

# 中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

## 2022 年中期报告

2022 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年01月01日起至2022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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§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.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 本报告期投资基金情况.....	60
7.13 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 期末上市基金前十名持有人.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.4 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	66
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.9 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	中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）	
基金简称	中欧汇选一年封闭混合（FOF-LOF）	
基金主代码	501213	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2021年11月10日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,227,640,872.81份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2021年11月19日	
下属分级基金的基金简称	中欧汇选一年封闭混合（FOF-LOF）A	中欧汇选一年封闭混合（FOF-LOF）C
下属分级基金场内简称	中欧汇选FOF	-
下属分级基金的交易代码	501213	013832
报告期末下属分级基金的份额总额	897,883,148.57份	329,757,724.24份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。</p>
投资策略	<p>在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。</p> <p>对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选，其中：对货币型基金，主要从基金规模、流动性、风险、收益率等层面进行评估，以满足流动性管理要求为主。对于指数基金、ETF、大宗商品基金等被动管理的公募基金，本基金主要通过其配合市场、行业板块轮动等进行优选配置，增强投资</p>

	<p>回报。本基金使用日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差等指标评估其投资风格、收益情况、波动性以及回撤等并考虑子基金的基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素，选择优质标的进行投资。对于主动管理的公募非货币型基金，本基金通过基金评价机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法，进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的进行定性分析，并做出最终的投资决策。</p> <p>本基金主要采取自下而上的主动投资管理策略，精选价值被低估的个股。</p> <p>本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”个股研究方式，精选出具有投资价值的优质标的。</p> <p>本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略，力求获取高于业绩比较基准的回报。</p>
业绩比较基准	<p>中证800指数收益率×80% + 银行活期存款利率（税后）×20%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金（FOF），主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，其预期风险和预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金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。</p>

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张燕
	黎忆海	

露负责人	联系电话	021-68609600	0755-83199084
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95555
传真		021-33830351	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		窦玉明	缪建民

## 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	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司；C类份额：中欧基金管理有限公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号；C类份额：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8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
---------------	-----

	(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C
本期已实现收益	26,644,827.45	8,561,697.54
本期利润	-32,239,936.57	-13,099,363.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0359	-0.0397
本期加权平均净值利润率	-3.95%	-4.38%
本期基金份额净值增长率	-3.55%	-3.94%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-22,286,516.23	-9,816,268.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0248	-0.0298
期末基金资产净值	875,596,632.34	319,941,455.56
期末基金份额净值	0.9752	0.9702
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.48%	-2.98%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)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	10.45%	1.00%	7.17%	0.84%	3.28%	0.16%
过去三个月	9.97%	1.42%	4.26%	1.18%	5.71%	0.24%
过去六个月	-3.55%	1.32%	-7.84%	1.17%	4.29%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.48%	1.18%	-6.05%	1.06%	3.57%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*20%。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。

中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)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	10.38%	1.00%	7.17%	0.84%	3.21%	0.16%
过去三个月	9.74%	1.42%	4.26%	1.18%	5.48%	0.24%
过去六个月	-3.94%	1.32%	-7.84%	1.17%	3.90%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.98%	1.18%	-6.05%	1.06%	3.07%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*20%。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

中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)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  
(2021年11月10日-2022年06月30日)



注：本基金基金合同生效日期为2021年11月10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。

中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)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  
(2021年11月10日-2022年06月30日)



注：本基金基金合同生效日期为2021年11月10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、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2022年6月30日，本基金管理人共管理130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		
桑磊	基金经理	2021-11-10	-	14年	历任平安资产管理公司风险管理、组合投资经理，中国平安人寿保险股份有限公司资产配置管理岗、助理资产配置经理，中国平安保险（集团）股份有限公司首席投资官办公室助理资产策略经理，众安在线财产保险股份有限公司资产管理部负责人，永诚保险资产管理有限公司（筹）组合投资经理。2016/12/01加入中欧基金管

					理有限公司, 历任配置研究员、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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20次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

