

中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	47

8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 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	60
8.7 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	60
8.8 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	60
8.9 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	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 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	62
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中欧产业优选混合发起	
基金主代码	020474	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 27 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,663,035.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C
下属分级基金的交易代码	020474	020475
报告期末下属分级基金的份额总额	28,372,019.08 份	291,016.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年 12 月 27 日-2023 年 12 月 31 日	
	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C
本期已实现收益	-377,127.48	91,605.36	-1,959.18	-39.28
本期利润	-59,513.01	-61,069.58	-1,959.18	-39.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0024	-0.1447	-0.0002	-0.0003
本期加权平均净值利润率	-0.23%	-13.44%	-0.02%	-0.03%
本期基金份额净值增长率	6.37%	5.78%	-0.02%	-0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C
期末可供分配利润	1,800,475.47	16,744.56	-1,959.18	-39.28
期末可供分配基金份额利润	0.0635	0.0575	-0.0002	-0.0003
期末基金资产净值	30,172,494.55	307,760.64	9,998,040.82	149,960.72
期末基金份额净值	1.0635	1.0575	0.9998	0.9997

值				
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	6.35%	5.75%	-0.02%	-0.03%

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

中欧产业优选混合发起 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
过去三个月	-6.46%	1.55%	-1.05%	1.32%	-5.41%	0.23%
过去六个月	-1.89%	1.53%	11.41%	1.30%	-13.30%	0.23%
过去一年	6.37%	1.28%	10.92%	1.08%	-4.55%	0.20%
自基金合同生效起至今	6.35%	1.27%	13.81%	1.08%	-7.46%	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*70%+银行活期存款利率(税后)*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%。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。

中欧产业优选混合发起 C

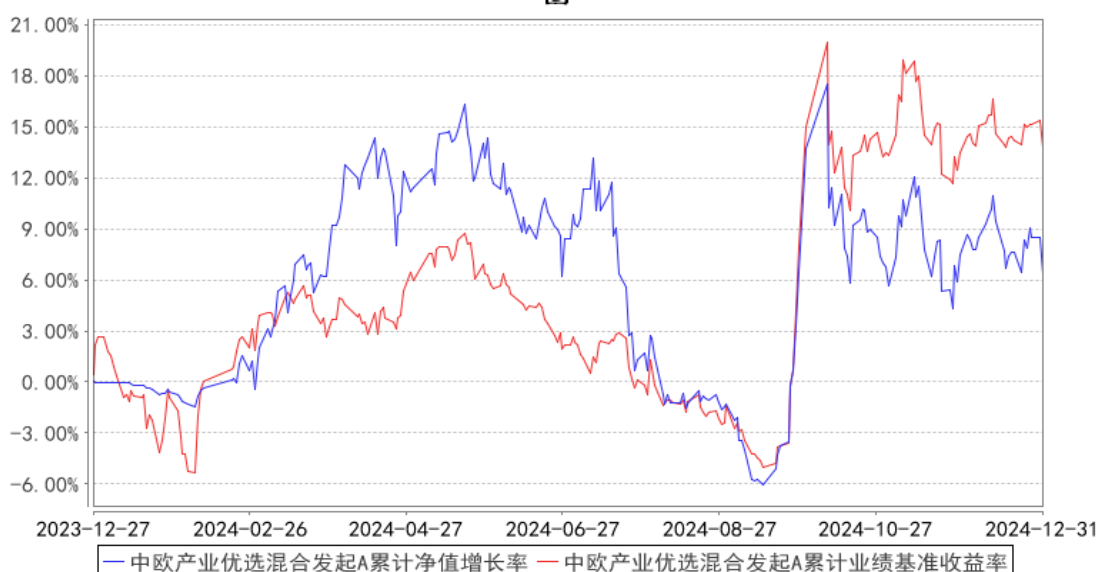
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-6.69%	1.54%	-1.05%	1.32%	-5.64%	0.22%
过去六个月	-2.29%	1.53%	11.41%	1.30%	-13.70%	0.23%
过去一年	5.78%	1.28%	10.92%	1.08%	-5.14%	0.20%

自基金合同生效 起至今	5.75%	1.27%	13.81%	1.08%	-8.06%	0.19%
----------------	-------	-------	--------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*70%+银行活期存款利率(税后)*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%。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。

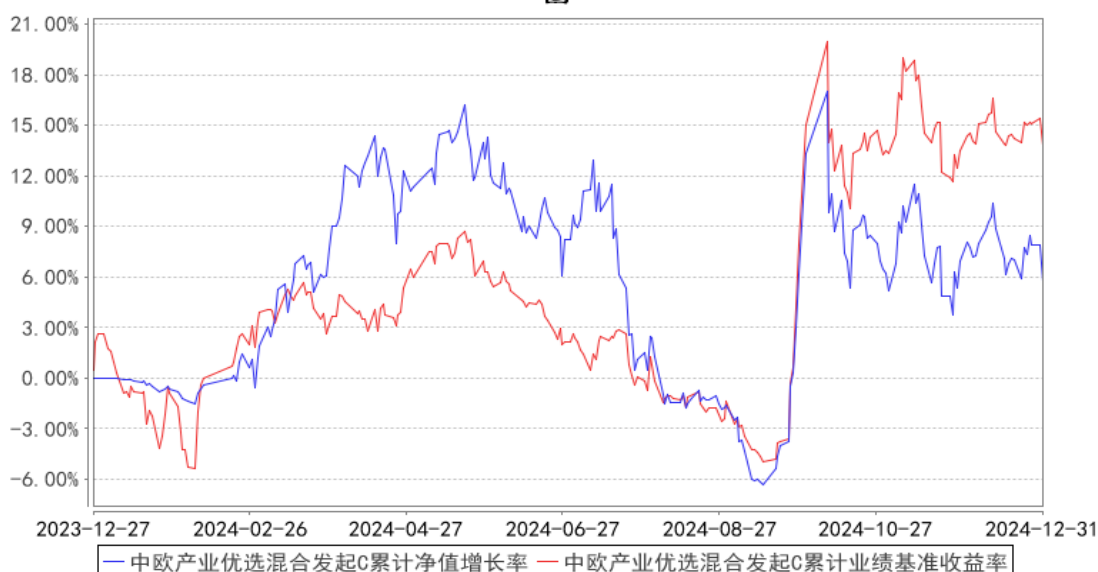
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧产业优选混合发起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



