

# 中欧小盘成长混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧小盘成长混合型证券投资基金	
基金简称	中欧小盘成长混合	
基金主代码	015880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 28 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	402,208,198.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
下属分级基金的交易代码	015880	015881
报告期末下属分级基金的份额总额	238,880,756.42 份	163,327,442.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选股票，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	<p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 小盘股票的定义</p> <p>对于中国 A 股市场和香港股票市场，本基金将股票总市值处于国证 2000 指数成分股的总市值区间内的股票定义为小盘股票，并每半年根据指数变动进行相应调整。</p> <p>在此期间，对于未纳入的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其总市值或预计总市值（如对于未上市新股）能够满足以上标准，也将纳入小盘股票的备选投资范围。遇到停牌或暂停交易的股票，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算其总市值。</p> <p>(2) 成长的定义</p> <p>本基金将在上述定义的小盘股票中，采用量化选股模型，精选资产规模、盈利能力、市场占有率持续高增长的公司。对于成长性本基金将分别对公司资产规模、盈利能力、市场占有率的维度的增长进行重点考量并打分，同时综合评估，选择综合打分高于行业平均的优质上市公司。</p> <p>2、债券投资策略</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	国证 2000 指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率

	*5%+银行活期存款利率（税后）*5%
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。本基金如投资港股通标的股票，还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	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	罗琦
	联系电话	021-68609600	020-66338888
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95575
传真		021-33830351	020-87553363-6847
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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、10、16 层	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码		200120	510627
法定代表人		竇玉明	林传辉

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	基金管理人的办公场所。

### 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 479 号上海中心大厦 8、10、16 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
本期已实现收益	-39,070,012.96	-25,435,167.98
本期利润	-46,009,867.94	-36,150,653.56
加权平均基金份	-0.1676	-0.1851

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	-19.44%	-21.62%
本期基金份额净值增长率	-15.40%	-15.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-40,931,365.87	-29,603,012.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1713	-0.1812
期末基金资产净值	197,949,390.55	133,724,430.38
期末基金份额净值	0.8287	0.8188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.13%	-18.12%

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

中欧小盘成长混合 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	-5.66%	1.24%	-8.17%	1.42%	2.51%	-0.18%
过去三个月	-5.09%	1.41%	-10.35%	1.53%	5.26%	-0.12%
过去六个月	-15.40%	1.88%	-17.45%	1.94%	2.05%	-0.06%

过去一年	-19.21%	1.50%	-23.61%	1.52%	4.40%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-17.13%	1.29%	-24.29%	1.32%	7.16%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率\*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%+银行活期存款利率(税后)\*5%。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。

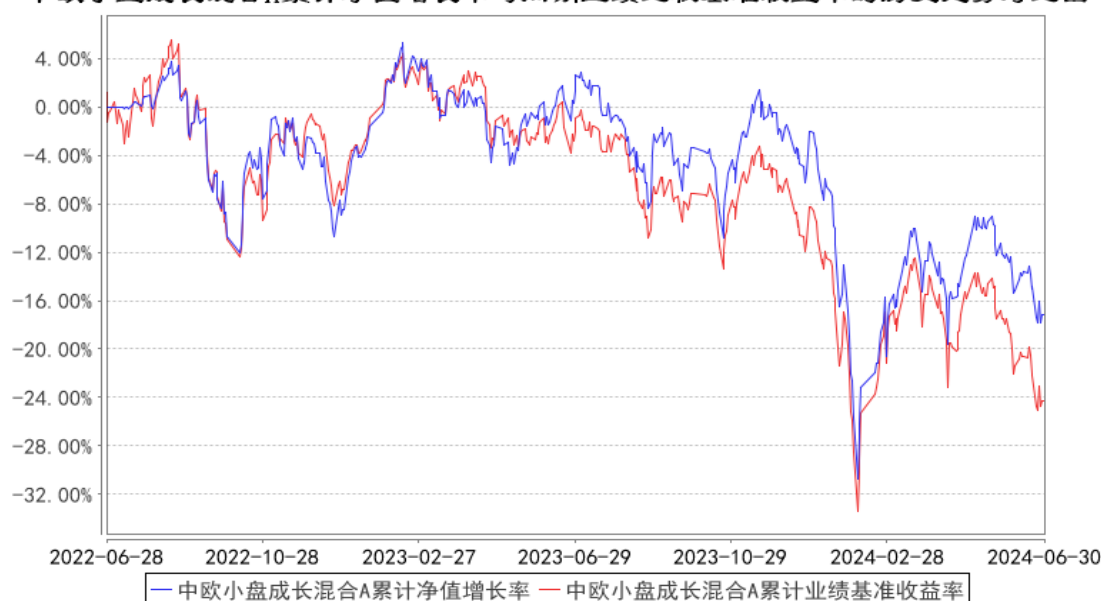
中欧小盘成长混合 C

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	-5.70%	1.24%	-8.17%	1.42%	2.47%	-0.18%
过去三个月	-5.23%	1.41%	-10.35%	1.53%	5.12%	-0.12%
过去六个月	-15.66%	1.88%	-17.45%	1.94%	1.79%	-0.06%
过去一年	-19.69%	1.50%	-23.61%	1.52%	3.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-18.12%	1.29%	-24.29%	1.32%	6.17%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率\*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%+银行活期存款利率(税后)\*5%。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。

