

# 中欧预见养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

## 2021 年中期报告

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:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| §4 管理人报告                                | 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              | 11 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 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       | 13 |
| §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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| §7 投资组合报告                               | 52 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 52 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 53 |
| 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       | 54 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 57 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 59 |
| 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      | 60 |
| 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   | 60 |
| 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   | 60 |
| 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      | 60 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 60 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 61 |
| 7.12 本报告期投资基金情况                         | 61 |
| 7.13 投资组合报告附注                           | 64 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 65 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 65 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 66 |
| 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.....   | 66 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 66 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 67 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 67 |
| 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.....   | 67 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 67 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 67 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....            | 67 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 67 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 68 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 68 |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 69 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 69 |
| 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..... | 69 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 69 |
| §12 备查文件目录.....                         | 69 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 69 |
| 12.2 存放地点.....                          | 70 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 70 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                                  |                      |
|-----------------|----------------------------------|----------------------|
| 基金名称            | 中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF） |                      |
| 基金简称            | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）              |                      |
| 基金主代码           | 006321                           |                      |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式                          |                      |
| 基金合同生效日         | 2018年10月10日                      |                      |
| 基金管理人           | 中欧基金管理有限公司                       |                      |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                       |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 799, 576, 103. 37份               |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                              |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A             | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 006321                           | 006322               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 711, 840, 633. 69份               | 87, 735, 469. 68份    |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                      |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金是基金中基金，依照下滑曲线进行大类资产配置，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在力争实现养老目标的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。                                                                      |
| 投资策略   | 本基金权益类资产包含股票、股票型基金、过去四个季度季末股票资产占基金资产比例均不低于50%的混合型基金。其中权益类资产占比将按照下滑曲线逐年调整，并预留一定的主动调整空间，在综合考虑各期限的资产配置需求和影响因素后，本基金的权益类资产占比按距离目标日期到期日的远近调整，具体参见基金的招募说明书。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×下滑曲线值+中债综合指数收益率×（1-下滑曲线值）                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金为基金中基金，基金随着所设定目标日期                                                                                                                                |

|  |                                                                                                                                                                                  |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例，从而逐步降低整体组合的波动性，并实现风险分散的目标。本基金相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险和预期收益较小，但高于债券基金和货币市场基金。</p> <p>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。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人                  |
|---------|------|---------------------------|------------------------|
| 名称      |      | 中欧基金管理有限公司                | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 黎忆海                       | 张燕                     |
|         | 联系电话 | 021-68609600              | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com        | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 021-68609700、400-700-9700 | 95555                  |
| 传真      |      | 021-33830351              | 0755-83195201          |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层  | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层  | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |
| 邮政编码    |      | 200120                    | 518040                 |
| 法定代表人   |      | 窦玉明                       | 缪建民                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报           |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.zofund.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                           |
|--------|------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 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333号东方汇经大厦5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<br>(2021年01月01日-2021年06月30日) |                           |
|---------------|----------------------------------|---------------------------|
|               | 中欧预见养老2035三年持有<br>(FOF) A        | 中欧预见养老2035三年持有<br>(FOF) C |
| 本期已实现收益       | 42,659,973.36                    | 5,077,559.22              |
| 本期利润          | 71,600,300.67                    | 8,597,724.00              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1056                           | 0.1007                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 6.64%                            | 6.39%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.70%                            | 6.48%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2021年06月30日)            |                           |
|               | 206,797,282.22                   | 24,114,773.68             |
| 期末可供分配利润      |                                  |                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2905                           | 0.2749                    |
| 期末基金资产净值      | 1,184,126,450.11                 | 144,368,886.89            |
| 期末基金份额净值      | 1.6635                           | 1.6455                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2021年06月30日)            |                           |
|               | 66.35%                           | 64.55%                    |
| 基金份额累计净值增长率   |                                  |                           |

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、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