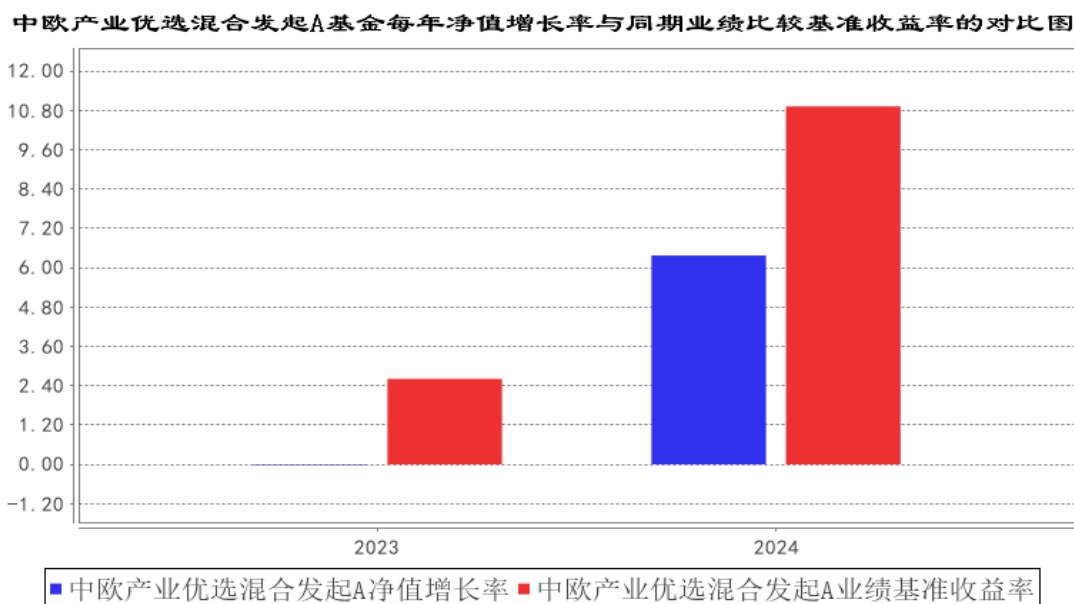
注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 12 月 27 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧产业优选混合发起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

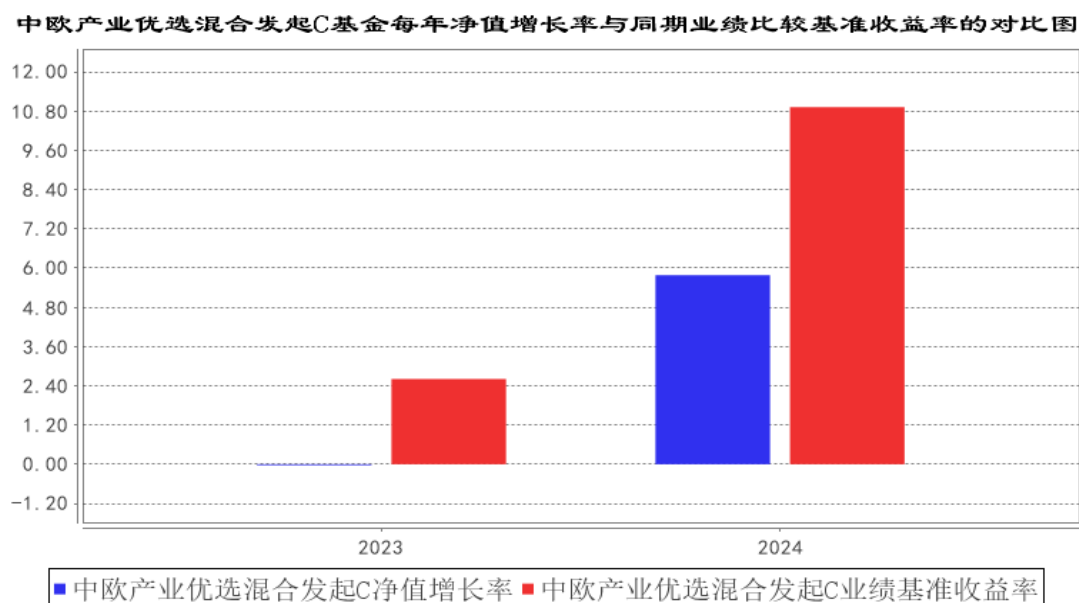


注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 12 月 27 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 27 日，2023 年度数据为 2023 年 12 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日数据。



注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 27 日，2023 年度数据为 2023 年 12 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 194 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		
叶培培	基金经理	2023-12-27	—	17 年	历任联合利华（上海）财务管理培训生，上海申万宏源证券研究所首席分析师、部门总监，太平洋资产管理有限责任公司投资经理。2021-12-16 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。

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《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否可能存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

4.3.3 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 31 次，其中 30 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，1 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，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

国内方面，财政和货币双宽的基调延续。财政投向上要求“更注重惠民生、促消费、增后劲”，

我们认为 2025 年财政投向最主要抓手将从基建投资以工代赈的间接模式转为向居民部门各种形式的转移支付的更直接模式。2024 年 12 月 9 日举行的中央政治局会议，货币政策基调从“稳健”调整为“适度宽松”，央行年度工作会议等场合也提出保持流动性“充裕”。我们认为 2025 年初流动性环境将持续宽松，这利好广谱的风险资产价格。海外方面，2024 年 12 月美联储继续降息但在预期指引上明显转鹰，叠加 2025 年 1 月美国国会完成换届、特朗普正式就职开始加关税，市场普遍担心美国通胀问题显性化并促使联储收紧全球流动性总闸门，但我们认为这将是 2025 年的海外主要预期差。

我们在前几次季度报告中提到，随着国内货币和财政持续发力，宏观环境向复苏迈进，市场风格有望从完全红利占优变为质量和成长有更多机会。由于实体经济价格粘性高于资本市场，政策落地效果可能还需要 1-2 个季度的观察窗口，未来市场将处于政策预期和现实经济的拉扯期，市场波动或加大。近期特朗普就职后的关税政策强度好于预期，反而使得出台超常规政策的窗口延后，顺周期表现逊色。而与此同时，中美 AI 浪潮共振，春季期间 deepseek 对算法创新带来的成本快速下行，AI 应用快速扩散，中资科技股迎来全面重估。本组合保持高仓位运行，超配科技和先进制造，低配医药消费金融，维持周期配置。

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 6.37%，同期业绩比较基准收益率为 10.92%；基金 C 类份额净值增长率为 5.78%，同期业绩比较基准收益率为 10.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，市场主线清晰，我们重点围绕 AI+端侧、AI+智驾、AI+机器人挖掘核心低位个股，掌握数据流量入口的终端和平台公司的核心价值更高。中美共振的科技浪潮迎来拐点，随着 AI 技术的迭代和算法成本的急速下降，AI 应用的豹变逐步开启，未来投资重点将从算力延伸至 AI 终端和应用。当然，AI 产业化并非一蹴而就，风险在于短期股价预期太高带来的阶段性泡沫。我们将择机配置低估值困境反转的内需板块，优选经营杠杆较大或者供给出清彻底的弹性板块，以及有新产品、新渠道、新市场助力的公司。

风险重点关注特朗普政府去监管政策导致美国经济过热并促使美联储前瞻性紧缩，可能的关税政策对制造业的冲击，预期反应充分后制造出海公司或将迎来布局良机。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2024 年，监管机构颁布了多部法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2024 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制定或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2024 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2024 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化洗钱风险和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、风险评估、培训宣传等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门加强自身反洗钱工作履职能力，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，优化了反洗钱系统的各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