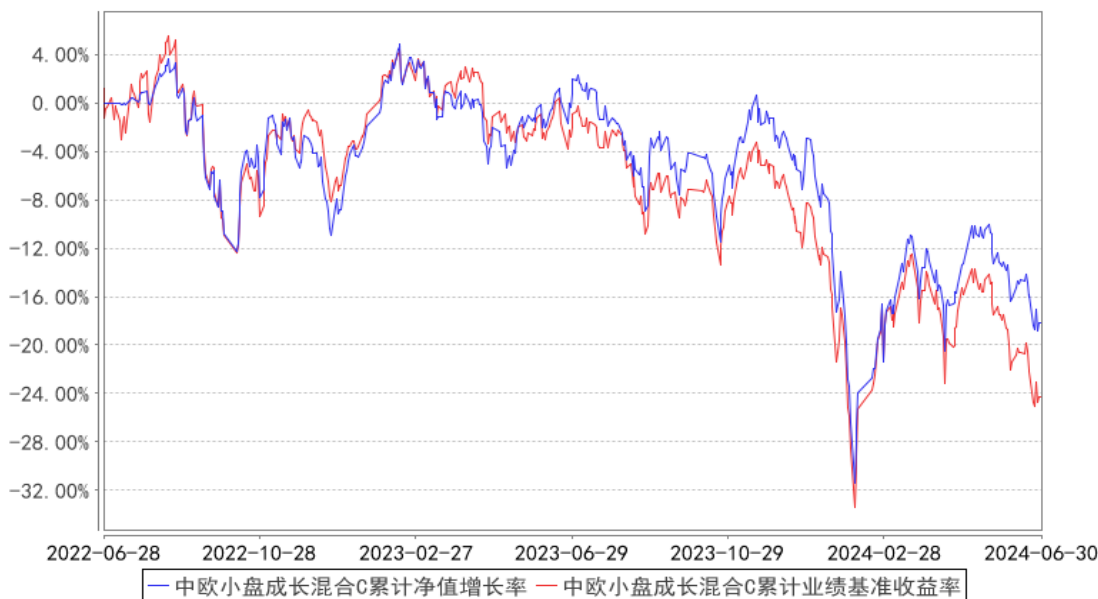
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧小盘成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





中欧小盘成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、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）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）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、深圳分公司、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、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至2024年6月30日，本基金管理人共管理175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		
钱亚婷	基金经理	2022-06-28	-	8年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	2年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。

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《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》等相关规定。

#### 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 14 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

回顾上半年，国内宏观经济处于结构性复苏中，制造业投资和出口增速强于社零消费和地产链投资增速。二级市场方面，年初经历了一轮流动性冲击，上证指数于 2 月初下探至 2020 年以来的低点，随后在 3 月至 5 月有所反弹，但在半年末重新跌破 3000 点大关。市场整体表现较为疲软，尤其是消费和医药板块下跌较多，年初的微盘股释放风险，发生较大调整，也加剧了市场风险偏好收缩。对比来看，受益于低风险情绪的高股息板块，如银行、公共事业等，具有明显防守属性，受到资金青睐，成为上半年重要“避风港”。同时，出口占比较高的公司，受益于全球通胀和中国制造的优势，在上半年也有相对较好的表现。展望下半年，市场的定价重心或重新聚焦基本面，预计政策层面或将更加聚焦于需求端的刺激措施，但国内信心提振进度与海外降息节奏不明

朗等因素，仍值得密切关注。

本基金是以国证 2000 指数为主要标准配置基金资产，投资于本基金界定的小盘成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，以业绩成长为主要的选股逻辑。我们当下研究工作的重点是寻找盈利边际改善，同时估值合理的投资机会：一是中游部分行业的库存周期开始上行，例如电子里的 PCB 和部分芯片公司，这也和全球半导体周期的上行趋势相互印证；二是受益于海外库存回补的出口链，比如部分轻工、小家电和汽车；三是部分细分高端制造业，例如新材料、电网设备和通信设备。我们希望从基本面选股逻辑出发，在被主流投资市场疏漏的小盘领域选择质地优秀的公司，借助量化模型的高效率来实现价值发现的功能，并且在持股的过程中，陪伴公司成长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-15.40%，同期业绩比较基准收益率为-17.45%；基金 C 类份额净值增长率为-15.66%，同期业绩比较基准收益率为-17.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二十届三中全会强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，预计下半年国内宏观政策以稳为主。流动性角度来看，美联储有望在 9 月份开启降息周期，中美利差的收窄，有利于缓解人民币汇率压力，7 月下旬以来，央行已经先后下调 7 天逆回购、LPR、MLF 利率，未来有望进一步宽松。我们预计下半年经济增长动能改善，通胀温和回升，名义 GDP 增速可能回升。当前 A 股市场总体处于低估区域，预计下行的空间不大。展望下半年，在经济结构调整的背景下，地产稳定政策对总需求的影响还需要等待和观察，比较难有一蹴而就的景气趋势投资机会，当前更需要结合估值位置，寻找稳定增长的投资机会。我们看好上市公司中盈利边际改善，同时估值合理的投资机会，市场有望恢复到以业绩为驱动的状态，业绩是公司价值的抓手，公司价值是股价的抓手。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对中欧小盘成长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》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，中欧基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧小盘成长混合型证券投资基金 2024 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：中欧小盘成长混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产:</b>			
货币资金	6.4.7.1	14,807,613.16	32,333,758.96
结算备付金		4,345,635.55	3,527,331.98
存出保证金		246,772.80	561,273.60
交易性金融资产	6.4.7.2	314,750,227.81	511,338,509.50
其中: 股票投资		306,612,430.54	503,150,404.84
基金投资		-	-
债券投资		8,137,797.27	8,188,104.66
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		196,732.96	3,702,588.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		334,346,982.28	551,463,462.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		2,000,455.44	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		134,229.10	678,186.71
应付管理人报酬		341,525.05	526,716.80
应付托管费		42,690.65	65,839.58
应付销售服务费		69,601.11	127,610.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	84,660.00	60,015.64
负债合计		2,673,161.35	1,458,368.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	402,208,198.84	563,713,178.91
未分配利润	6.4.7.8	-70,534,377.91	-13,708,085.55
净资产合计		331,673,820.93	550,005,093.36
负债和净资产总计		334,346,982.28	551,463,462.29