中欧预见养老2035三年持有（FOF）A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 1.20%        | 0.59%               | -0.88%             | 0.35%                     | 2.08%  | 0.24% |
| 过去三个月          | 8.09%        | 0.61%               | 1.82%              | 0.42%                     | 6.27%  | 0.19% |
| 过去六个月          | 6.70%        | 0.77%               | 0.72%              | 0.57%                     | 5.98%  | 0.20% |
| 过去一年           | 24.93%       | 0.69%               | 11.25%             | 0.58%                     | 13.68% | 0.11% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 66.35%       | 0.62%               | 27.96%             | 0.62%                     | 38.39% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*下滑曲线值+中债综合指数收益率\*（1-下滑曲线值）。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。

中欧预见养老2035三年持有（FOF）C

| 阶段    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.17%        | 0.59%               | -0.88%             | 0.35%                     | 2.05%  | 0.24% |
| 过去三个月 | 7.98%        | 0.61%               | 1.82%              | 0.42%                     | 6.16%  | 0.19% |
| 过去六个月 | 6.48%        | 0.77%               | 0.72%              | 0.57%                     | 5.76%  | 0.20% |
| 过去一年  | 24.43%       | 0.69%               | 11.25%             | 0.58%                     | 13.18% | 0.11% |
| 自基金合同 | 64.55%       | 0.62%               | 27.96%             | 0.62%                     | 36.59% | 0.00% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*下滑曲线值+中债综合指数收益率\*（1-下滑曲线值）。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

中欧预见养老2035三年持有 (FOF) 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

(2018年10月10日-2021年06月30日)



中欧预见养老2035三年持有 (FOF) 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  
(2018年10月10日-2021年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2021年6月30日，本基金管理人共管理96只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期            | 离任日期 |        |    |
|    |    |                 |      |        |    |

|    |      |            |   |      |                                                                                                                                                                         |
|----|------|------------|---|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 桑磊 | 基金经理 | 2018-10-10 | - | 13 年 | 历任平安资产管理公司风险管理、组合投资经理，中国平安人寿保险股份有限公司资产配置管理岗、助理资产配置经理，中国平安保险（集团）股份有限公司首席投资官办公室助理资产策略经理，众安在线财产保险股份有限公司资产管理部负责人，永诚保险资产管理有限公司（筹）组合投资经理。2016/12/01加入中欧基金管理有限公司，历任配置研究员、投资经理。 |
|----|------|------------|---|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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 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 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

今年上半年全球宏观环境处于经济增长稳健但结构较为脆弱、流动性稳定的状态，国内债券收益率下行，美国债券收益率受通胀上行及美联储宽松政策退出预期有所上行。A股市场上半年整体震荡缓慢上行但行业风格分化巨大，上半年A股市场主要指数收涨，成长风格表现更为强势，行业板块中，电气设备、钢铁、化工等行业的涨幅居前，保险、家用电器、国防军工等行业则表现较差。海外股票市场主要指数收涨，美元指数走强，人民币汇率走强，黄金震荡下跌，原油、铜等商品则大幅上涨。

本基金上半年坚持长期资产配置策略，在权益市场波动过程中采用再平衡操作使得权益仓位大体维持稳定，权益类资产持仓在不同的投资风格之间保持适度均衡，避免风格配置过于极端，但也通过流动性高的ETF等小幅度进行资产配置调整，在A股市场风格快速变动过程中，适当提前小幅调整组合持仓风格结构。本基金投资的权益类资产仍然以中欧基金内部长期业绩优异的权益型基金为主，外部指数型基金为辅，并继续持有长期业绩优异且与养老需求较为匹配的医疗行业基金，也直接投资了部分个股，并积极参与新股申购。在黄金震荡过程中，小幅参与黄金的波段性投资机会。同时参与部分可转债及可转债基金的交易性机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值增长率为6.70%，同期业绩比较基准收益率为0.72%；C类份额净值增长率为6.48%，同期业绩比较基准收益率为0.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，A股市场整体估值水平依然不高，经济增长稳健、流动性稳定以及估值不高的组合使得股票市场整体风险不高，但股票市场不同行业之间估值分化极高，消费、医药、科技成长板块预期充分，估值较高，预计难以持续获得稳定的超额收益，与此同时金融、地产和传统周期行业则估值仍处于低位，具有较高的相对吸引力，但经济增长仍然具有一定的脆弱性，且预期变化迅速，这些板块也难以持续强势上涨，使得股票市场难有趋势性上升的机会，表现在市场上就是指数震荡加剧但最终会结果预计是缓慢上行，同时行业轮动迅速，不管是指数还是板块的短期表现往往会超预期，市场乐观的时候反而容易下跌，市场悲观的时候反而容易上涨。