4.7 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历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00676 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中欧产业优选混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度和 2023 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度和 2023 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧产业优选混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	中欧基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中欧产业优选混合型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中欧产业优

	选混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中欧产业优选混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中欧产业优选混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧产业优选混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧产业优选混合型发起式证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	谭麟林	乐美昊
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧产业优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	2,004,477.26	10,150,087.40
结算备付金		553,619.28	-
存出保证金		34,724.47	-
交易性金融资产	7.4.7.2	27,077,850.62	-
其中：股票投资		26,672,797.03	-
基金投资		-	-
债券投资		405,053.59	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		1,448,131.62	-
应收股利		9,984.00	-
应收申购款		119.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		31,128,907.24	10,150,087.40
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		535,835.18	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		31,577.92	1,334.68
应付托管费		5,262.99	222.45
应付销售服务费		163.28	9.88
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	7.4.7.6	75,812.68	518.85
负债合计		648,652.05	2,085.86
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	28,663,035.16	10,150,000.00
未分配利润	7.4.7.8	1,817,220.03	-1,998.46
净资产合计		30,480,255.19	10,148,001.54
负债和净资产总计		31,128,907.24	10,150,087.40

注： 1. 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 28,663,035.16 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0635 元，基金份额总额 28,372,019.08 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0575 元，基金份额总额 291,016.08 份。

2. 本基金基金合同于 2023 年 12 月 27 日生效，上年度可比期间自 2023 年 12 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日，下同。

7.2 利润表

会计主体：中欧产业优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		275,991.89	493.40
1. 利息收入		23,501.05	493.40
其中：存款利息收入	7.4.7.9	21,882.09	493.40
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		1,618.96	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,319.93	—
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-740,017.32	—
基金投资收益		—	—

债券投资收益	7.4.7.11	2,568.08	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	794,769.17	-
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）	7.4.7.15	164,939.53	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	30,231.38	-
减：二、营业总支出		396,574.48	2,491.86
1. 管理人报酬		318,472.34	1,334.68
2. 托管费		53,078.65	222.45
3. 销售服务费		2,708.05	9.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	22,315.44	924.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-120,582.59	-1,998.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-120,582.59	-1,998.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-120,582.59	-1,998.46

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧产业优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	10,150,000.00	-	-1,998.46	10,148,001.54

资产				
二、本期期初净资产	10,150,000.00	-	-1,998.46	10,148,001.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,513,035.16	-	1,819,218.49	20,332,253.65
(一)、综合收益总额	-	-	-120,582.59	-120,582.59
(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)	18,513,035.16	-	1,939,801.08	20,452,836.24
其中：1. 基金申购款	30,225,975.59	-	3,210,131.36	33,436,106.95
2. 基金赎回款	-11,712,940.43	-	-1,270,330.28	-12,983,270.71
(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	28,663,035.16	-	1,817,220.03	30,480,255.19
项目	上年度可比期间			
	2023 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,150,000.00	-	-	10,150,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-1,998.46	-1,998.46
(一)、综合收益总额	-	-	-1,998.46	-1,998.46
(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)	-	-	-	-
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	10,150,000.00	-	-1,998.46	10,148,001.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧产业优选混合型发起式证券投资基金(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[2023]2859 号《关于准予中欧产业优选混合型发起式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《中欧产业优选混合型发起式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发起式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《中欧产业优选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,150,000.00 份基金份额，无认购资金利息基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中欧产业优选混合型发起式证券投资基金基金合同》和《中欧产业优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，各类别基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用

发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2025 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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》(财会[2022]14 号)和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日及 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度及 2023 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金上年度可比期间为 2023 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所

产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人

估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 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，且目前可执行该种法定权利，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。

7.4.4.7 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。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易

费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费按照权责发生制原则在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额选择不同的分红方式。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；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 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，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《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》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、

市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,

以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)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，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,004,477.26	10,150,087.40
等于：本金	2,004,228.45	10,149,594.00
加：应计利息	248.81	493.40
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	2,004,477.26	10,150,087.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		26,506,325.50	-	26,672,797.03	166,471.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	402,212.00	4,373.59	405,053.59	-1,532.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	402,212.00	4,373.59	405,053.59	-1,532.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,908,537.50	4,373.59	27,077,850.62	164,939.53
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	65,812.68	-
其中：交易所市场	65,812.68	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	10,000.00	518.85
合计	75,812.68	518.85

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧产业优选混合发起 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,000,000.00	10,000,000.00
本期申购	27,892,105.90	27,892,105.90
本期赎回（以“-”号填列）	-9,520,086.82	-9,520,086.82
本期末	28,372,019.08	28,372,019.08

中欧产业优选混合发起 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,000.00	150,000.00
本期申购	2,333,869.69	2,333,869.69
本期赎回（以“-”号填列）	-2,192,853.61	-2,192,853.61
本期末	291,016.08	291,016.08

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同于 2023 年 12 月 27 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,150,000.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧产业优选混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,959.18	-	-1,959.18
本期期初	-1,959.18	-	-1,959.18
本期利润	-377,127.48	317,614.47	-59,513.01
本期基金份额交易产生的变动数	2,596,970.44	-735,022.78	1,861,947.66
其中：基金申购款	2,869,569.92	61,726.77	2,931,296.69
基金赎回款	-272,599.48	-796,749.55	-1,069,349.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,217,883.78	-417,408.31	1,800,475.47

中欧产业优选混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-39.28	-	-39.28
本期期初	-39.28	-	-39.28
本期利润	91,605.36	-152,674.94	-61,069.58
本期基金份额交易产生的变动数	-70,690.02	148,543.44	77,853.42
其中：基金申购款	91,521.56	187,313.11	278,834.67
基金赎回款	-162,211.58	-38,769.67	-200,981.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,876.06	-4,131.50	16,744.56

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,099.47	493.40
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	5,448.15	-
其他	334.47	-
合计	21,882.09	493.40

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	200,784,246.26	-
减：卖出股票成本总额	201,065,304.51	-
减：交易费用	458,959.07	-
买卖股票差价收入	-740,017.32	-

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年12月27日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,778.08	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-210.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,568.08	-

7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2023年12月27日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,375.01	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,762.00	-
减：应计利息总额	2,823.01	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-210.00	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生 效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	794,769.17	-
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	794,769.17	-

7.4.7.15 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	164,939.53	-
股票投资	166,471.53	-
债券投资	-1,532.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	164,939.53	-

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	30,231.38	-
合计	30,231.38	-

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	9,481.15	518.85
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	497.00	6.00
账户维护费	12,000.00	-
开户费	-	400.00
证券组合费	337.29	-
合计	22,315.44	924.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
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