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 402,208,198.84 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.8287 元，基金份额总额 238,880,756.42 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 0.8188 元，基金份额总额 163,327,442.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-78,839,656.60	57,330,082.62
1. 利息收入		78,714.95	73,331.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	78,714.95	73,331.15
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-61,698,063.76	19,356,593.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-66,577,961.21	14,529,969.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	70,139.42	207,129.60
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	271,360.99	10,856.28
股利收益	6.4.7.14	4,538,397.04	4,608,638.34
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-17,655,340.56	36,314,000.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	435,032.77	1,586,157.17
<b>减：二、营业总支出</b>		3,320,864.90	4,818,745.07
1. 管理人报酬		2,402,486.01	3,735,963.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		300,310.79	373,596.29
3. 销售服务费		496,034.98	571,873.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		26,607.84	47,984.93
其中：卖出回购金融资产支出		26,607.84	47,984.93
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,889.92	66.60
8. 其他费用	6.4.7.18	93,535.36	89,260.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-82,160,521.50	52,511,337.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-82,160,521.50	52,511,337.55
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-82,160,521.50	52,511,337.55

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中欧小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	563,713,178.91	-	-13,708,085.55	550,005,093.36
二、本期期初净资产	563,713,178.91	-	-13,708,085.55	550,005,093.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-161,504,980.07	-	-56,826,292.36	-218,331,272.43
（一）、综合收益总额	-	-	-82,160,521.50	-82,160,521.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-161,504,980.07	-	25,334,229.14	-136,170,750.93

其中：1. 基金申购款	75,381,855.65	-	-6,981,190.42	68,400,665.23
2. 基金赎回款	-236,886,835.72	-	32,315,419.56	-204,571,416.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	402,208,198.84	-	-70,534,377.91	331,673,820.93
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	420,906,982.18	-	-36,274,522.38	384,632,459.80
二、本期期初净资产	420,906,982.18	-	-36,274,522.38	384,632,459.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	223,203,934.23	-	51,083,768.64	274,287,702.87
(一)、综合收益总额	-	-	52,511,337.55	52,511,337.55
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	223,203,934.23	-	-1,427,568.91	221,776,365.32
其中：1. 基金申购款	761,916,519.34	-	1,514,810.93	763,431,330.27
2. 基金赎回款	-538,712,585.11	-	-2,942,379.84	-541,654,964.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	644,110,916.41	-	14,809,246.26	658,920,162.67

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：

<u>刘建平</u>	<u>杨毅</u>	<u>王音然</u>
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

中欧小盘成长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[2022]1002 号文《关于准予中欧小盘成长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《中欧小盘成长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 645,959,940.96 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990\_B33 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧小盘成长混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 646,090,840.54 份基金份额，其中包含认购资金利息折合 130,899.58 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 375,681,461.40 份，包含认购利息折合 85,711.49 份；C 类基金的基金份额总额为 270,409,379.14 份，包含认购利息折合 45,188.09 份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧小盘成长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（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、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）、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（不含合约类信用衍生品）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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于本基金界定的小盘成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 20%；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%。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：国证 2000 指数收益率×90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,096,769.17
等于：本金	1,096,595.65
加：应计利息	173.52
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	13,710,843.99
等于：本金	13,709,179.14
加：应计利息	1,664.85
减：坏账准备	-
合计	14,807,613.16

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	320,797,902.88	-	306,612,430.54	-14,185,472.34	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,014,050.00	124,697.27	8,137,797.27	-950.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,014,050.00	124,697.27	8,137,797.27	-950.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	328,811,952.88	124,697.27	314,750,227.81	-14,186,422.34

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,075,280.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,075,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,075,280.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2408	IF2408	2.00	2,056,440.00	-18,840.00
合计				-18,840.00
减：可抵销期货暂收款				-18,840.00
净额				0.00

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 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

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-审计费	24,863.02
其他应付	55.50
合计	84,660.00

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧小盘成长混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	313,233,796.40	313,233,796.40
本期申购	28,264,714.04	28,264,714.04
本期赎回（以“-”号填列）	-102,617,754.02	-102,617,754.02
本期末	238,880,756.42	238,880,756.42

##### 中欧小盘成长混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,479,382.51	250,479,382.51
本期申购	47,117,141.61	47,117,141.61
本期赎回（以“-”号填列）	-134,269,081.70	-134,269,081.70
本期末	163,327,442.42	163,327,442.42

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 中欧小盘成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,573,398.73	5,180,712.91	-6,392,685.82

本期期初	-11,573,398.73	5,180,712.91	-6,392,685.82
本期利润	-39,070,012.96	-6,939,854.98	-46,009,867.94
本期基金份额交易产生的变动数	14,703,684.11	-3,232,496.22	11,471,187.89
其中：基金申购款	-3,197,916.75	190,511.79	-3,007,404.96
基金赎回款	17,901,600.86	-3,423,008.01	14,478,592.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,939,727.58	-4,991,638.29	-40,931,365.87

