫中甄别风险与机会。

“积极寻找新生动能”，经济结构转型已经到了旧动能退潮、新动能全面站上前台的阶段，除了“能源革命”之外，我们注意到人工智能、虚拟现实（元宇宙）、合成生物学等新技术应用也在接近成熟，相关产业链开始快速增长，是值得留意的未来投资机会。新时代的新机遇，在最初期看总是萌芽状、难以计算、充满了路径不确定的，但他们最根本的特点，是充满了生命力，未来的10年我们坚信是科技成长迸发生机的10年，中国

的科技成长行业会深刻的改变中国乃至全球的社会生活、经济体系，其中第一个线索是 2020-2021 年确立的“低碳&能源革命”条线，还会有第二、第三个线索出现。

过去几年，我们强调寻找“差异化的成长股”，也说过“好生意、好团队、好价格”的选股标准，借此契机希望系统性地阐述一下我们对投资框架的理解。

第一个角度是“变与不变”。不变的是，作为基金管理人，应该有将持有人利益放在第一位的工作目标，保持勤奋、尽责的工作态度，求真务实地做研究。变化的是什么呢，投资框架、投资理念并不是读书读过来几句话就解决问题的，更不是人云亦云国内外的几个公式就万事大吉的。一是要结合国情、时代背景，公司制也就追溯到 16-17 世纪左右，股票市场在全球出现不过 200 年，再考虑到 20 世纪以来各个经济体不同的发展轨迹，国情、时代背景是产业、企业发展的重要基础，也是资本市场投资离不开的讨论基础。二是要结合所管理产品的资金属性，脱离“时间尺度”谈投资框架和理念是虚无的，作为新兴资本市场的新兴机构投资者，都会经常提及学习很多欧美投资大师的经典理论，但非常重要的一个约束条件是资产管理产品资金来源的“时间尺度”问题，无论是基金管理人还是基金销售渠道都任重道远。。三是基金投资本质是一种持有人对基金经理及整个基金公司团队的信任，基金经理在迭代、应用自身投资框架的出发点，并非是投资框架有多精美、出彩，而是应从对持有人负责角度出发，从基金管理团队本身优劣势出发，制定适合特定规模、资金久期、持有人结构的投资策略。

第二个角度是应当把主要精力聚焦“企业的中长期价值成长”。无论是基金经理个人，还是管理规模不等的基金公司投资研究团队，精力、能力圈都是有限的，面对复杂、宽广的资本市场，应当有自己的取舍，不可能什么都要。尽管存在各类短期主题投资、技术分析、政策信息等等机会，但机构投资者的主要精力应该聚焦“企业的中长期价值成长”。一是从事物本质出发，股票市场的价值增长来源是企业的价值增长带来的，还要减掉大量的中间交易、金融佣金的消耗磨损；二是从专业性来看，机构投资者能做好的事也只有这一个，在某几个擅长的方向上研究好企业，其他层面的事例如交易能力、技术分析、打听政策，都不能算“锦上添花”而近乎于猴戏了；三是尽管一轮轮宏观经济波动，产业景气上上下下，都似乎是 1-2 年切换的事情，但我们拉长一点看真正穿越时间走出来的、创造巨大成长价值的公司，100% 都是靠自身业绩提升、价值中枢提升，带来企业在资本市场映射价值的增长，无论全球、国内抓住这样投资机会的投资机构长期来说才能远远跑赢市场。

第三个角度是希望把握的成长股，我们的理解是寻求“差异化”。无论是可口可乐的口味，爱马仕的心智定位，还是苹果手机 iOS 生态的独特性，都代表了在消费品层面创造的巨大差异化，带来了公司利润率和业务增长的长期领先。这里面有天然禀赋的差异化，例如茅台的历史品牌、可口可乐的配方，也有技术研发、管理层创造出来的科技消费品的巨大优势。在中国制造业层面，我们过去看到在成本管控、生产组织管理上巨大的差异化造就的成长奇迹，典型就是中国的电子制造业，从基础组装到现在逐步进入芯片制造、精密零部件配套等核心产业链环节，涌现出一大批具备很强竞争力及长久生命力的企业，这里面有地域（劳动力）优势，更有差异化的管理层长期努力带来的价值。