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

上半年股票市场的波动较大，风格的分化也较大，年初股票市场走弱，三、四月份市场出现两轮快速回撤，下跌过程中以新能源为代表的成长板块跌幅较大，但从四月底开始市场强势上涨，上涨过程中以新能源为代表的成长板块力度最大。港股、美股等上半年也走弱下跌；美元指数持续走高，人民币兑美元汇率走弱，黄金和铜等冲高回落，

原油大幅走强后在六月中旬见顶回落，美债收益率在持续走强后同样在六月中旬见到3.5%高位后回落。

本基金今年上半年的主要持仓仍然坚持长期资产配置策略。但在三四月份股票市场快速下跌过程中，基于对景气度、估值、性价比等的判断，通过新能源相关ETF以及成长风格基金等逐步增加成长风格板块的配置，降低银行地产等低估值板块的配置，六月份进行了反向操作，又降低了相关成长风格板块的配置，增加了银行地产等低估值板块的配置。本基金投资的权益类资产以长期业绩优异的主动权益型基金为主，交易便捷的指数型基金为辅，也直接投资了部分个股作为补充，并适当参与新股申购。上半年股票市场波动过程中，部分转债个券出现较好的投资机会，也参与了部分可转债个券的交易性机会。

A股市场的结构性表现使得不同行业之间的估值分化回到去年末类似的状态，以新能源为代表的成长等板块预期充分，估值较高，与此同时金融、地产等行业的估值处于低位，具有较高的相对吸引力。展望未来，A股市场整体的估值水平不高，经济下行压力仍然较大但已度过最艰难的阶段，流动性维持偏宽状态，经济、流动性以及估值的这种组合使得股票市场整体风险不高，但板块之间的较高分化也会使得市场的波动性上升，需要基于景气度、估值、性价比等方面对风格及行业进行一定的切换。

#### 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-3.55%，同期业绩比较基准收益率为-7.84%；C类份额净值增长率为-3.94%，同期业绩比较基准收益率为-7.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为主要投资权益型基金的FOF产品，致力于解决投资者在权益基金投资中面临的资产配置、基金选择、持有体验等难题，打造投资目标清晰、投资策略多元、投资行为稳健的FOF产品，力争满足投资者的权益投资需求。投资策略上，依托中欧优质的权益型基金，从子基金选择、大类资产配置、行业风格选择等多层面优化投资组合，采取多元的投资策略，综合考虑市场机会、长期投资目标、中短期组合波动性等，在实现长期投资目标的同时力争控制基金收益的波动性，致力于提升持有体验。投资组合构建上，采取核心+卫星的策略，核心策略上，从投资目标、投资策略、投资行为三个维度对子基金进行研究，选择投资目标清晰合理，投资策略和投资行为有效并且持续的子基金，在多变的 market 环境中不会集中投资单一市场风格或者行业赛道，而是借鉴田径比赛的理念，在各投资策略的子基金中选择优秀的基金经理构建相对均衡的组合，追求长期好于相应基金品类市场平均水平的表现。在把均衡的核心配置作为压舱石的基础上，根据市场情况，分别立足长期特征、中期基本面、短期机会，把握大类资产配置以及行业风格的投资机会。立足长期特征，把握各大类资产和行业风格的长期收益风险特征，

根据各大类资产和行业风格的长期特征进行适当投资。立足中期基本面，将经济、流动性、估值相结合判断各大类资产的中期投资机会，并判断各行业风格的中期景气度。立足短期机会，寻找各大类资产及行业风格的投资机会，力争提升组合投资收益，降低组合投资风险。

#### 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、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,977,219.88	23,711,535.34
结算备付金		151,646.68	3,214,689.64
存出保证金		67,213.79	16,434.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,188,240,972.32	1,214,708,815.59
其中：股票投资		160,555,502.78	135,096,800.77
基金投资		1,002,033,782.66	1,076,985,014.82
债券投资		25,651,686.88	2,627,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	218,592.25	265,949.93
资产总计		1,196,655,644.92	1,241,917,425.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		469,964.87	466,484.40
应付托管费		184,627.09	209,743.79
应付销售服务费		199,931.12	225,231.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		103.15	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	262,930.79	138,577.52