中欧小盘成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,393,994.99	4,078,595.26	-7,315,399.73
本期期初	-11,393,994.99	4,078,595.26	-7,315,399.73
本期利润	-25,435,167.98	-10,715,485.58	-36,150,653.56
本期基金份额交易产生的变动数	10,611,230.54	3,251,810.71	13,863,041.25
其中：基金申购款	-4,794,814.79	821,029.33	-3,973,785.46
基金赎回款	15,406,045.33	2,430,781.38	17,836,826.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,217,932.43	-3,385,079.61	-29,603,012.04

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	5,681.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	39,715.76
结算备付金利息收入	33,317.77
其他	-
合计	78,714.95

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,818,632,404.11
减：卖出股票成本总额	1,882,244,074.84
减：交易费用	2,966,290.48
买卖股票差价收入	-66,577,961.21

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	79,885.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,746.07
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	70,139.42

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,204,550.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,109,741.00
减：应计利息总额	104,550.00
减：交易费用	5.07
买卖债券差价收入	-9,746.07

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	271,360.99

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,538,397.04
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	4,538,397.04

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-17,838,715.29
股票投资	-17,848,646.29
债券投资	9,931.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	183,374.73
权证投资	-
期货投资	183,374.73
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	-17,655,340.56

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	429,456.76
基金转换费收入	5,576.01
合计	435,032.77

## 6.4.7.17 信用减值损失

无。

## 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	93,535.36

## 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

中欧基金管理有限公司已于 2024 年 4 月 9 日正式受让中欧私募基金管理（上海）有限公司全部股权，中欧私募基金管理（上海）有限公司已变更为中欧基金管理有限公司全资子公司。

### 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
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东，基金销售机构
自然人股东	基金管理人股东
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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
广发证券	1,722,461,714.56	48.93	2,133,264,458.76	63.55

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
广发证券	5,074,167.12	100.00	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
广发证券	165,801,000.00	100.00	290,675,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 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 2024年1月1日至2024年6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 (%)
广发证券	893,653.45	48.81	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6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 (%)
广发证券	1,125,095.58	58.25	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,402,486.01
其中：应支付销售机构的客户维护 费	878,148.49	1,414,282.26
应支付基金管理人的净管理费	1,524,337.52	2,321,681.18

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

2、根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费率由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	300,310.79	373,596.29

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C	合计
广发证券	0.00	190,379.04	190,379.04
中欧财富	0.00	4,191.25	4,191.25
中欧基金	0.00	40,314.94	40,314.94
合计	0.00	234,885.23	234,885.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C	合计
广发证券	0.00	206,052.12	206,052.12
中欧财富	0.00	477.71	477.71
中欧基金	0.00	41,726.43	41,726.43
合计	0.00	248,256.26	248,256.26

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 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

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，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划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定 节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金各类基金份额。

##### 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

中欧小盘成长混合 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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	3,155.58	0.00%	53,684.99	0.02%

注：1、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各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,007,373.03	23,115.61	9,534,819.80	15,537.39

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	40.09	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-



301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	70.54	188.01	1,029	72,581.08	193,462.29	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	670	10,854.00	10,693.20	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	205	5,330.00	7,685.45	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-

603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	154	3,595.90	3,870.02	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	674	15,272.84	10,709.86	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	133	11,565.68	23,265.69	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	850	13,336.50	15,971.50	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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 2024 年 06 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 2024 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 2,000,455.44 元，于 2024 年 7 月 1 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。本基金通过精选股票，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。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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 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、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，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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,807,613.16	-	-	-	14,807,613.16
结算备付金	4,345,635.55	-	-	-	4,345,635.55
存出保证金	-	-	-	246,772.80	246,772.80
交易性金融资产	8,137,797.27	-	-	-306,612,430.54	314,750,227.81
应收申购款	-	-	-	196,732.96	196,732.96
资产总计	27,291,045.98	-	-	-307,055,936.30	334,346,982.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	134,229.10	134,229.10
应付管理人报酬	-	-	-	341,525.05	341,525.05
应付托管费	-	-	-	42,690.65	42,690.65
卖出回购金融资产款	2,000,455.44	-	-	-	2,000,455.44
应付销售服务费	-	-	-	69,601.11	69,601.11
其他负债	-	-	-	84,660.00	84,660.00
负债总计	2,000,455.44	-	-	672,705.91	2,673,161.35
利率敏感度缺口	25,290,590.54	-	-	-306,383,230.39	331,673,820.93
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,333,758.96	-	-	-	32,333,758.96
结算备付金	3,527,331.98	-	-	-	3,527,331.98
存出保证金	-	-	-	561,273.60	561,273.60
交易性金融资产	8,188,104.66	-	-	-503,150,404.84	511,338,509.50

应收申购款	-	-	-	3,702,588.25	3,702,588.25
资产总计	44,049,195.60	-	-	507,414,266.69	551,463,462.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	678,186.71	678,186.71
应付管理人报酬	-	-	-	526,716.80	526,716.80
应付托管费	-	-	-	65,839.58	65,839.58
应付销售服务费	-	-	-	127,610.20	127,610.20
其他负债	-	-	-	60,015.64	60,015.64
负债总计	-	-	-	1,458,368.93	1,458,368.93
利率敏感度缺口	44,049,195.60	-	-	-505,955,897.76	550,005,093.36

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 2024 年 6 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 2.45%（2023 年 12 月 31 日：1.49%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	306,612,430.54	92.44	503,150,404.84	91.48

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	306,612,430.54	92.44	503,150,404.84	91.48

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	15,743,257.92	28,736,515.42
业绩比较基准下降5%	-15,743,257.92	-28,736,515.42	