未来预见养老2025、预见养老2035、预见养老2050三只基金将采取类似的投资策略，形成清晰的产品风险特征差异。投资策略上，将继续从长期资产配置、中短期资产配置、基金选择等层面进行投资考量，综合考虑市场机会、长期投资目标、中短期组合波动性等，在实现长期投资目标的同时力争控制基金收益的波动性。长期资产配置上，基于养老目标基金的长期投资目标，本基金的大类资产配置比例将在下滑曲线基准附近波动。中短期资产配置上，将结合中短期市场机会，适当调整各大类资产的配置比例，并积极利用不同大类资产之间较低的相关性进行分散投资，降低基金收益的波动性。子基金选择上，将根据资产配置结果，基于对基金产品和基金经理的评估，选择能够实现资产配置目标并长期业绩优异能够带来超额收益的基金，不同子基金的投资风格保持适度均衡，避免风格配置过于极端，降低投资风险。此外，将根据可转债市场的性价比阶段性的予以配置，并积极参与新股申购等低风险投资机会，增强组合收益。

#### 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、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末<br>2021年06月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：    |         |                    |                     |
| 银行存款    | 6.4.7.1 | 5,822,721.97       | 12,695,434.99       |
| 结算备付金   |         | 643,925.43         | 1,576,788.70        |
| 存出保证金   |         | 66,200.25          | 75,013.48           |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,366,637,205.70   | 1,122,493,046.06    |
| 其中：股票投资 |         | 134,307,236.03     | 127,510,277.66      |
| 基金投资    |         | 1,094,743,391.15   | 923,370,020.48      |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 债券投资            |            | 137,586,578.52             | 71,612,747.92               |
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 2,000,000.00               | 4,132,123.31                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 938,714.73                 | 720,310.50                  |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 4,986,146.87               | 3,186,249.40                |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 40,942.09                  | 18,132.99                   |
| 资产总计            |            | 1,381,135,857.04           | 1,144,897,099.43            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2020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       |            | 52,000,000.00              | 15,000,000.00               |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 226,994.69                 | 214,833.00                  |
| 应付托管费           |            | 157,915.39                 | 136,970.16                  |
| 应付销售服务费         |            | 46,514.04                  | 41,390.60                   |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 54,845.69                  | 117,109.89                  |
| 应交税费            |            | 91.56                      | 81.07                       |
| 应付利息            |            | 47,542.43                  | 5,745.20                    |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 106,616.24                 | 215,000.00                  |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 负债合计          |          | 52,640,520.04    | 15,731,129.92    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 799,576,103.37   | 724,971,331.85   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 528,919,233.63   | 404,194,637.66   |
| 所有者权益合计       |          | 1,328,495,337.00 | 1,129,165,969.51 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,381,135,857.04 | 1,144,897,099.43 |

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值为人民币1.6615元，基金份额总额799,576,103.37份。其中A类基金份额净值为人民币1.6635元，基金份额总额711,840,633.69份；C类基金份额净值为人民币1.6455元，基金份额总额87,735,469.68份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年06月30日 |
|-------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |          | 83,593,061.66                     | 83,461,217.33                          |
| 1. 利息收入           |          | 962,954.91                        | 740,027.87                             |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 23,174.84                         | 20,794.86                              |
| 债券利息收入            |          | 939,780.07                        | 717,825.34                             |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入        |          | -                                 | 1,407.67                               |
| 证券出借利息收入          |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入            |          | -                                 | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 49,998,717.15                     | 38,530,252.95                          |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | 20,351,184.43                     | 21,800,086.63                          |