负债合计		1,117,557.02	1,040,037.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,227,640,872.81	1,227,640,872.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-32,102,784.91	13,236,515.35
净资产合计		1,195,538,087.90	1,240,877,388.16
负债和净资产总计		1,196,655,644.92	1,241,917,425.40

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额1,227,640,872.81份，其中下属A类基金份额净值为人民币0.9752元，基金份额897,883,148.57份；下属C类基金份额净值为人民币0.9702元，基金份额329,757,724.24份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-40,499,128.71
1. 利息收入		38,195.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,195.36
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,558,874.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,370,441.45
基金投资收益	6.4.7.11	13,936,356.77
债券投资收益	6.4.7.12	1,022,174.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
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	16,229,902.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-80,545,825.25
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	1,449,626.41
<b>减：二、营业总支出</b>		4,840,171.55
1. 管理人报酬		2,437,609.57
2. 托管费		1,105,770.30
3. 销售服务费		1,187,688.24
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		3,653.41
其中：卖出回购金融资产支出		3,653.41
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		65.21
8. 其他费用	6.4.7.20	105,384.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-45,339,300.26
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-45,339,300.26
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-45,339,300.26

注：本基金基金合同于2021年11月10日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	1,227,640,87 2.81	-	13,236,515.3 5	1,240,877,38 8.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	1,227,640,87 2.81	-	13,236,515.3 5	1,240,877,38 8.16
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-	-	-45,339,300. 26	-45,339,300. 26
(一)、综合收益总 额	-	-	-45,339,300. 26	-45,339,300. 26
(二)、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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回 款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,227,640,87 2.81	-	-32,102,784. 91	1,195,538,08 7.90

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

中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）（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[2021]3047号《关于准予中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）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《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，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1,227,518,301.67元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第61362990\_B39号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》于2021年11月10日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为1,227,640,872.81份基金份额，其中包含认购资金利息折合122,571.14份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为897,883,148.57份，包含认购利息折合94,102.29份；C类基金的基金份额总额为329,757,724.24份，包含认购利息折合28,468.85份。本基金的基金管理人及C类基金份额注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，A类基金份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招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《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金、香港互认基金）、股票（包含创业板及其他经中国证监会允许上市的其他股票、存托凭证）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的其他股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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）。

封闭运作期内，本基金的投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金、香港互认基金）；本基金对权益

类资产的投资合计占基金资产的比例为60%-100%（其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%），本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；（2）基金最近4期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于60%。如法律法规或监管机构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×80%+银行活期存款利率（税后）×20%。

#### 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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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3号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022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自2022年1月1日起至2022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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金

融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（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）本基金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。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融

资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币23,711,535.34元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,667.06元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币23,713,202.40元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币3,214,689.64元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,591.26元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币3,216,280.90元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币16,434.90元，自应收利息转入的重分类金额为人民币8.14元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币16,443.04元。

其他资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币262,625.89元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.00元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币262,625.89元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币3,324.04元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,667.06元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币1,591.26元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币8.14元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币57.58元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币0.00元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币0.00元，转出至其他资产的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,214,708,815.59元，自应收利息转入的重分类金额为人民币57.58元。经上述重分类

后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,214,708,873.17元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金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 2022年06月30日
活期存款	7,977,219.88
等于：本金	7,976,147.12
加：应计利息	1,072.76
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	7,977,219.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		158,411,803.40	-	160,555,502.78	2,143,699.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,881,185.15	42,012.68	25,651,686.88	-271,510.95
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,881,185.15	42,012.68	25,651,686.88	-271,510.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,071,424,163.71	-	1,002,033,782.66	-69,390,381.05
其他		-	-	-	-
合计		1,255,717,152.26	42,012.68	1,188,240,972.32	-67,518,192.62

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应收利息	-
其他应收款	218,592.25
待摊费用	-
合计	218,592.25

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	150,341.36
其中：交易所市场	150,341.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	53,082.06
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	262,930.79

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额



上年度末	897,883,148.57	897,883,148.57
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	897,883,148.57	897,883,148.57