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	306,157,529.47	498,408,936.69
第二层次	8,161,799.82	8,188,104.66
第三层次	430,898.52	4,741,468.15

合计	314,750,227.81	511,338,509.50
----	----------------	----------------

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 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	306,612,430.54	91.70
	其中：股票	306,612,430.54	91.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,137,797.27	2.43
	其中：债券	8,137,797.27	2.43
	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	19,153,248.71	5.73
8	其他各项资产	443,505.76	0.13
9	合计	334,346,982.28	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

金额单位：人民币元

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	1,084,714.00	0.33
B	采矿业	1,606,374.00	0.48
C	制造业	240,198,004.35	72.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,573,842.36	2.28
E	建筑业	4,170,317.00	1.26
F	批发和零售业	652,922.53	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,270,222.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,937,337.30	8.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	884,268.00	0.27
L	租赁和商务服务业	2,497,779.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	3,919,291.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	4,135,243.00	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,375,504.00	1.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,199,504.00	0.96
S	综合	1,107,108.00	0.33
	合计	306,612,430.54	92.44

### 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投资股票。

## 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	688099	晶晨股份	82,600	4,899,832.00	1.48
2	688301	奕瑞科技	37,957	4,373,785.11	1.32
3	002402	和而泰	386,600	4,140,486.00	1.25

4	301367	怡和嘉业	62,920	3,913,624.00	1.18
5	002643	万润股份	384,700	3,847,000.00	1.16
6	000519	中兵红箭	261,500	3,836,205.00	1.16
7	688083	中望软件	51,437	3,735,354.94	1.13
8	003000	劲仔食品	307,300	3,702,965.00	1.12
9	002859	洁美科技	183,900	3,692,712.00	1.11
10	601208	东材科技	495,100	3,594,426.00	1.08
11	605098	行动教育	79,200	3,375,504.00	1.02
12	600373	中文传媒	215,600	3,199,504.00	0.96
13	002605	姚记科技	156,600	3,197,772.00	0.96
14	600866	星湖科技	515,000	2,842,800.00	0.86
15	002083	孚日股份	660,700	2,794,761.00	0.84
16	603992	松霖科技	147,600	2,714,364.00	0.82
17	300833	浩洋股份	55,700	2,584,480.00	0.78
18	000729	燕京啤酒	290,000	2,560,700.00	0.77
19	603611	诺力股份	150,000	2,556,000.00	0.77
20	601636	旗滨集团	385,000	2,483,250.00	0.75
21	002322	理工能科	149,800	2,399,796.00	0.72
22	688408	中信博	25,886	2,383,582.88	0.72
23	300705	九典制药	85,940	2,298,035.60	0.69
24	688252	天德钰	154,800	2,249,244.00	0.68
25	605077	华康股份	146,510	2,234,277.50	0.67
26	002930	宏川智慧	178,700	2,215,880.00	0.67
27	600435	北方导航	254,300	2,192,066.00	0.66
28	603383	顶点软件	67,520	2,165,366.40	0.65
29	000550	江铃汽车	97,800	2,123,238.00	0.64
30	003031	中瓷电子	45,800	2,117,792.00	0.64
31	688127	蓝特光学	113,340	2,084,322.60	0.63
32	002130	沃尔核材	146,000	2,061,520.00	0.62
33	000409	云鼎科技	254,100	2,050,587.00	0.62
34	300623	捷捷微电	117,920	2,040,016.00	0.62
35	002922	伊戈尔	92,400	2,019,864.00	0.61
36	300181	佐力药业	129,770	1,962,122.40	0.59
37	002296	辉煌科技	187,300	1,931,063.00	0.58
38	688510	航亚科技	104,187	1,918,082.67	0.58
39	603283	赛腾股份	24,900	1,902,360.00	0.57
40	600522	中天科技	117,500	1,862,375.00	0.56
41	600487	亨通光电	118,000	1,860,860.00	0.56
42	301187	欧圣电气	75,600	1,833,300.00	0.55
43	688278	特宝生物	34,144	1,828,411.20	0.55
44	000403	派林生物	68,400	1,823,544.00	0.55
45	301313	凡拓数创	89,600	1,823,360.00	0.55
46	688578	艾力斯	28,553	1,819,968.22	0.55