|                                 |                |               |               |
|---------------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 基金投资收益                          | 6.4.7.13       | 13,584,214.03 | 5,150,373.98  |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.14       | 293,314.20    | 329,465.18    |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.14.<br>3 | —             | —             |
| 贵金属投资收益                         |                | —             | —             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.15       | —             | —             |
| 股利收益                            | 6.4.7.16       | 15,770,004.49 | 11,250,327.16 |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.17       | 32,460,492.09 | 44,118,690.94 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |                | —             | —             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.18       | 170,897.51    | 72,245.57     |
| <b>减：二、费用</b>                   |                | 3,395,036.99  | 2,180,950.46  |
| 1. 管理人报酬                        |                | 1,318,269.65  | 875,510.71    |
| 2. 托管费                          |                | 894,486.57    | 548,450.09    |
| 3. 销售服务费                        |                | 266,916.34    | 168,146.51    |
| 4. 交易费用                         | 6.4.7.19       | 277,748.48    | 295,967.88    |
| 5. 利息支出                         |                | 504,654.47    | 170,268.89    |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |                | 504,654.47    | 170,268.89    |
| 6. 税金及附加                        |                | 37.32         | 6.00          |
| 7. 其他费用                         | 6.4.7.20       | 132,924.16    | 122,600.38    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |                | 80,198,024.67 | 81,280,266.87 |
| 减：所得税费用                         |                | —             | —             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |                | 80,198,024.67 | 81,280,266.87 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                                                    | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日      |                |                  |
|--------------------------------------------------------|------------------------------------|----------------|------------------|
|                                                        | 实收基金                               | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                    | 724,971,331.85                     | 404,194,637.66 | 1,129,165,969.51 |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动<br>数(本期利润)                       | -                                  | 80,198,024.67  | 80,198,024.67    |
| 三、本期基金份额交<br>易产生的基金净值<br>变动数(净值减少以<br>“-”号填列)          | 74,604,771.52                      | 44,526,571.30  | 119,131,342.82   |
| 其中：1. 基金申购款                                            | 74,604,771.52                      | 44,526,571.30  | 119,131,342.82   |
| 2. 基金赎回<br>款                                           | -                                  | -              | -                |
| 四、本期向基金份额<br>持有人分配利润产生<br>的基金净值变动<br>(净值减少以“-”<br>号填列) | -                                  | -              | -                |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                    | 799,576,103.37                     | 528,919,233.63 | 1,328,495,337.00 |
| 项 目                                                    | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                |                  |
|                                                        | 实收基金                               | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                    | 529,240,440.30                     | 103,103,320.22 | 632,343,760.52   |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动<br>数(本期利润)                       | -                                  | 81,280,266.87  | 81,280,266.87    |
| 三、本期基金份额交<br>易产生的基金净值                                  | 112,437,080.67                     | 27,687,878.27  | 140,124,958.94   |

|                                        |                |                |                |
|----------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 变动数（净值减少以“-”号填列）                       |                |                |                |
| 其中：1. 基金申购款                            | 112,437,080.67 | 27,687,878.27  | 140,124,958.94 |
| 2. 基金赎回款                               | -              | -              | -              |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 641,677,520.97 | 212,071,465.36 | 853,748,986.33 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2018]1244号《关于准予中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由中欧基金管理有限公司于2018年9月10日至2018年9月27日止期间向社会公开募集。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321,650,180.10元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第61336106\_B18号予以验证。经向中国证监会备案，《中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于2018年10月10日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为321,821,683.65份基金份额，其中包含认购资金利息折合171,503.55份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为289,773,226.94份，包含认购利息折合156,582.46份；C类基金的基金份额总额为32,048,456.71份，包含认购利息折合14,921.09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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金）、香港互认基金、股票（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、永续债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、同业存单等货币市场工具、现金，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）。

本基金投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含QDII基金）；本基金对股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的投资合计占基金资产的比例不超过60%，其中对商品基金投资占基金资产的比例不超过10%。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×下滑曲线值+中债综合指数收益率×（1-下滑曲线值），其中本基金各年的下滑曲线值按本招募说明书的规定执行。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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2号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6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‰；

