
中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)

2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧盛世成长混合(LOF)
场内简称	-
基金主代码	166011
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年03月29日
报告期末基金份额总额	315,911,102.20份
投资目标	把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场

	基金和债券型基金，低于股票型基金		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
下属分级基金场内简称	中欧盛世	-	-
下属分级基金的交易代码	166011	001888	004233
报告期末下属分级基金的份额总额	270,055,407.41份	22,676,451.88份	23,179,242.91份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年04月01日 - 2021年06月30日)		
	中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
1. 本期已实现收益	-81,775,315.98	-7,967,326.15	-5,813,132.76
2. 本期利润	-23,604,333.58	-2,927,072.57	-2,032,679.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0634	-0.0852	-0.0727
4. 期末基金资产净值	723,420,311.59	61,001,536.78	60,493,797.42
5. 期末基金份额净值	2.6788	2.6901	2.6098

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧盛世成长混合(LOF)A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-2.24%	0.97%	2.99%	0.73%	-5.23%	0.24%
过去六个月	-7.08%	1.35%	0.95%	0.99%	-8.03%	0.36%
过去一年	33.81%	1.45%	19.87%	1.00%	13.94%	0.45%
过去三年	128.14%	1.52%	41.50%	1.02%	86.64%	0.50%
过去五年	124.92%	1.32%	55.49%	0.88%	69.43%	0.44%
自基金合同生效起至今	563.45%	1.56%	102.84%	1.08%	460.61%	0.48%

中欧盛世成长混合(LOF)E净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.25%	0.97%	2.99%	0.73%	-5.24%	0.24%
过去六个月	-7.09%	1.35%	0.95%	0.99%	-8.04%	0.36%
过去一年	33.80%	1.45%	19.87%	1.00%	13.93%	0.45%
过去三年	128.34%	1.52%	41.50%	1.02%	86.84%	0.50%
过去五年	125.87%	1.32%	55.49%	0.88%	70.38%	0.44%
自基	146.57%	1.43%	47.71%	0.95%	98.86%	0.48%

金份 额运 作日 至今						
----------------------	--	--	--	--	--	--

中欧盛世成长混合(LOF)C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.44%	0.97%	2.99%	0.73%	-5.43%	0.24%
过去六个月	-7.45%	1.35%	0.95%	0.99%	-8.40%	0.36%
过去一年	32.77%	1.45%	19.87%	1.00%	12.90%	0.45%
过去三年	123.79%	1.52%	41.50%	1.02%	82.29%	0.50%
自基金份额运作日至今	117.27%	1.37%	49.42%	0.91%	67.85%	0.46%

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

中欧盛世成长混合(LOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年03月29日-2021年06月30日)



注：本基金转型日期为 2015 年 3 月 30 日。

中欧盛世成长混合(LOF)E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年10月13日-2021年06月30日)



注：本基金于 2015 年 10 月 8 日新增 E 份额，图示日期为 2015 年 10 月 13 日至 2021 年 6 月 30 日。

中欧盛世成长混合(LOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年01月13日-2021年06月30日)



注：本基金于2017年1月12日新增C类份额，图示日期为2017年1月13日至2021年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏博	基金经理	2013-03-29	-	14年	历任中原证券股份有限公司研究员（2007.04-2009.06），东方证券股份有限公司研究员（2009.06-2009.11）。2009/11/12加入中欧基金管理有限公司，历任基金

					经理助理兼研究员。
--	--	--	--	--	-----------

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在不公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

我们接受市场的同时更重视对公司的理解。日常工作学习中，整体上我们争取保持思考体系的开放性，积极但不着急地学习积累各方面知识；具体到实务，争取做到事前事后都客观地看待公司、阶段性清零、判断和操作周期保持一致。知易行难，无论是知识的学习积累还是心态的平静客观，我们有时候做得好一些，有时候做得不尽如人意。组合以具有长期前景的公司为配置重点，根据我们对公司理解能力的变化进行调整。

4.5 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-2.24%，同期业绩比较基准收益率为2.99%；基金E类份额净值增长率为-2.25%，同期业绩比较基准收益率为2.99%；基金C类份额净值增长率为-2.44%，同期业绩比较基准收益率为2.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	712,779,910.87	83.71
	其中：股票	712,779,910.87	83.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,035,166.00	4.00
	其中：债券	34,035,166.00	4.00
	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	40,000,000.00	4.70
	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	55,899,175.54	6.56
8	其他资产	8,793,572.48	1.03
9	合计	851,507,824.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	397,061,654.61	46.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.04

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	417,687.13	0.05
J	金融业	314,732,223.66	37.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	145,471.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	712,779,910.87	84.36

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	2,465,535	80,844,892.65	9.57
2	600036	招商银行	1,456,509	78,928,222.71	9.34
3	002142	宁波银行	1,995,624	77,769,467.28	9.20
4	603589	口子窖	1,147,177	77,652,411.13	9.19
5	000001	平安银行	3,410,916	77,154,919.92	9.13
6	002594	比亚迪	270,200	67,820,200.00	8.03
7	603198	迎驾贡酒	1,144,721	50,711,140.30	6.00
8	601636	旗滨集团	2,693,138	49,984,641.28	5.92
9	603369	今世缘	921,400	49,903,024.00	5.91

10	002466	天齐锂业	582,600	36,132,852.00	4.28
----	--------	------	---------	---------------	------

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	34,035,166.00	4.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,035,166.00	4.03

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113047	旗滨转债	213,400	34,035,166.00	4.03

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于2020-09-29受到国家外汇管理局深圳市分局的深外管检[2020]76号，于2020-11-27受到国家外汇管理局深圳市分局的深外管检（2020）92号，于2021-05-17受到银保监会的银保监罚决字（2021）16号。罚款合计7345万元人民币，没收违法所得128.82万元人民币。

本基金投资的宁波银行的发行主体宁波银行股份有限公司于2020-10-16受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2020）48号，于2021-06-10受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2021）36号。罚款合计55万元。

本基金投资的平安银行的发行主体平安银行股份有限公司于2020-10-16受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2020）66号，于2020-05-28受到中国银保监会云南监管局的云银保监罚决字（2021）34号。罚款合计310万元。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,617,613.54
2	应收证券清算款	3,964,127.96
3	应收股利	-
4	应收利息	22,523.75
5	应收申购款	2,189,307.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,793,572.48

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧盛世成长混 合(LOF)A	中欧盛世成长混 合(LOF)E	中欧盛世成长混 合(LOF)C
报告期期初基金 份额总额	442,461,658.42	43,043,028.68	35,537,010.29
报告期期间基金 总申购份额	46,184,148.86	1,860,569.00	7,471,398.08
减：报告期期间 基金总赎回份额	218,590,399.87	22,227,145.80	19,829,165.46
报告期期间基金 拆分变动份额	-	-	-

(份额减少以“-”填列)			
报告期期末基金份额总额	270,055,407.41	22,676,451.88	23,179,242.91

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2021年07月21日