47	002851	麦格米特	70,100	1,811,384.00	0.55
48	603590	康辰药业	70,200	1,792,908.00	0.54
49	300194	福安药业	475,300	1,777,622.00	0.54
50	002993	奥海科技	46,900	1,744,680.00	0.53
51	301004	嘉益股份	19,100	1,738,100.00	0.52
52	603267	鸿远电子	50,900	1,735,690.00	0.52
53	002139	拓邦股份	163,100	1,732,122.00	0.52
54	600879	航天电子	222,500	1,728,825.00	0.52
55	300384	三联虹普	131,100	1,720,032.00	0.52
56	600764	中国海防	87,300	1,713,699.00	0.52
57	300719	安达维尔	100,700	1,706,865.00	0.51
58	600186	莲花控股	496,400	1,702,652.00	0.51
59	300401	花园生物	118,700	1,702,158.00	0.51
60	002116	中国海诚	181,900	1,693,489.00	0.51
61	301000	肇民科技	116,760	1,675,506.00	0.51
62	002572	索菲亚	108,800	1,667,904.00	0.50
63	002273	水晶光电	97,900	1,662,342.00	0.50
64	688019	安集科技	13,200	1,660,560.00	0.50
65	600323	瀚蓝环境	78,694	1,644,704.60	0.50
66	000883	湖北能源	272,000	1,634,720.00	0.49
67	000521	长虹美菱	213,700	1,619,846.00	0.49
68	300303	聚飞光电	332,700	1,616,922.00	0.49
69	002906	华阳集团	60,300	1,613,628.00	0.49
70	002683	广东宏大	79,800	1,606,374.00	0.48
71	300441	鲍斯股份	263,900	1,564,927.00	0.47
72	688498	源杰科技	11,900	1,558,781.00	0.47
73	603365	水星家纺	99,500	1,557,175.00	0.47
74	300403	汉宇集团	225,990	1,543,511.70	0.47
75	601608	中信重工	400,900	1,527,429.00	0.46
76	688409	富创精密	41,341	1,527,136.54	0.46
77	300870	欧陆通	34,145	1,481,210.10	0.45
78	600820	隧道股份	225,600	1,473,168.00	0.44
79	688147	微导纳米	59,134	1,472,436.60	0.44
80	603725	天安新材	228,120	1,416,625.20	0.43
81	000528	柳工	126,450	1,414,975.50	0.43
82	600312	平高电气	72,700	1,414,015.00	0.43
83	301056	森赫股份	183,800	1,409,746.00	0.43
84	300950	德固特	92,400	1,408,176.00	0.42
85	002833	弘亚数控	77,200	1,408,128.00	0.42
86	002282	博深股份	218,000	1,393,020.00	0.42
87	300926	博俊科技	69,181	1,385,003.62	0.42
88	605016	百龙创园	66,816	1,361,041.92	0.41
89	301345	涛涛车业	24,600	1,355,460.00	0.41

90	603112	华翔股份	127,400	1,338,974.00	0.40
91	603111	康尼机电	229,700	1,336,854.00	0.40
92	605305	中际联合	51,740	1,334,374.60	0.40
93	300596	利安隆	49,100	1,332,083.00	0.40
94	002063	远光软件	250,900	1,314,716.00	0.40
95	301309	万得凯	50,500	1,290,780.00	0.39
96	300547	川环科技	78,600	1,285,110.00	0.39
97	600529	山东药玻	50,600	1,282,204.00	0.39
98	000543	皖能电力	143,400	1,269,090.00	0.38
99	300395	菲利华	41,200	1,266,900.00	0.38
100	300435	中泰股份	107,400	1,264,098.00	0.38
101	688484	南芯科技	34,000	1,261,400.00	0.38
102	603393	新天然气	36,200	1,257,588.00	0.38
103	002381	双箭股份	187,200	1,256,112.00	0.38
104	301191	菲菱科思	17,900	1,252,463.00	0.38
105	002911	佛燃能源	136,724	1,249,657.36	0.38
106	688366	昊海生科	20,260	1,249,636.80	0.38
107	002151	北斗星通	51,400	1,242,852.00	0.37
108	002053	云南能投	100,900	1,219,881.00	0.37
109	301301	川宁生物	94,800	1,211,544.00	0.37
110	300487	蓝晓科技	28,900	1,206,864.00	0.36
111	603558	健盛集团	120,400	1,197,980.00	0.36
112	002917	金奥博	134,600	1,195,248.00	0.36
113	300001	特锐德	59,400	1,195,128.00	0.36
114	600572	康恩贝	266,400	1,190,808.00	0.36
115	603300	华铁应急	217,100	1,185,366.00	0.36
116	605286	同力日升	48,200	1,172,706.00	0.35
117	300857	协创数据	20,400	1,162,800.00	0.35
118	688658	悦康药业	65,100	1,161,384.00	0.35
119	002182	宝武镁业	102,780	1,159,358.40	0.35
120	688480	赛恩斯	41,220	1,148,389.20	0.35
121	600059	古越龙山	144,000	1,143,360.00	0.34
122	002154	报喜鸟	210,100	1,142,944.00	0.34
123	300740	水羊股份	75,900	1,114,212.00	0.34
124	601137	博威合金	72,900	1,110,996.00	0.33
125	000532	华金资本	91,800	1,107,108.00	0.33
126	688443	智翔金泰	36,900	1,097,406.00	0.33
127	603166	福达股份	222,000	1,087,800.00	0.33
128	603130	云中马	61,500	1,084,860.00	0.33
129	600097	开创国际	131,800	1,084,714.00	0.33
130	000887	中鼎股份	88,300	1,080,792.00	0.33
131	688266	泽璟制药	19,900	1,078,978.00	0.33
132	000788	北大医药	215,300	1,074,347.00	0.32