金额单位：人民币元

项目 (中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	329,757,724.24	329,757,724.24
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	329,757,724.24	329,757,724.24

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、截至2022年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为290,892,663.00份，均为中欧汇选一年封闭混合A类基金份额。托管在场外未上市交易的基金份额为936,748,209.81份，其中中欧汇选一年封闭混合A类基金份额606,990,485.57份，中欧汇选一年封闭混合C类基金份额329,757,724.24份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现本基金A类基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A

单位：人民币元

项目 (中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	423,609.48	9,529,810.86	9,953,420.34
本期利润	26,644,827.45	-58,884,764.02	-32,239,936.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,068,436.93	-49,354,953.16	-22,286,516.23

#### 6.4.7.8.2 中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C

单位：人民币元

项目 (中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-214,726.76	3,497,821.77	3,283,095.01
本期利润	8,561,697.54	-21,661,061.23	-13,099,363.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,346,970.78	-18,163,239.46	-9,816,268.68

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	34,696.92
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	3,153.65
其他	344.79
合计	38,195.36

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	119,577,999.71
减：卖出股票成本总额	111,858,709.36
减：交易费用	348,848.90
买卖股票差价收入	7,370,441.45

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	333,967,707.02
减：卖出/赎回基金成本总额	320,017,940.43
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	13,409.82
基金投资收益	13,936,356.77

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	25,368.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	996,805.91
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	1,022,174.46

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,447,406.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,439,911.31
减：应计利息总额	10,628.28
减：交易费用	60.70
买卖债券差价收入	996,805.91

#### 6.4.7.13 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	703,008.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	15,526,893.82
合计	16,229,902.09

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-80,545,825.25
——股票投资	544,008.42
——债券投资	-271,510.95
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-80,818,322.72
——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	-80,545,825.25

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	1,449,626.41
合计	1,449,626.41

#### 6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022年01月01日至2022年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,457,411.89
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	5,728,905.42
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	959,390.85
当期交易基金产生的申购费（元）	1,000.30
当期交易基金产生的赎回费（元）	0.00

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	41,235.42
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,642.03
合计	105,384.82

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未发生重大关联方关系变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国都证券	97,951,873.52	40.13%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
国都证券	61,168,197.90	100.00%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
国都证券	28,000,000.00	100.00%

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	72,519.74	40.43%	64,669.35	43.02%

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,437,609.57
其中：支付销售机构的客户维护费	2,293,196.11

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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，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资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、本基金合同于2021年11月10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 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,105,770.30

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$



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资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、本基金合同于2021年11月10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 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧汇选一年封闭混合 (FOF-LOF) A	中欧汇选一年封闭混合 (FOF-LOF) C	合计
招商银行	0.00	1,141,978.44	1,141,978.44
中欧基金	0.00	360.28	360.28
合计	0.00	1,142,338.72	1,142,338.72

注：

1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%，销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.80%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日资产净值

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，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金合同于2021年11月10日生效，故无上年可比数据。

#### 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

中欧汇选一年封闭混合（FOF-LOF）A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	89,999,990.00
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	89,999,990.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.02%

中欧汇选一年封闭混合（FOF-LOF）C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022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。  
 3、本基金合同于2021年11月10日生效，故无上年可比数据。

#### 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	7,977,219.88	34,696.92

注： 1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。  
 2、本基金合同于2021年11月10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

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人中欧基金管理有限公司所管理的基金合计人民币592,332,998.65元。占本基金资产净值的比例为59.11%。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2022年01月01日至2022年06月30日
	当期交易基金产生的申购费（元）

当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,449,626.41
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,131,670.14
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	694,860.30

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型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（2022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	受限期	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
600941	中国移动	2021-12-24	6个月以上	新股流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688223	晶科能源	2022-01-19	6个月以上	新股流通受限	5.00	14.47	126,735	633,675.00	1,833,855.45	-
688062	迈威生物	2022-01-06	6个月以上	新股流通受限	34.80	16.78	25,176	876,124.80	422,453.28	-
688238	和元生物	2022-03-15	6个月以上	新股流通受限	13.23	25.32	12,836	169,820.28	325,007.52	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	新股流通受限	17.27	14.83	3,581	61,843.87	53,106.23	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	新股流通受限	48.60	31.38	1,453	70,620.72	45,595.14	-