中欧盛世资产管理(上海)有限公司(“中欧盛世资管”)	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司(“中欧基金国际”)	基金管理人的全资子公司
中欧私募基金管理(上海)有限公司(“中欧私募”)	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2024 年 4 月 9 日起，我司正式受让中欧私募基金管理(上海)有限公司全部股权，新增关联方为中欧私募基金管理(上海)有限公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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（%）
国都证券	29,224,893.29	6.82	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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（%）
国都证券	7,507,000.00	37.09	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	16,968.25	7.56	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年12月27日（基金合同生效日）至2023年12月31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	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年12月27日（基金合 同生效日）至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	318,472.34	1,334.68
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,740.05	-
应支付基金管理人的净管理费	315,732.29	1,334.68

注：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。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年12月27日（基金合 同生效日）至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	53,078.65	222.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%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取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C	合计
中欧财富	0.00	49.07	49.07
中欧基金	0.00	951.56	951.56
合计	0.00	1,000.63	1,000.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C	合计
中欧财富	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	9.88	9.88
合计	0.00	9.88	9.88

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规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧产业优选混合发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日 （2023 年 12 月 27 日） 持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基 金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入 总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变 动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基 金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基 金份额 占基金总份额比例	35.25%	100.00%

中欧产业优选混合发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日 （2023 年 12 月 27 日） 持有的基金份额	-	150,000.00

报告期初持有的基金份额	150,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	150,000.00	150,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.54%	100.00%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金各类基金份额。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,004,477.26	16,099.47	10,150,087.40	493.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 7.4.12 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 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	2,004,477.26	-	-	-	2,004,477.26
结算备付金	553,619.28	-	-	-	553,619.28
存出保证金	34,724.47	-	-	-	34,724.47
交易性金融资产	405,053.59	-	-	26,672,797.03	27,077,850.62
应收股利	-	-	-	9,984.00	9,984.00
应收申购款	-	-	-	119.99	119.99
应收清算款	-	-	-	1,448,131.62	1,448,131.62
资产总计	2,997,874.60	-	-	28,131,032.64	31,128,907.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,577.92	31,577.92
应付托管费	-	-	-	5,262.99	5,262.99
应付清算款	-	-	-	535,835.18	535,835.18
应付销售服务费	-	-	-	163.28	163.28
其他负债	-	-	-	75,812.68	75,812.68
负债总计	-	-	-	648,652.05	648,652.05
利率敏感度缺口	2,997,874.60	-	-	27,482,380.59	30,480,255.19
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	10,150,087.40	-	-	-	10,150,087.40
资产总计	10,150,087.40	-	-	-	10,150,087.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,334.68	1,334.68
应付托管费	-	-	-	222.45	222.45
应付销售服务费	-	-	-	9.88	9.88
其他负债	-	-	-	518.85	518.85
负债总计	-	-	-	2,085.86	2,085.86
利率敏感度缺口	10,150,087.40	-	-	-2,085.86	10,148,001.54

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 1.33%（2023 年 12 月 31 日：0.00%），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	2,672,806.09	-	2,672,806.09
应收股利	-	9,984.00	-	9,984.00
资产合计	-	2,682,790.09	-	2,682,790.09
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	2,682,790.09	-	2,682,790.09
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 5%	-134,139.50	-
	港币相对人民币升值 5%	134,139.50	-

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	26,672,797.03	87.51	—	—
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	26,672,797.03	87.51	—	—

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,606,431.75	—
	业绩比较基准下降 5%	-1,606,431.75	—

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	26,672,797.03	—
第二层次	405,053.59	—
第三层次	—	—
合计	27,077,850.62	—

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.2.1 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末均不存在使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值余额。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	26,672,797.03	85.68
	其中：股票	26,672,797.03	85.68
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	405,053.59	1.30

	其中：债券	405,053.59	1.30
	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	2,558,096.54	8.22
8	其他各项资产	1,492,960.08	4.80
9	合计	31,128,907.24	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,672,806.09 元，占基金资产净值比例 8.77%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	1,699,184.00	5.57
C	制造业	12,730,186.15	41.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	646,803.00	2.12
E	建筑业	1,044,519.00	3.43
F	批发和零售业	1,461,874.00	4.80
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	1,332,843.79	4.37
J	金融业	4,330,942.00	14.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	310,340.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	60,544.00	0.20
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	382,755.00	1.26
S	综合	-	-
	合计	23,999,990.94	78.74

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

基础材料	-	-
消费者非必需品	573,890.14	1.88
消费者常用品	333,003.98	1.09
能源	-	-
金融	113,532.50	0.37
医疗保健	110,754.38	0.36
工业	-	-
信息技术	1,397,227.67	4.58
电信服务	144,397.42	0.47
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	2,672,806.09	8.77

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 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	601899	紫金矿业	112,000	1,693,440.00	5.56
2	300750	宁德时代	4,600	1,223,600.00	4.01
3	601601	中国太保	34,300	1,168,944.00	3.84
4	000333	美的集团	13,900	1,045,558.00	3.43
5	00285	比亚迪电子	24,000	934,559.57	3.07
6	000063	中兴通讯	19,100	771,640.00	2.53
7	603986	兆易创新	6,800	726,240.00	2.38
8	600522	中天科技	50,300	720,296.00	2.36
9	002517	恺英网络	49,300	670,973.00	2.20
10	002568	百润股份	23,400	655,434.00	2.15
11	002475	立讯精密	15,900	648,084.00	2.13
12	000028	国药一致	21,600	631,800.00	2.07
13	600104	上汽集团	30,300	629,028.00	2.06
14	600036	招商银行	15,800	620,940.00	2.04
15	601390	中国中铁	92,100	588,519.00	1.93
16	002050	三花智控	24,500	575,995.00	1.89
17	688608	恒玄科技	1,689	549,549.93	1.80
18	300394	天孚通信	5,700	520,752.00	1.71
19	601668	中国建筑	76,000	456,000.00	1.50
20	601127	赛力斯	3,000	400,170.00	1.31
21	601077	渝农商行	63,600	384,780.00	1.26
22	601098	中南传媒	25,500	382,755.00	1.26
23	300783	三只松鼠	10,100	372,387.00	1.22
24	09868	小鹏汽车-W	8,500	367,198.01	1.20
25	002911	佛燃能源	27,900	352,656.00	1.16
26	300033	同花顺	1,200	345,000.00	1.13