133	688029	南微医学	17,400	1,071,144.00	0.32
134	002043	兔宝宝	102,700	1,064,999.00	0.32
135	002448	中原内配	184,100	1,056,734.00	0.32
136	002928	华夏航空	166,300	1,054,342.00	0.32
137	002752	昇兴股份	207,500	1,049,950.00	0.32
138	601965	中国汽研	61,800	1,043,802.00	0.31
139	301498	乖宝宠物	19,200	1,032,960.00	0.31
140	605003	众望布艺	64,000	1,027,200.00	0.31
141	600298	安琪酵母	36,700	1,025,031.00	0.31
142	300685	艾德生物	58,100	1,024,884.00	0.31
143	603681	永冠新材	79,700	1,016,175.00	0.31
144	000612	焦作万方	155,000	1,007,500.00	0.30
145	603903	中持股份	143,600	1,006,636.00	0.30
146	000032	深桑达 A	67,000	1,003,660.00	0.30
147	605007	五洲特纸	78,600	992,718.00	0.30
148	688253	英诺特	25,700	979,427.00	0.30
149	600755	厦门国贸	136,100	975,837.00	0.29
150	601702	华峰铝业	53,000	967,780.00	0.29
151	001207	联科科技	66,200	961,224.00	0.29
152	688668	鼎通科技	24,140	948,460.60	0.29
153	002753	永东股份	162,900	946,449.00	0.29
154	603995	甬金股份	53,900	944,328.00	0.28
155	832982	锦波生物	6,286	939,065.54	0.28
156	688143	长盈通	43,800	938,196.00	0.28
157	600801	华新水泥	67,900	933,625.00	0.28
158	300893	松原股份	32,600	931,382.00	0.28
159	605319	无锡振华	52,200	923,940.00	0.28
160	300100	双林股份	85,000	915,450.00	0.28
161	605162	新中港	124,300	898,689.00	0.27
162	603589	口子窖	22,800	893,532.00	0.27
163	002244	滨江集团	121,800	884,268.00	0.27
164	002831	裕同科技	34,400	880,296.00	0.27
165	000893	亚钾国际	53,500	864,560.00	0.26
166	688581	安杰思	17,490	855,785.70	0.26
167	688533	上声电子	32,824	849,156.88	0.26
168	603737	三棵树	23,400	848,718.00	0.26
169	300693	盛弘股份	40,200	841,788.00	0.25
170	603012	创力集团	181,800	810,828.00	0.24
171	002318	久立特材	34,600	807,218.00	0.24
172	301168	通灵股份	28,700	797,286.00	0.24
173	603050	科林电气	32,420	786,509.20	0.24
174	301456	盘古智能	29,700	774,873.00	0.23
175	688772	珠海冠宇	47,300	704,770.00	0.21

176	002823	凯中精密	57,400	700,280.00	0.21
177	002847	盐津铺子	16,100	688,597.00	0.21
178	688071	华依科技	31,335	679,029.45	0.20
179	688518	联赢激光	38,400	641,280.00	0.19
180	605056	咸亨国际	58,700	632,786.00	0.19
181	300996	普联软件	41,600	610,272.00	0.18
182	688312	燕麦科技	25,100	608,675.00	0.18
183	300263	隆华科技	105,500	590,800.00	0.18
184	002150	通润装备	47,600	582,148.00	0.18
185	301070	开勒股份	13,800	581,118.00	0.18
186	603516	淳中科技	18,100	571,417.00	0.17
187	300818	耐普矿机	21,800	555,900.00	0.17
188	300552	万集科技	14,200	530,796.00	0.16
189	002869	金溢科技	16,400	528,244.00	0.16
190	688378	奥来德	21,600	506,736.00	0.15
191	300977	深圳瑞捷	22,800	497,268.00	0.15
192	688059	华锐精密	10,700	485,566.00	0.15
193	301162	国能日新	11,100	483,516.00	0.15
194	301285	鸿日达	18,400	480,056.00	0.14
195	688103	国力股份	13,585	472,214.60	0.14
196	300430	诚益通	30,600	461,448.00	0.14
197	688035	德邦科技	14,200	457,524.00	0.14
198	300542	新晨科技	37,100	455,959.00	0.14
199	688268	华特气体	8,800	454,168.00	0.14
200	688651	盛邦安全	15,500	453,375.00	0.14
201	300275	梅安森	45,100	449,647.00	0.14
202	688590	新致软件	34,600	446,340.00	0.13
203	301195	北路智控	15,000	446,100.00	0.13
204	688488	艾迪药业	43,354	443,077.88	0.13
205	688577	浙海德曼	10,600	423,152.00	0.13
206	603667	五洲新春	25,300	414,920.00	0.13
207	688308	欧科亿	21,000	407,820.00	0.12
208	301033	迈普医学	10,400	406,744.00	0.12
209	002338	奥普光电	12,100	399,542.00	0.12
210	603337	杰克股份	14,400	379,008.00	0.11
211	002225	濮耐股份	91,700	375,053.00	0.11
212	300687	赛意信息	26,800	373,056.00	0.11
213	603950	长源东谷	26,300	354,524.00	0.11
214	603067	振华股份	30,100	350,966.00	0.11
215	300680	隆盛科技	18,000	343,260.00	0.10
216	300915	海融科技	13,100	342,434.00	0.10
217	300795	米奥会展	19,200	336,576.00	0.10
218	002956	西麦食品	24,400	335,256.00	0.10

219	688376	美埃科技	10,600	332,416.00	0.10
220	300887	谱尼测试	44,600	330,040.00	0.10
221	603018	华设集团	36,100	328,149.00	0.10
222	603158	腾龙股份	46,500	327,360.00	0.10
223	688157	松井股份	9,500	326,800.00	0.10
224	301188	力诺特玻	22,400	326,368.00	0.10
225	603199	九华旅游	10,900	324,820.00	0.10
226	301529	福赛科技	9,900	324,819.00	0.10
227	688323	瑞华泰	31,600	318,212.00	0.10
228	605128	上海沿浦	11,400	317,946.00	0.10
229	000949	新乡化纤	84,200	286,280.00	0.09
230	301589	诺瓦星云	1,029	193,462.29	0.06
231	300253	卫宁健康	13,900	82,010.00	0.02
232	002674	兴业科技	7,700	78,694.00	0.02
233	688472	XD阿特斯	6,367	64,816.06	0.02
234	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
235	688692	达梦数据	133	23,265.69	0.01
236	600729	重庆百货	900	20,124.00	0.01
237	688709	成都华微	850	15,971.50	0.00
238	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
239	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
240	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
241	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
242	301277	新天地	984	12,772.32	0.00
243	688584	上海合晶	674	10,709.86	0.00
244	601033	永兴股份	670	10,693.20	0.00
245	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
246	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
247	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
248	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
249	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
250	603341	龙旗科技	205	7,685.45	0.00
251	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
252	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
253	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
254	301391	卡莱特	131	5,735.18	0.00
255	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
256	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
257	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
258	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
259	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
260	603381	永臻股份	154	3,870.02	0.00
261	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00