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 5,822,721.97       |
| 定期存款         | —                  |
| 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         | —                  |
| 合计           | 5,822,721.97       |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年06月30日 |                |                |
|---------------|--------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 114,683,515.72     | 134,307,236.03 | 19,623,720.31  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                  | —              | —              |
| 债券            | 交易所市场              | 138,753,935.54 | 137,586,578.52 |
|               | 银行间市               | —              | —              |

|        | 场  |                  |                  |                |
|--------|----|------------------|------------------|----------------|
|        | 合计 | 138,753,935.54   | 137,586,578.52   | -1,167,357.02  |
| 资产支持证券 |    | -                | -                | -              |
| 基金     |    | 892,196,089.60   | 1,094,743,391.15 | 202,547,301.55 |
| 其他     |    | -                | -                | -              |
| 合计     |    | 1,145,633,540.86 | 1,366,637,205.70 | 221,003,664.84 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 979.72             |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 289.80             |
| 应收债券利息     | 937,415.41         |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | -                  |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 应收出借证券利息   | -                  |
| 其他         | 29.80              |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 938,714.73 |
|----|------------|

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------|--------------------|
| 其他应收款 | 40,942.09          |
| 待摊费用  | -                  |
| 合计    | 40,942.09          |

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 54,845.69          |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  |
| 合计          | 54,845.69          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提费用-审计费    | 47,108.87          |
| 预提费用-信息披露费  | 59,507.37          |
| 合计          | 106,616.24         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| (中欧预见养老2035三年持有<br>(FOF) A) | 2021年01月01日至2021年06月30日 |                |
|-----------------------------|-------------------------|----------------|
|                             | 基金份额（份）                 | 账面金额           |
| 上年度末                        | 642,823,580.02          | 642,823,580.02 |
| 本期申购                        | 69,017,053.67           | 69,017,053.67  |
| 本期赎回（以“-”号填列）               | -                       | -              |
| 本期末                         | 711,840,633.69          | 711,840,633.69 |

金额单位：人民币元

| 项目<br>(中欧预见养老2035三年持有<br>(FOF) C) | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |               |
|-----------------------------------|-------------------------------|---------------|
|                                   | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末                              | 82,147,751.83                 | 82,147,751.83 |
| 本期申购                              | 5,587,717.85                  | 5,587,717.85  |
| 本期赎回（以“-”号填列）                     | -                             | -             |
| 本期末                               | 87,735,469.68                 | 87,735,469.68 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A

单位：人民币元

| 项目<br>(中欧预见养老2035三<br>年持有 (FOF) A) | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末                               | 145,708,837.33 | 213,689,696.86 | 359,398,534.19 |
| 本期利润                               | 42,659,973.36  | 28,940,327.31  | 71,600,300.67  |
| 本期基金份额交易产生的变动数                     | 18,428,471.53  | 22,858,510.03  | 41,286,981.56  |
| 其中：基金申购款                           | 18,428,471.53  | 22,858,510.03  | 41,286,981.56  |
| 基金赎回款                              | -              | -              | -              |
| 本期已分配利润                            | -              | -              | -              |
| 本期末                                | 206,797,282.22 | 265,488,534.20 | 472,285,816.42 |

#### 6.4.7.10.2 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C

单位：人民币元

| 项目<br>(中欧预见养老2035三<br>年持有（FOF）C) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末                             | 17,641,259.68 | 27,154,843.79 | 44,796,103.47 |
| 本期利润                             | 5,077,559.22  | 3,520,164.78  | 8,597,724.00  |
| 本期基金份额交易产<br>生的变动数               | 1,395,954.78  | 1,843,634.96  | 3,239,589.74  |
| 其中：基金申购款                         | 1,395,954.78  | 1,843,634.96  | 3,239,589.74  |
| 基金赎回款                            | -             | -             | -             |
| 本期已分配利润                          | -             | -             | -             |
| 本期末                              | 24,114,773.68 | 32,518,643.53 | 56,633,417.21 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 12,829.13                     |
| 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 | 9,692.23                      |
| 其他        | 653.48                        |
| 合计        | 23,174.84                     |

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 86,813,243.50                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 66,462,059.07                 |

|          |               |
|----------|---------------|
| 买卖股票差价收入 | 20,351,184.43 |
|----------|---------------|

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 137,142,557.92                |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 123,558,343.89                |
| 基金投资收益        | 13,584,214.03                 |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 293,314.20                    |
| 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                            | 293,314.20                    |

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 69,667,352.12                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 68,036,403.22                 |
| 减：应收利息总额                | 1,337,634.70                  |

|          |            |
|----------|------------|
| 买卖债券差价收入 | 293,314.20 |
|----------|------------|