27	600919	江苏银行	34,600	339,772.00	1.11
28	01797	东方甄选	20,000	333,003.98	1.09
29	601319	中国人保	42,100	320,802.00	1.05
30	002594	比亚迪	1,100	310,926.00	1.02
31	600153	建发股份	29,500	310,340.00	1.02
32	601825	沪农商行	36,200	308,062.00	1.01
33	002948	青岛银行	78,600	304,968.00	1.00
34	601128	常熟银行	40,200	304,314.00	1.00
35	600163	中闽能源	48,300	294,147.00	0.97
36	002241	歌尔股份	11,300	291,653.00	0.96
37	603833	欧派家居	4,200	289,548.00	0.95
38	600276	恒瑞医药	6,300	289,170.00	0.95
39	002294	信立泰	9,200	284,556.00	0.93
40	002154	报喜鸟	62,800	276,948.00	0.91
41	600694	大商股份	10,200	268,974.00	0.88
42	06869	长飞光纤光缆	21,000	237,640.38	0.78
43	600030	中信证券	8,000	233,360.00	0.77
44	603920	世运电路	7,900	232,260.00	0.76
45	00489	东风集团股份	60,000	206,692.13	0.68
46	002028	思源电气	2,800	203,560.00	0.67
47	600729	重庆百货	6,300	184,275.00	0.60
48	300170	汉得信息	13,500	167,400.00	0.55
49	01810	小米集团-W	5,200	166,131.58	0.55
50	300274	阳光电源	2,200	162,426.00	0.53
51	300408	三环集团	4,200	161,742.00	0.53
52	301383	天键股份	2,900	152,685.00	0.50
53	603518	锦泓集团	15,200	148,960.00	0.49
54	300017	网宿科技	14,000	147,980.00	0.49
55	002292	奥飞娱乐	17,000	147,050.00	0.48
56	688220	翱捷科技	2,677	144,798.93	0.48
57	02400	心动公司	6,200	144,397.42	0.47
58	600031	三一重工	8,700	143,376.00	0.47
59	600732	爱旭股份	12,800	141,056.00	0.46
60	688111	金山办公	481	137,753.59	0.45
61	300863	卡倍亿	2,800	125,160.00	0.41
62	002460	赣锋锂业	3,500	122,535.00	0.40
63	02328	中国财险	10,000	113,532.50	0.37
64	02228	晶泰控股-P	20,000	110,754.38	0.36
65	603893	瑞芯微	1,000	110,060.00	0.36
66	002230	科大讯飞	1,700	82,144.00	0.27
67	688503	聚和材料	1,543	68,339.47	0.22
68	688068	热景生物	1,055	65,241.20	0.21
69	603009	北特科技	1,600	62,528.00	0.21

70	603259	药明康德	1,100	60,544.00	0.20
71	00981	中芯国际	2,000	58,896.14	0.19
72	300100	双林股份	1,900	52,516.00	0.17
73	688332	中科蓝讯	391	51,025.50	0.17
74	688099	晶晨股份	740	50,823.20	0.17
75	300308	中际旭创	400	49,404.00	0.16
76	300496	中科创达	700	41,692.00	0.14
77	002371	北方华创	100	39,100.00	0.13
78	600079	人福医药	1,200	28,056.00	0.09
79	002045	国光电器	1,000	21,690.00	0.07
80	002738	中矿资源	600	21,300.00	0.07
81	002779	中坚科技	300	20,400.00	0.07
82	688800	瑞可达	392	19,643.12	0.06
83	002402	和而泰	1,000	18,110.00	0.06
84	301556	托普云农	200	17,284.00	0.06
85	600570	恒生电子	600	16,794.00	0.06
86	000625	长安汽车	600	8,016.00	0.03
87	601918	新集能源	800	5,744.00	0.02
88	601933	永辉超市	700	4,438.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	01378	中国宏桥	13,344,278.77	131.50
2	603993	洛阳钼业	10,034,381.00	98.88
2	03993	洛阳钼业	1,953,417.65	19.25
3	00883	中国海洋石油	8,521,173.82	83.97
3	600938	中国海油	207,448.00	2.04
4	601899	紫金矿业	6,467,593.00	63.73
4	02899	紫金矿业	488,221.36	4.81
5	601168	西部矿业	6,238,938.00	61.48
6	600489	中金黄金	4,736,464.00	46.67
7	000333	美的集团	4,256,200.00	41.94
8	601918	新集能源	4,223,766.00	41.62
9	601601	中国太保	3,094,406.00	30.49
9	02601	中国太保	1,119,695.39	11.03
10	300750	宁德时代	4,164,809.60	41.04
11	002475	立讯精密	3,999,015.00	39.41
12	601898	中煤能源	2,259,115.00	22.26
12	01898	中煤能源	1,423,781.28	14.03
13	601077	渝农商行	3,637,343.00	35.84
14	000975	山金国际	3,292,939.00	32.45

15	601702	华峰铝业	3,287,707.00	32.40
16	300033	同花顺	3,016,204.00	29.72
17	601600	中国铝业	2,257,412.00	22.24
17	02600	中国铝业	752,479.96	7.42
18	601958	金钼股份	2,987,772.00	29.44
19	300274	阳光电源	2,723,406.80	26.84
20	01772	赣锋锂业	2,478,400.98	24.42
20	002460	赣锋锂业	237,750.00	2.34
21	01818	招金矿业	2,630,269.97	25.92
22	600988	赤峰黄金	2,620,781.00	25.83
23	002028	思源电气	2,484,646.00	24.48
24	00857	中国石油股份	2,138,140.83	21.07
24	601857	中国石油	251,553.00	2.48
25	600900	长江电力	2,160,078.00	21.29
26	02328	中国财险	2,113,479.07	20.83
27	002517	恺英网络	2,053,607.00	20.24
28	600031	三一重工	1,973,439.00	19.45
29	09988	阿里巴巴-W	1,921,634.67	18.94
30	300308	中际旭创	1,919,417.00	18.91
31	600801	华新水泥	1,245,587.00	12.27
31	06655	华新水泥	490,688.04	4.84
32	02099	中国黄金国际	1,725,123.64	17.00
33	600803	新奥股份	1,686,245.00	16.62
34	000028	国药一致	1,666,432.00	16.42
35	000425	徐工机械	1,651,301.00	16.27
36	601865	福莱特	856,929.00	8.44
36	06865	福莱特玻璃	756,525.89	7.45
37	600023	浙能电力	1,580,525.00	15.57
38	01088	中国神华	1,563,162.11	15.40
39	06682	第四范式	1,555,765.94	15.33
40	002911	佛燃能源	1,530,956.68	15.09
41	002594	比亚迪	1,515,873.00	14.94
42	002463	沪电股份	1,483,921.00	14.62
43	601288	农业银行	876,026.00	8.63
43	01288	农业银行	600,453.40	5.92
44	000858	五粮液	1,456,549.00	14.35
45	603801	志邦家居	1,401,601.00	13.81
46	000983	山西焦煤	1,381,261.00	13.61
47	688608	恒玄科技	1,370,548.09	13.51
48	600519	贵州茅台	1,351,867.00	13.32
49	002466	天齐锂业	1,294,066.00	12.75
50	601881	中国银河	1,154,684.00	11.38
51	603816	顾家家居	1,147,670.00	11.31