262	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
263	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
264	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
265	301486	致尚科技	67	2,834.77	0.00
266	300839	博汇股份	500	2,815.00	0.00
267	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
268	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
269	301258	富士莱	91	2,262.26	0.00
270	688520	神州细胞	50	1,967.50	0.00
271	600345	长江通信	74	1,325.34	0.00
272	603071	物产环能	1	12.53	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	300783	三只松鼠	13,527,717.00	2.46
2	301313	凡拓数创	12,855,640.00	2.34
3	002643	万润股份	10,109,753.47	1.84
4	000423	东阿阿胶	9,320,846.00	1.69
5	002402	和而泰	8,960,218.00	1.63
6	002859	洁美科技	8,716,538.00	1.58
7	603667	五洲新春	8,675,885.40	1.58
8	603871	嘉友国际	8,031,581.40	1.46
9	300926	博俊科技	7,583,652.00	1.38
10	002922	伊戈尔	7,521,706.00	1.37
11	002955	鸿合科技	7,453,548.00	1.36
12	600373	中文传媒	7,091,117.00	1.29
13	603383	顶点软件	6,983,284.00	1.27
14	603255	鼎际得	6,925,420.00	1.26
15	605098	行动教育	6,768,636.00	1.23
16	603611	诺力股份	6,656,630.00	1.21
17	600872	中炬高新	6,599,534.00	1.20
18	002851	麦格米特	6,596,832.00	1.20
19	603992	松霖科技	6,527,729.00	1.19
20	601208	东材科技	6,431,736.00	1.17

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	300783	三只松鼠	18,751,730.32	3.41



2	301313	凡拓数创	12,201,029.00	2.22
3	002851	麦格米特	11,385,556.50	2.07
4	000423	东阿阿胶	9,533,251.00	1.73
5	603667	五洲新春	8,728,999.00	1.59
6	603871	嘉友国际	8,559,299.60	1.56
7	300203	聚光科技	8,106,742.00	1.47
8	688108	赛诺医疗	7,622,270.05	1.39
9	601208	东材科技	7,385,422.27	1.34
10	002922	伊戈尔	7,044,862.00	1.28
11	688035	德邦科技	6,996,153.18	1.27
12	002955	鸿合科技	6,776,379.00	1.23
13	300181	佐力药业	6,676,130.00	1.21
14	300926	博俊科技	6,407,646.77	1.17
15	603255	鼎际得	6,174,344.00	1.12
16	600872	中炬高新	6,152,216.00	1.12
17	300145	中金环境	6,136,959.00	1.12
18	603439	贵州三力	6,019,199.00	1.09
19	600551	时代出版	5,940,647.00	1.08
20	301345	涛涛车业	5,820,793.06	1.06

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	1,703,554,746.83
卖出股票收入（成交）总额	1,818,632,404.11

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	8,137,797.27	2.45
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,137,797.27	2.45

## 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	019727	23 国债 24	50,000	5,090,952.06	1.53
2	019709	23 国债 16	30,000	3,046,845.21	0.92

## 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京怡和嘉业医疗科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家税务总局北京市税务局第三稽查局的处罚。

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	246,772.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	196,732.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	443,505.76

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧小盘成长混合 A	4,941	48,346.64	2,571,632.19	1.08%	236,309,124.23	98.92%
中欧小盘成长混合 C	3,259	50,115.82	16,103,896.66	9.86%	147,223,545.76	90.14%
合计	8,200	49,049.78	18,675,528.85	4.64%	383,532,669.99	95.36%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管	中欧小盘成长混合 A	110,912.31	0.05%

理人所有从业人员持有本基金	中欧小盘成长混合 C	1,001,565.90	0.61%
	合计	1,112,478.21	0.28%

### 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	中欧小盘成长混合 A	0
	中欧小盘成长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧小盘成长混合 A	10~50
	中欧小盘成长混合 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
基金合同生效日 (2022 年 6 月 28 日) 基金份额总额	375,681,461.40	270,409,379.14
本报告期期初基金份额总额	313,233,796.40	250,479,382.51
本报告期基金总申购份额	28,264,714.04	47,117,141.61
减：本报告期基金总赎回份额	102,617,754.02	134,269,081.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	238,880,756.42	163,327,442.42

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

报告期内本基金未召开持有人大会。

## 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，基金管理人无重大人事变动。

### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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重大改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
广发证券	3	1,722,461,714.56	48.93	893,653.45	48.81	-
光大证券	3	1,222,429,920.48	34.72	641,510.56	35.04	-
申万宏源证券	3	575,544,724.36	16.35	295,642.90	16.15	-

注：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。

### 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	
	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(%)
广发证券	5,074,167.12	100.00	165,801,000.00	100.00	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

注：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。

### 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	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧小盘成长混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧小盘成长混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧小盘成长混合型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	中欧小盘成长混合型证券投资基金更新招募说明书（2024年6月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
8	中欧小盘成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2024-06-25

## § 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、中欧小盘成长混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧小盘成长混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧小盘成长混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧小盘成长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

基金管理人的办公场所。

### 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

2024 年 8 月 31 日