#### 6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 566,839.22                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                             |
| 基金投资产生的股利收益   | 15,203,165.27                 |
| 合计            | 15,770,004.49                 |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 32,460,492.09                 |
| ——股票投资     | 33,232.48                     |
| ——债券投资     | -1,396,711.11                 |
| ——资产支持证券投资 | —                             |
| ——基金投资     | 33,823,970.72                 |
| ——贵金属投资    | —                             |
| ——其他       | —                             |
| 2. 衍生工具    | —                             |
| ——权证投资     | —                             |
| 3. 其他      | —                             |
| 减：应税金融商品公允 | —                             |

|              |               |
|--------------|---------------|
| 价值变动产生的预估增值税 |               |
| 合计           | 32,460,492.09 |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                             |
| 其他      | 170,897.51                    |
| 合计      | 170,897.51                    |

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 270,819.87                    |
| 银行间市场交易费用 | -                             |
| 交易基金产生的费用 | 6,928.61                      |
| 其中：申购费    | 10.00                         |
| 赎回费       | 1,304.30                      |
| 交易费       | 5,614.31                      |
| 合计        | 277,748.48                    |

## 6.4.7.19.1 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------------|---------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 180,955.73                      |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 4,838,589.70                    |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 908,537.24                      |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费及托管费等进行的估算，上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 47,108.87                     |
| 信息披露费   | 59,507.37                     |
| 证券出借违约金 | —                             |
| 汇划手续费   | 7,707.92                      |
| 账户维护费   | 18,000.00                     |
| 其他      | 600.00                        |
| 合计      | 132,924.16                    |

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未发生重大关联方关系变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 中欧基金管理有限公司（“中欧基金”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 招商银行股份有限公司         | 基金托管人、基金销售机构        |

|                    |                 |
|--------------------|-----------------|
| 国都证券股份有限公司（“国都证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 自然人股东              | 基金管理人的股东        |

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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06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 |
| 国都证券  | 101,123,829.96                | 69.52%       | 130,508,804.94                     | 86.09%       |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                |
|-------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                          | 占当期债券买卖成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 国都证券  | 182,205,515.25                | 89.53%         | 39,829,929.40                      | 98.64%         |

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

| 称    | 2021年01月01日至2021年06月30日 |                                | 2020年01月01日至2020年06月30日 |                                |
|------|-------------------------|--------------------------------|-------------------------|--------------------------------|
|      | 成交金额                    | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 | 成交金额                    | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 |
| 国都证券 | 998,600,000.00          | 100.00%                        | 239,500,000.00          | 100.00%                        |

#### 6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名<br>称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                          | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                          |
|-----------|-------------------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|
|           | 成交金额                          | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额                               | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例 |
| 国都证券      | 119,583,508.93                | 77.13%                   | 185,513,985.10                     | 82.00%                   |

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名<br>称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日      |                        |           |                      |
|-----------|------------------------------------|------------------------|-----------|----------------------|
|           | 当期佣金                               | 占当期<br>佣金总<br>量的比<br>例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |
| 国都证券      | 94,175.22                          | 69.52%                 | 45,804.37 | 83.51%               |
| 关联方名<br>称 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                        |           |                      |
|           | 当期佣金                               | 占当期<br>佣金总<br>量的比<br>例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应<br>付佣金总<br>额的比例 |

|      |            |        |           |        |
|------|------------|--------|-----------|--------|
| 国都证券 | 121,542.81 | 86.09% | 68,391.69 | 90.25% |
|------|------------|--------|-----------|--------|

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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,318,269.65                  | 875,510.71                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,692,159.72                  | 1,055,281.42                       |

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 894,486.57                    | 548,450.09                         |

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，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<br>2021年01月01日至2021年06月30日      |                      |           |
|----------------|------------------------------------|----------------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |                      |           |
|                | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A               | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C | 合计        |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                               | 32,414.51            | 32,414.51 |
| 国都证券           | 0.00                               | 314.71               | 314.71    |
| 合计             | 0.00                               | 32,729.22            | 32,729.22 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |                      |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |                      |           |
|                | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A               | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C | 合计        |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                               | 21,866.26            | 21,866.26 |
| 国都证券           | 0.00                               | 210.07               | 210.07    |
| 合计             | 0.00                               | 22,076.33            | 22,076.33 |