52	600036	招商银行	1,098,079.00	10.82
53	002050	三花智控	1,094,220.00	10.78
54	002064	华峰化学	1,090,098.00	10.74
55	002241	歌尔股份	1,081,235.00	10.65
56	600486	扬农化工	1,026,915.84	10.12
57	600732	爱旭股份	974,455.20	9.60
58	09868	小鹏汽车-W	972,118.97	9.58
59	01816	中广核电力	959,603.34	9.46
60	603225	新凤鸣	956,112.00	9.42
61	000063	中兴通讯	935,943.80	9.22
62	601333	广深铁路	928,296.00	9.15
63	600919	江苏银行	926,034.00	9.13
64	300418	昆仑万维	921,324.00	9.08
65	601699	潞安环能	903,925.00	8.91
66	600079	人福医药	898,495.00	8.85
67	00285	比亚迪电子	874,038.95	8.61
68	000568	泸州老窖	850,496.00	8.38
69	01258	中国有色矿业	843,714.60	8.31
70	600958	东方证券	840,000.00	8.28
71	600030	中信证券	819,706.00	8.08
72	601138	工业富联	811,730.93	8.00
73	09987	百胜中国	776,017.75	7.65
74	600522	中天科技	774,144.00	7.63
75	002402	和而泰	768,484.00	7.57
76	002624	完美世界	766,610.50	7.55
77	688503	聚和材料	764,470.24	7.53
78	603986	兆易创新	757,920.00	7.47
79	002568	百润股份	753,962.44	7.43
80	00107	四川成渝高速公路	744,535.01	7.34
81	600183	生益科技	743,748.00	7.33
82	600028	中国石化	715,344.00	7.05
83	601377	兴业证券	669,305.00	6.60
84	601058	赛轮轮胎	659,374.00	6.50
85	600497	驰宏锌锗	652,779.00	6.43
86	03800	协鑫科技	643,323.33	6.34
87	002738	中矿资源	632,066.80	6.23
88	601390	中国中铁	618,867.00	6.10
89	600129	太极集团	618,174.00	6.09
90	600570	恒生电子	615,601.00	6.07
91	300133	华策影视	613,416.00	6.04
92	601098	中南传媒	612,121.00	6.03
93	603185	弘元绿能	608,863.00	6.00
94	601127	赛力斯	603,616.00	5.95

95	300394	天孚通信	601,949.00	5.93
96	300015	爱尔眼科	587,718.00	5.79
97	603920	世运电路	587,243.00	5.79
98	002601	龙佰集团	582,909.00	5.74
99	603599	广信股份	579,976.00	5.72
100	600104	上汽集团	560,259.00	5.52
101	03896	金山云	557,720.64	5.50
102	00220	统一企业中国	552,834.95	5.45
103	01618	中国中冶	533,711.52	5.26
104	000034	神州数码	520,140.00	5.13
105	00371	北控水务集团	518,101.12	5.11
106	600438	通威股份	517,215.00	5.10
107	03668	兖煤澳大利亚	501,661.31	4.94
108	300100	双林股份	496,949.00	4.90
109	603806	福斯特	467,759.00	4.61
110	601336	新华保险	466,787.00	4.60
111	002487	大金重工	465,985.00	4.59
112	688066	航天宏图	465,714.51	4.59
113	002832	比音勒芬	464,935.00	4.58
114	603305	旭升集团	463,421.00	4.57
115	601668	中国建筑	462,863.00	4.56
116	000807	云铝股份	461,400.00	4.55
117	002129	TCL 中环	460,542.00	4.54
118	001301	尚太科技	456,381.00	4.50
119	002293	罗莱生活	451,731.00	4.45
120	00489	东风集团股份	445,214.50	4.39
121	688099	晶晨股份	409,232.84	4.03
122	600176	中国巨石	400,800.00	3.95
123	02057	中通快递-W	394,352.69	3.89
124	002304	洋河股份	383,389.00	3.78
125	002292	奥飞娱乐	374,715.00	3.69
126	600276	恒瑞医药	368,537.00	3.63
127	06862	海底捞	363,046.48	3.58
128	02020	安踏体育	361,857.31	3.57
129	605117	德业股份	358,665.00	3.53
130	000408	藏格矿业	341,195.00	3.36
131	601666	平煤股份	326,456.00	3.22
132	02145	上美股份	319,979.10	3.15
133	600966	博汇纸业	319,382.00	3.15
134	688256	寒武纪	317,533.32	3.13
135	002236	大华股份	315,675.00	3.11
136	688332	中科蓝讯	315,088.30	3.10
137	300170	汉得信息	313,918.00	3.09

138	600585	海螺水泥	218,110.00	2.15
138	00914	海螺水泥	95,597.57	0.94
139	002154	报喜鸟	312,775.00	3.08
140	002294	信立泰	312,239.00	3.08
141	601155	新城控股	311,888.00	3.07
142	002068	黑猫股份	311,834.00	3.07
143	688369	致远互联	310,184.50	3.06
144	002948	青岛银行	310,109.00	3.06
145	601825	沪农商行	309,759.00	3.05
146	002371	北方华创	309,550.00	3.05
147	603606	东方电缆	309,113.00	3.05
148	601128	常熟银行	308,547.00	3.04
149	600153	建发股份	308,453.00	3.04
150	600702	舍得酒业	308,404.00	3.04
151	300496	中科创达	308,114.00	3.04
152	01797	东方甄选	307,602.74	3.03
153	688127	蓝特光学	306,602.11	3.02
154	002045	国光电器	306,247.00	3.02
155	603833	欧派家居	305,298.00	3.01
156	600602	云赛智联	305,063.00	3.01
157	688116	天奈科技	304,970.82	3.01
158	002779	中坚科技	304,396.00	3.00
159	002127	南极电商	304,253.00	3.00
160	002230	科大讯飞	302,774.00	2.98
161	600729	重庆百货	301,366.00	2.97
162	600163	中闽能源	300,982.00	2.97
163	600511	国药股份	300,516.00	2.96
164	601319	中国人保	299,455.00	2.95
165	300783	三只松鼠	299,152.00	2.95
166	00939	建设银行	276,642.19	2.73
167	000100	TCL 科技	275,637.00	2.72
168	01138	中远海能	274,238.86	2.70
169	002790	瑞尔特	269,465.00	2.66
170	06869	长飞光纤光缆	260,431.61	2.57
171	601933	永辉超市	244,974.00	2.41
172	600694	大商股份	243,682.00	2.40
173	00968	信义光能	234,323.05	2.31
174	600418	江淮汽车	231,406.00	2.28
175	600993	马应龙	227,203.00	2.24
176	000338	潍柴动力	226,591.00	2.23
177	002572	索菲亚	224,711.00	2.21