301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	新股流通受限	72.91	45.69	859	62,628.90	39,247.71	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月以上	新股流通受限	76.56	51.92	697	53,362.32	36,188.24	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月以上	新股流通受限	96.66	87.82	324	31,316.40	28,453.68	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月以上	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月以上	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月以上	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月以上	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-

3011 17	佳缘 科技	2022 -01- 07	6个 月以 上	新股 流通 受限	46.8 0	54.4 4	262	12,2 61.6 0	14,2 63.2 8	-
3012 58	富士 莱	2022 -03- 21	6个 月以 上	新股 流通 受限	48.3 0	41.6 8	295	14,2 48.5 0	12,2 95.6 0	-
3011 16	益客 食品	2022 -01- 10	6个 月以 上	新股 流通 受限	11.4 0	20.4 6	577	6,57 7.80	11,8 05.4 2	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个 月以 上	新股 流通 受限	56.6 9	41.8 6	261	14,7 96.0 9	10,9 25.4 6	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个 月以 上	新股 流通 受限	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	6个 月以 上	新股 流通 受限	64.0 8	37.5 2	271	17,3 65.6 8	10,1 67.9 2	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个 月以 上	新股 流通 受限	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-
3011 10	青木 股份	2022 -03- 04	6个 月以 上	新股 流通 受限	63.1 0	39.8 5	202	12,7 46.2 0	8,04 9.70	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	6个 月以 上	新股 流通 受限	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	-

#### 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2022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2022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中基金(FOF)，风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、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。本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。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，督察长、监察稽核部、风险管理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进行审议和决策。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，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。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公司的证券不得超过该证券的10%。在开放期，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2022年06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、公开募集的证券投资基金、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提前支取的定期存款，证券投资基金可在基金销售机构申购、赎回，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间



公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	7,977,219.88	-	-	-	7,977,219.88
结算备付金	151,646.68	-	-	-	151,646.68
存出保证金	67,213.79	-	-	-	67,213.79
交易性金融资产	-	11,241,592.10	14,410,094.78	1,162,589,285.44	1,188,240,972.32
其他资产	-	-	-	218,592.25	218,592.25
资产总计	8,196,080.35	11,241,592.10	14,410,094.78	1,162,807,877.69	1,196,655,644.92
负债					
应付管	-	-	-	469,964.87	469,964.87

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	184,627.09	184,627.09
应付销售服务费	-	-	-	199,931.12	199,931.12
应交税费	-	-	-	103.15	103.15
其他负债	-	-	-	262,930.79	262,930.79
负债总计	-	-	-	1,117,557.02	1,117,557.02
利率敏感度缺口	8,196,080.35	11,241,592.10	14,410,094.78	1,161,690,320.67	1,195,538,087.90
上年度末 2021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	23,711,535.34	-	-	-	23,711,535.34
结算备付金	3,214,689.64	-	-	-	3,214,689.64
存出保证金	16,434.90	-	-	-	16,434.90
交易性金融资产	-	-	2,627,000.00	1,212,081,815.59	1,214,708,815.59
应收利息	-	-	-	3,324.04	3,324.04
其他资产	-	-	-	262,625.89	262,625.89
资产总计	26,942,659.88	-	2,627,000.00	1,212,347,765.52	1,241,917,425.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	466,484.40	466,484.40
应付托管费	-	-	-	209,743.79	209,743.79
应付销售服务	-	-	-	225,231.53	225,231.53

费					
应付交易费用	-	-	-	126,730.88	126,730.88
其他负债	-	-	-	11,846.64	11,846.64
负债总计	-	-	-	1,040,037.24	1,040,037.24
利率敏感度缺口	26,942,659.88	-	2,627,000.00	1,211,307,728.28	1,240,877,388.16