我们希望寻求的“差异化”，一小部分是天然禀赋，但最主要的我们认为还是，卓越的企业管理层、长期研发投入乃至正确的企业价值观才是带来差异化的主要来源。“静水流深”的历史品牌能创造股东价值，但真正推动历史进步、社会生活水平提升，带来巨大的从无到有成长的，一定还是创新驱动、企业家精神驱动的“乘风破浪”。

复盘过去六年多的基金管理，记忆最深的还是在投资中犯过的错误和教训。广阔的资本市场里有长坡厚雪也有荒漠沙尘，我们常将自己的投资框架假想为“能粘厚雪的圆形滚石”，但无数次发现只是“滤过砂砾的漏斗”。孔子说过“知之为知之，不知为不知，是知也”，查理芒格说过“确定自己能力的边界是最重要的事”，多年基金管理最大的收获是知道了很多自身不擅长、做不好的事。展望未来，中国资本市场具备核心竞争力、能够内生持续价值成长的公司越来越多，这是我们做好成长股投资的基础。我们希望能够继续求真务实，在长期看好的新能源、TMT、高端制造业、医药创新中寻找好的“差异化成长股”，为投资者创造回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值收益率为5.96%，同期业绩比较基准收益率为0.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,845,743,285.05	95.99
	其中：股票	10,845,743,285.05	95.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	252,829,439.28	2.24

8	其他资产	199,666,468.36	1.77
9	合计	11,298,239,192.69	100.00

注：本基金本报告期末通过港股机制投资香港股票的公允价值为1,793,517,286.78元，占基金资产净值比例15.95%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	123,219,754.00	1.10
C	制造业	6,832,028,080.77	60.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,295.06	0.00
E	建筑业	28,041.83	0.00
F	批发和零售业	152,782.82	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	867,578,789.14	7.71
J	金融业	62,797,113.40	0.56
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	389,202,433.53	3.46
M	科学研究和技术服务业	297,600.58	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,819.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	604,575,980.70	5.38
S	综合	172,261,699.20	1.53
	合计	9,052,225,998.27	80.49

5.2.2 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 (%)
信息技术	1, 113, 467, 495. 62	9. 90
电信服务	399, 967, 385. 44	3. 56
基础材料	173, 171, 555. 42	1. 54
地产业	106, 909, 376. 00	0. 95
消费者非必需品	1, 474. 30	0. 00
合计	1, 793, 517, 286. 78	15. 95

注:以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	H02382	舜宇光学科技	5, 522, 600	1, 113, 467, 495. 62	9. 90
2	002475	立讯精密	22, 050, 288	1, 084, 874, 169. 60	9. 65
3	000792	盐湖股份	20, 931, 575	740, 768, 439. 25	6. 59
4	600745	闻泰科技	3, 512, 000	454, 101, 600. 00	4. 04
5	603799	华友钴业	3, 640, 416	401, 574, 288. 96	3. 57
6	300058	蓝色光标	36, 272, 361	389, 202, 433. 53	3. 46
7	300413	芒果超媒	6, 901, 284	382, 171, 132. 56	3. 40
8	000049	德赛电池	6, 519, 788	380, 234, 036. 16	3. 38
9	H01024	快手-W	6, 000, 000	353, 448, 480. 00	3. 14
10	002938	鹏鼎控股	7, 589, 200	322, 009, 756. 00	2. 86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将以套期保值为主要目的，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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的盐湖股份的发行主体青海盐湖工业股份有限公司于2021-09-28受到国家市场监督管理总局的市监处罚[2021]71号，于2021-09-30受到市场监管总局的国市监处罚（2021）71号。罚没合计320.00万元人民币。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,756,161.05
2	应收证券清算款	195,842,910.97
3	应收股利	-
4	应收利息	67,396.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	199,666,468.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300413	芒果超媒	240,008,042.56	2.13	非公开发行限售

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	9,133,806,132.06
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	9,133,806,132.06

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧创新未来18个月封闭运作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

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2022年01月22日