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。

8.4.2 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	01378	中国宏桥	13,256,699.51	130.63
2	603993	洛阳钼业	10,147,498.00	100.00
2	03993	洛阳钼业	1,910,316.18	18.82
3	00883	中国海洋石油	8,198,324.40	80.79
3	600938	中国海油	199,533.00	1.97
4	601168	西部矿业	5,759,546.00	56.76
5	601899	紫金矿业	4,737,917.00	46.69
5	02899	紫金矿业	497,074.18	4.90
6	600489	中金黄金	4,645,884.00	45.78
7	601918	新集能源	4,269,728.00	42.07
8	601601	中国太保	2,087,336.00	20.57
8	02601	中国太保	1,548,407.75	15.26
9	601898	中煤能源	2,207,718.00	21.76
9	01898	中煤能源	1,358,457.65	13.39
10	000333	美的集团	3,516,575.00	34.65
11	002475	立讯精密	3,339,036.00	32.90
12	601077	渝农商行	3,335,186.00	32.87
13	300033	同花顺	3,267,892.00	32.20
14	601702	华峰铝业	3,129,709.00	30.84
15	000975	山金国际	3,035,858.00	29.92
16	300274	阳光电源	2,994,310.40	29.51
17	300750	宁德时代	2,978,610.20	29.35
18	601958	金钼股份	2,831,412.00	27.90
19	601600	中国铝业	2,122,494.00	20.92
19	02600	中国铝业	687,562.16	6.78
20	01772	赣锋锂业	2,684,320.73	26.45
20	002460	赣锋锂业	77,420.00	0.76
21	600988	赤峰黄金	2,525,070.94	24.88
22	01818	招金矿业	2,477,218.73	24.41
23	002028	思源电气	2,473,005.00	24.37
24	02328	中国财险	2,209,562.92	21.77
25	00857	中国石油股份	1,951,991.43	19.24
25	601857	中国石油	241,966.00	2.38
26	09988	阿里巴巴-W	2,101,718.91	20.71
27	600900	长江电力	2,064,265.00	20.34
28	06682	第四范式	1,852,020.19	18.25
29	300308	中际旭创	1,809,439.00	17.83
30	600031	三一重工	1,808,251.00	17.82
31	600801	华新水泥	1,249,869.00	12.32
31	06655	华新水泥	423,215.87	4.17

32	600023	浙能电力	1,630,093.00	16.06
33	600803	新奥股份	1,627,514.00	16.04
34	000425	徐工机械	1,541,806.00	15.19
35	603801	志邦家居	1,511,147.00	14.89
36	002463	沪电股份	1,484,209.00	14.63
37	601865	福莱特	766,218.00	7.55
37	06865	福莱特玻璃	714,223.68	7.04
38	601288	农业银行	839,739.00	8.27
38	01288	农业银行	609,592.26	6.01
39	000858	五 粮 液	1,444,120.00	14.23
40	01088	中国神华	1,438,681.43	14.18
41	002517	恺英网络	1,421,609.00	14.01
42	02099	中国黄金国际	1,410,464.68	13.90
43	600519	贵州茅台	1,406,730.00	13.86
44	000983	山西焦煤	1,338,686.00	13.19
45	002911	佛燃能源	1,321,609.00	13.02
46	002064	华峰化学	1,161,414.00	11.44
47	601881	中国银河	1,145,417.00	11.29
48	603816	顾家家居	1,135,357.00	11.19
49	002466	天齐锂业	1,098,478.00	10.82
50	002402	和而泰	1,075,727.00	10.60
51	002594	比亚迪	1,067,066.00	10.52
52	000028	国药一致	1,065,747.00	10.50
53	688608	恒玄科技	1,017,997.47	10.03
54	600486	扬农化工	986,700.00	9.72
55	601333	广深铁路	936,688.00	9.23
56	603225	新凤鸣	932,754.00	9.19
57	01258	中国有色矿业	914,597.12	9.01
58	601699	潞安环能	902,701.00	8.90
59	01816	中广核电力	880,333.37	8.67
60	300418	昆仑万维	866,445.00	8.54
61	600958	东方证券	852,520.00	8.40
62	03896	金山云	831,196.94	8.19
63	09987	百胜中国	830,673.73	8.19
64	600079	人福医药	808,687.00	7.97
65	002624	完美世界	797,246.00	7.86
66	000568	泸州老窖	782,901.00	7.71
67	600183	生益科技	766,815.00	7.56
68	600732	爱旭股份	756,720.80	7.46
69	600028	中国石化	750,088.00	7.39
70	00107	四川成渝高速 公路	741,825.74	7.31
71	002241	歌尔股份	716,266.00	7.06
72	688503	聚和材料	685,194.12	6.75

73	601377	兴业证券	663,728.00	6.54
74	600030	中信证券	657,543.00	6.48
75	600570	恒生电子	653,204.00	6.44
76	601138	工业富联	629,945.07	6.21
77	600129	太极集团	627,290.00	6.18
78	601058	赛轮轮胎	608,773.00	6.00
79	300133	华策影视	603,427.00	5.95
80	002738	中矿资源	599,944.00	5.91
81	00220	统一企业中国	597,795.03	5.89
82	600497	驰宏锌锗	589,160.00	5.81
83	03800	协鑫科技	588,399.33	5.80
84	600919	江苏银行	583,962.00	5.75
85	603185	弘元绿能	571,731.67	5.63
86	603599	广信股份	559,831.00	5.52
87	09868	小鹏汽车-W	545,398.17	5.37
88	300015	爱尔眼科	524,317.00	5.17
89	01618	中国中冶	520,668.97	5.13
90	000034	神州数码	511,199.00	5.04
91	600438	通威股份	505,464.00	4.98
92	002601	龙佰集团	505,463.00	4.98
93	03668	兖煤澳大利亚	501,594.45	4.94
94	00371	北控水务集团	490,978.26	4.84
95	002050	三花智控	483,027.00	4.76
96	600036	招商银行	470,980.00	4.64
97	603305	旭升集团	464,862.00	4.58
98	603806	福斯特	452,427.00	4.46
99	601336	新华保险	451,793.00	4.45
100	02057	中通快递-W	449,124.68	4.43
101	002487	大金重工	447,464.00	4.41
102	000807	云铝股份	438,900.00	4.32
103	002832	比音勒芬	429,927.00	4.24
104	300100	双林股份	429,071.00	4.23
105	002129	TCL 中环	427,542.00	4.21
106	002293	罗莱生活	424,898.00	4.19
107	688066	航天宏图	413,457.85	4.07
108	002304	洋河股份	412,002.00	4.06
109	001301	尚太科技	410,349.00	4.04
110	000408	藏格矿业	407,080.00	4.01
111	02020	安踏体育	371,388.96	3.66
112	06862	海底捞	356,860.33	3.52
113	605117	德业股份	356,560.00	3.51
114	02145	上美股份	351,721.82	3.47
115	603606	东方电缆	346,962.00	3.42