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2022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2.15% (2021年12月31日:0.21%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金及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 2022年06月30日		上年度末 2021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	160,555,502.78	13.43	135,096,800.77	10.89
交易性金融资产—基金投资	1,002,033,782.66	83.81	1,076,985,014.82	86.79
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,162,589,285.44	97.24	1,212,081,815.59	97.68

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	65,457,139.95	47,182,075.08
	2. 业绩比较基准下降5%	-65,457,139.95	-47,182,075.08

于2022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13.43%（2021年12月31日：10.89%），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（2021年12月31日：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,179,933,702.77	1,203,802,583.22
第二层次	-	10,841,904.67
第三层次	8,307,269.55	64,327.70
合计	1,188,240,972.32	1,214,708,815.59

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。本财务报表已于2022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	160,555,502.78	13.42

	其中：股票	160,555,502.78	13.42
2	基金投资	1,002,033,782.66	83.74
3	固定收益投资	25,651,686.88	2.14
	其中：债券	25,651,686.88	2.14
	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	8,128,866.56	0.68
8	其他各项资产	285,806.04	0.02
9	合计	1,196,655,644.92	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,902,726.80	1.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,332,402.50	0.45
J	金融业	106,445,209.30	8.90
K	房地产业	26,498,108.00	2.22
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	340,862.26	0.03

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,555,502.78	13.43

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	537,700	19,255,037.00	1.61
2	000001	平安银行	1,276,900	19,127,962.00	1.60
3	600919	江苏银行	2,600,800	18,517,696.00	1.55
4	601166	兴业银行	902,337	17,956,506.30	1.50
5	600383	金地集团	1,011,900	13,599,936.00	1.14
6	001979	招商蛇口	960,400	12,898,172.00	1.08
7	601688	华泰证券	853,300	12,116,860.00	1.01
8	000333	美的集团	131,200	7,923,168.00	0.66
9	300059	东方财富	264,000	6,705,600.00	0.56
10	000858	五粮液	30,800	6,219,444.00	0.52
11	000783	长江证券	967,000	5,734,310.00	0.48
12	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.44
13	600030	中信证券	192,050	4,159,803.00	0.35
14	600887	伊利股份	89,000	3,466,550.00	0.29
15	601318	中国平安	61,500	2,871,435.00	0.24

16	688223	晶科能源	126,735	1,833,855.45	0.15
17	600690	海尔智家	60,000	1,647,600.00	0.14
18	688062	迈威生物	25,176	422,453.28	0.04
19	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.03
20	301217	铜冠铜箔	3,581	53,106.23	0.00
21	301236	软通动力	1,453	45,595.14	0.00
22	301206	三元生物	859	39,247.71	0.00
23	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
24	301200	大族数控	697	36,188.24	0.00
25	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
26	301219	腾远钴业	324	28,453.68	0.00
27	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
28	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
29	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
30	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
31	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
32	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
33	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
34	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
35	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
36	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
37	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
38	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
39	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
40	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
41	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
42	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
43	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	001979	招商蛇口	22,900,849.00	1.85
2	000001	平安银行	17,999,248.00	1.45
3	002142	宁波银行	17,999,033.09	1.45
4	601166	兴业银行	17,199,665.85	1.39
5	600919	江苏银行	17,199,373.00	1.39
6	300750	宁德时代	15,226,195.00	1.23
7	600383	金地集团	11,721,343.00	0.94
8	601658	邮储银行	2,182,180.00	0.18
9	000858	五粮液	2,085,000.00	0.17
10	688197	首药控股	968,013.90	0.08
11	688062	迈威生物	876,124.80	0.07
12	301236	软通动力	705,551.28	0.06
13	688223	晶科能源	633,675.00	0.05
14	301206	三元生物	626,289.00	0.05
15	301217	铜冠铜箔	618,386.89	0.05
16	688234	天岳先进	535,568.51	0.04
17	301200	大族数控	533,393.52	0.04
18	688207	格灵深瞳	528,810.59	0.04
19	600030	中信证券	361,471.50	0.03
20	300834	星辉环材	352,813.93	0.03

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	601658	邮储银行	17,325,935.91	1.40
2	300750	宁德时代	17,019,609.60	1.37

3	002142	宁波银行	14,640,426.00	1.18
4	001979	招商蛇口	13,401,486.00	1.08
5	601166	兴业银行	12,916,979.51	1.04
6	000001	平安银行	11,229,698.00	0.90
7	000002	万科A	7,126,527.00	0.57
8	600048	保利发展	4,804,835.00	0.39
9	601009	南京银行	4,032,117.00	0.32
10	601899	紫金矿业	3,186,069.00	0.26
11	600941	中国移动	2,156,560.00	0.17
12	688197	首药控股	766,630.38	0.06
13	301217	铜冠铜箔	720,176.52	0.06
14	301206	三元生物	646,896.54	0.05
15	688234	天岳先进	539,419.92	0.04
16	688176	亚虹医药	536,199.00	0.04
17	301236	软通动力	530,884.50	0.04
18	688207	格灵深瞳	459,407.45	0.04
19	301200	大族数控	407,550.00	0.03
20	301207	华兰疫苗	399,242.40	0.03

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	136,773,402.95
卖出股票收入（成交）总额	119,577,999.71

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)	25,651,686.88	2.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,651,686.88	2.15

### 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	113052	兴业转债	129,040	14,410,094.78	1.21
2	110073	国投转债	105,000	11,234,982.74	0.94
3	110067	华安转债	60	6,609.36	0.00

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，基金随着所设定目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例，从而逐步降低整体组合的波动性，并实现风险分散的目标。本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	004813	中欧先进制造股票C	契约型 开放式	28,350,00 2.07	98,547,44 2.20	8.24	是
2	001811	中欧明睿新常态混合A	契约型 开放式	26,752,36 1.61	89,237,85 2.62	7.46	是
3	512200	地产ETF	交易型 开放式	86,482,30 0.00	67,715,64 0.90	5.66	否
4	512880	证券ETF	交易型 开放式	59,183,00 0.00	57,762,60 8.00	4.83	否
5	004232	中欧价值发现混合C	契约型 开放式	22,819,58 8.33	49,438,63 8.12	4.14	是
6	005787	中欧新趋势混合(LOF)C	契约型 开放式	34,106,64 7.24	48,615,61 4.98	4.07	是

7	004236	中欧新动力混合(LOF)C	契约型 开放式	13,884,26 0.80	46,899,64 4.56	3.92	是
8	004235	中欧价值智选混合C	契约型 开放式	9,908,24 9.61	45,624,51 6.98	3.82	是
9	001955	中欧养老混合A	契约型 开放式	16,144,65 6.12	45,511,78 5.60	3.81	是
10	004231	中欧行业成长混合(LOF)C	契约型 开放式	21,282,93 5.34	41,967,82 0.20	3.51	是
11	002685	中欧丰泓沪港深灵活配置混合A	契约型 开放式	29,887,47 3.66	41,872,35 0.60	3.50	是
12	002961	中欧双利债券A	契约型 开放式	30,465,26 6.56	37,642,88 3.36	3.15	是
13	512660	军工ETF	交易型 开放式	29,918,40 0.00	35,004,52 8.00	2.93	否
14	512800	银行ETF	交易型 开放式	28,068,80 0.00	32,026,50 0.80	2.68	否
15	011932	工银战略远见混合A	契约型 开放式	27,282,54 9.38	26,704,15 9.33	2.23	否
16	006567	中泰星元灵活配置混合A	契约型 开放式	9,141,98 2.08	22,726,96 7.45	1.90	否
17	000729	建信中小盘先锋股票A	契约型 开放式	4,962,53 1.02	21,552,27 2.22	1.80	否
18	006229	中欧医疗创新股票C	契约型 开放式	10,268,20 5.53	20,562,08 1.57	1.72	是
19	001667	南方转型增长灵活配置混合A	契约型 开放式	9,174,26 6.06	19,366,87 5.65	1.62	否
20	001018	易方达新经济混合	契约型 开放式	4,628,37 4.70	19,022,62 0.02	1.59	否
21	450004	国富深化价值混合	契约型 开放式	9,173,20 4.44	18,961,01 3.58	1.59	否
22	000532	景顺长城优势企业混合	契约型 开放式	4,916,17 5.02	18,927,27 3.83	1.58	否