116	600176	中国巨石	340,450.00	3.35
117	688099	晶晨股份	335,292.33	3.30
118	600585	海螺水泥	228,052.00	2.25
118	00914	海螺水泥	92,044.10	0.91
119	601666	平煤股份	319,464.00	3.15
120	688256	寒武纪	319,183.68	3.15
121	601098	中南传媒	317,907.00	3.13
122	002127	南极电商	313,595.00	3.09
123	000063	中兴通讯	313,021.00	3.08
124	600966	博汇纸业	311,446.00	3.07
125	603920	世运电路	303,792.00	2.99
126	688116	天奈科技	302,628.65	2.98
127	688332	中科蓝讯	301,873.17	2.97
128	002790	瑞尔特	300,312.00	2.96
129	688127	蓝特光学	299,792.64	2.95
130	00285	比亚迪电子	299,511.02	2.95
131	600511	国药股份	296,650.00	2.92
132	688369	致远互联	294,799.43	2.91
133	002045	国光电器	291,584.00	2.87
134	002068	黑猫股份	289,408.00	2.85
135	600702	舍得酒业	286,618.00	2.82
136	002236	大华股份	286,165.00	2.82
137	601933	永辉超市	283,206.00	2.79
138	01138	中远海能	282,737.15	2.79
139	600602	云赛智联	281,951.00	2.78
140	601155	新城控股	276,754.00	2.73
141	000100	TCL 科技	272,484.00	2.69
142	00939	建设银行	265,212.28	2.61
143	002779	中坚科技	244,519.00	2.41
144	300496	中科创达	240,836.00	2.37
145	002230	科大讯飞	240,690.00	2.37
146	002292	奥飞娱乐	239,439.00	2.36
147	002371	北方华创	237,274.00	2.34
148	600993	马应龙	233,978.00	2.31
149	600418	江淮汽车	224,256.00	2.21
150	000338	潍柴动力	214,327.00	2.11
151	002572	索菲亚	210,966.00	2.08
152	00968	信义光能	210,019.80	2.07
153	00489	东风集团股份	209,617.63	2.07
154	688676	金盘科技	205,766.97	2.03

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。

8.4.3 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	227,571,630.01
卖出股票收入（成交）总额	200,784,246.26

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。

8.5 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	405,053.59	1.33
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	405,053.59	1.33

8.6 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	019740	24 国债 09	4,000	405,053.59	1.33

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国太平洋保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	34,724.47
2	应收清算款	1,448,131.62
3	应收股利	9,984.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	119.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,492,960.08

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
中欧产业 优选混合 发起 A	35	810,629.12	28,012,248.94	98.73%	359,770.14	1.27%
中欧产业 优选混合 发起 C	47	6,191.83	150,000.00	51.54%	141,016.08	48.46%
合计	82	349,549.21	28,162,248.94	98.25%	500,786.22	1.75%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	中欧产业优选混合发起 A	193,024.82	0.68%
	中欧产业优选混合发起 C	0.00	0.00%
	合计	193,024.82	0.67%

9.3 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	中欧产业优选混合发起 A	0
	中欧产业优选混合发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧产业优选混合发起 A	10~50
	中欧产业优选混合发起 C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占 基 金 总	发起份额总数	发起份额占 基金总份额	发起份额承 诺持有期限
----	--------	------------------	--------	----------------	----------------

		份额比例		比例	
基金管理人固有资金	10,150,000.00	35.41%	10,000,000.00	34.89%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,150,000.00	35.41%	10,000,000.00	34.89%	三年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧产业优选混合发起 A	中欧产业优选混合发起 C
基金合同生效日 (2023 年 12 月 27 日) 基金份额总额	10,000,000.00	150,000.00
本报告期期初基金份额总额	10,000,000.00	150,000.00
本报告期基金总申购份额	27,892,105.90	2,333,869.69
减：本报告期基金总赎回份额	9,520,086.82	2,192,853.61
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	28,372,019.08	291,016.08

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人改聘了为基金进行审计的会计师事务所，自 2024 年 11 月 15 日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 10,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
国信证券	1	82,416,877.03	19.24	49,403.11	22.02	本报告期新增 1 个
中信建投	1	71,168,653.88	16.61	37,837.54	16.87	本报告期新增 2 个，本报告期退租 1 个
中泰证券	2	53,470,820.9	12.48	24,947.18	11.12	本报

		9				告期 新增 2 个
华福证券	1	47,806,994.67	11.16	20,838.68	9.29	本 报 告 期 新 增 1 个
浙商证券	1	40,187,369.01	9.38	19,009.04	8.47	本 报 告 期 新 增 1 个
国都证券	2	29,224,893.29	6.82	16,968.25	7.56	本 报 告 期 新 增 3 个, 本 报 告 期 退 租 1 个
华泰证券	1	23,264,786.80	5.43	10,141.16	4.52	本 报 告 期 新 增 2 个, 本 报 告 期 退 租 1 个
国泰君安	1	16,894,917.22	3.94	9,058.68	4.04	本 报 告 期 新 增 1 个
德邦证券	2	13,394,725.80	3.13	6,121.48	2.73	本 报 告 期 新 增 2 个
国盛证券	1	10,376,240.55	2.42	4,587.66	2.05	本 报 告 期 新 增 1 个
申万宏源 证券	1	10,110,871.46	2.36	4,942.53	2.20	本 报 告 期 新 增 1 个
长江证券	1	7,450,509.00	1.74	5,557.13	2.48	本 报 告 期

						新增 2 个, 本报 告期 退租 1 个
国海证券	1	5,754,051.45	1.34	4,159.87	1.85	本报 告期 新增 1 个
开源证券	1	4,756,794.00	1.11	2,073.76	0.92	本报 告期 新增 1 个
财通证券	1	3,660,197.46	0.85	2,729.89	1.22	本报 告期 新增 1 个
东方财富	1	3,198,522.00	0.75	2,385.79	1.06	本报 告期 新增 1 个
东北证券	2	2,630,656.43	0.61	1,634.11	0.73	本报 告期 新增 2 个
中信证券	2	2,000,129.00	0.47	1,492.51	0.67	本报 告期 新增 2 个
民生证券	2	587,866.23	0.14	438.49	0.20	本报 告期 新增 2 个
川财证券	-	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个, 本报 告期 退租 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增

						2 个, 本报 告期 退租 1 个
东吴证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
东兴证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 2 个
光大证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
广发证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 2 个, 本报 告期 退租 1 个
国金证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
国投证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
海通证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
华安证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
华创证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 2 个

华源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
西部证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
西南证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
兴业证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
中金公司	-	-	-	-	-	本报告期新增 1 个，本报告期退租 1 个

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

11.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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(%)
国信证 券	203,375.01	25.08	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	607,392.52	74.92	10,001,000.0 0	49.41	-	-
国都证 券	-	-	7,507,000.00	37.09	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	2,731,000.00	13.49	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

11.8 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	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2024-03-20
2	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
3	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
4	中欧产业优选混合型发起式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
5	中欧产业优选混合型发起式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
6	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
8	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
10	中欧产业优选混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会指定媒介	2024-11-16

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	10,150,000.00	0.00	0.00	10,150,000.00	35.41 %
	2	2024 年 06 月 06 日至 2024 年 12 月 31 日	0.00	18,012,248.94	0.00	18,012,248.94	62.84 %
	3	2024 年 04 月 25 日至 2024 年 10 月 10 日	0.00	9,110,706.15	9,110,706.15	0.00	0.00 %
产品特有风险							

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、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

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日