23	377240	上投摩根新兴动力混合A	契约型 开放式	2,613,90 6.68	18,295,25 5.63	1.53	否
24	005680	财通资管价值成长混合A	契约型 开放式	6,258,88 0.23	16,847,65 3.80	1.41	否
25	310358	申万菱信新经济混合	契约型 开放式	11,093,55 8.66	12,543,48 6.78	1.05	否
26	159996	家电ETF	交易型 开放式	10,000,00 0.00	11,590,00 0.00	0.97	否
27	512000	券商ETF	交易型 开放式	11,406,30 0.00	10,653,48 4.20	0.89	否
28	001000	中欧明睿新起点混合	契约型 开放式	4,154,45 7.91	9,110,72 6.20	0.76	是
29	002621	中欧消费主题股票A	契约型 开放式	3,802,28 1.37	8,847,90 8.75	0.74	是
30	001938	中欧时代先锋股票A	契约型 开放式	5,257,62 3.55	8,453,73 2.91	0.71	是
31	511990	华宝添益	契约型 开放式	3.00	300.00	0.00	否
32	515790	光伏ETF	交易型 开放式	85.00	143.82	0.00	否

### 7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 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。

### 7.13.3 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	67,213.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	218,592.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,806.04

#### 7.13.4 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	113052	兴业转债	14,410,094.78	1.21
2	110073	国投转债	11,234,982.74	0.94
3	110067	华安转债	6,609.36	0.00

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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
中欧汇选	8,258	108,728.89	130,214,427.00	14.50%	767,668,721.57	85.50%

一年封闭混合(FOF-LOF)A						
中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C	3,141	104,984.95	0.00	0.00%	329,757,724.24	100.00%
合计	11,399	107,697.24	130,214,427.00	10.61%	1,097,426,445.81	89.39%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中欧基金管理有限公司	89,999,990.00	30.94%
2	申万宏源证券有限公司（招赢通）	35,998,720.00	12.38%
3	王惠星	26,460,201.00	9.10%
4	刘春梅	5,499,000.00	1.89%
5	张海涛	2,638,060.00	0.91%
6	周玉雄	2,635,773.00	0.91%
7	肖可欣	1,984,126.00	0.68%
8	王兴根	1,784,511.00	0.61%
9	彭若波	1,559,990.00	0.54%
10	陈莹	1,488,162.00	0.51%

注：上表所列持有人均为场内持有人。

## 8.3 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	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A	99,019.80	0.01%
	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C	551,060.72	0.17%
	合计	650,080.52	0.05%

#### 8.4 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	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A	0
	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A	0
	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)A	中欧汇选一年封闭混合(FOF-LOF)C
基金合同生效日(2021年11月10日)基金份额总额	897,883,148.57	329,757,724.24
本报告期期初基金份额总额	897,883,148.57	329,757,724.24
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	897,883,148.57	329,757,724.24

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有重大改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 比例		量的比 例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	97,951,873.52	40.13%	72,519.74	40.43%	-
海通证券	1	146,139,013.13	59.87%	106,872.63	59.57%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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。

2. 本报告期内，本基金新增东方证券上海、兴业证券上海、天风证券上海、方正证券上海、太平洋证券上海、新时代证券上海和华金证券上海交易单元。

### 10.8.2 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

东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	61,168,197.90	100.00%	28,000,000.00	100.00%	-	-	431,694,832.61	100.00%
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

2. 本报告期内，本基金新增东方证券上海、兴业证券上海、天风证券上海、方正证券上海、太平洋证券上海、新时代证券上海和华金证券上海交易单元。

### 10.9 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	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2022年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022-04-22
2	中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）2022年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2022-04-22
3	中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022-05-27
4	中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）更新招募说明书(2022年6月)	中国证监会指定媒介	2022-06-21

## § 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、中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）相关批准文件
- 2、《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》
- 3、《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》
- 4、《中欧汇选一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日