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0.40%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：  

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付给基金管理人，由基金管理人代收，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

中欧预见养老2035三年持有（FOF）A

| 关联方名称 | 本期末<br>2021年06月30日 |                  | 上年度末<br>2020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 | 2,437,213.73 | 0.34% | 2,420,996.24 | 0.38% |
|-------|--------------|-------|--------------|-------|

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期末，除管理人之外的其他关联方均未持有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<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年06月30日 |           |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 招商银行股份有限公司 | 5,822,721.97                  | 12,829.13 | 5,882,816.25                       | 15,257.83 |

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有招商银行发行的同业存单。本报告期末，本基金持有基金管理人中欧基金管理有限公司所管理的基金合计人民币711,235,747.35元。

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

| 项目              | 本期费用<br>2021年01月01日<br>至2021年06月30<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日<br>至2020年06月30<br>日 |
|-----------------|-----------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | -                                       | -                                          |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | -                                       | 1,770.44                                   |

|                      |              |              |
|----------------------|--------------|--------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 170,897.51   | 72,245.57    |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 4,225,310.44 | 2,364,289.31 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 752,750.66   | 431,220.23   |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |              |              |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 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 |
| 600905               | 三峡能源 | 2021-06-02 | 2021-12-10 | 新股流通受限 | 2.65  | 5.67   | 907,763  | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | -  |
| 300957               | 贝泰妮  | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 新股流通受限 | 47.33 | 251.96 | 853      | 40,372.49    | 214,921.88   | -  |
| 688345               | 博力威  | 2021-06-03 | 2021-12-13 | 新股流通受限 | 25.91 | 55.53  | 2,332    | 60,422.12    | 129,495.96   | -  |

|        |      |            |            |        |       |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|------------|---|
| 688667 | 菱电电控 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股流通受限 | 75.42 | 103.88 | 1,191 | 89,825.22 | 123,721.08 | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020-12-15 | 2021-07-02 | 新股流通受限 | 24.60 | 163.00 | 610   | 15,006.00 | 99,430.00  | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021-06-23 | 2021-07-01 | 新股未上市  | 38.85 | 38.85  | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股流通受限 | 33.22 | 87.50  | 925   | 30,728.50 | 80,937.50  | - |
| 688113 | 联测科技 | 2021-04-26 | 2021-11-08 | 新股流通受限 | 19.14 | 49.29  | 1,415 | 27,083.10 | 69,745.35  | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股未上市  | 8.29  | 8.29   | 7,029 | 58,270.41 | 58,270.41  | - |
| 688350 | 富淼科技 | 2021-01-21 | 2021-07-28 | 新股流通受限 | 13.58 | 22.44  | 2,552 | 34,656.16 | 57,266.88  | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021-06-25 | 2021-07-05 | 新股未上市  | 11.48 | 11.48  | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48  | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股流通受限 | 48.59 | 90.39  | 601   | 29,202.59 | 54,324.39  | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股未上市  | 21.96 | 21.96  | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2021-07-05 | 新股未上市  | 8.86  | 8.86   | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70  | - |

|        |      |            |            |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 688597 | 煜邦电力 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 新股流通受限 | 5.88  | 10.16  | 3,907 | 22,973.16 | 39,695.12 | - |
| 688395 | 正弦电气 | 2021-04-21 | 2021-10-29 | 新股流通受限 | 15.95 | 22.37  | 1,627 | 25,950.65 | 36,395.99 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市  | 9.46  | 9.46   | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021-03-11 | 2021-09-22 | 新股流通受限 | 28.77 | 99.85  | 240   | 6,904.80  | 23,964.00 | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021-06-08 | 2021-12-17 | 新股流通受限 | 12.54 | 27.89  | 801   | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股流通受限 | 21.31 | 49.94  | 399   | 8,502.69  | 19,926.06 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021-06-22 | 2021-12-30 | 新股流通受限 | 7.64  | 38.83  | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股未上市  | 6.42  | 6.42   | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 300932 | 三友联众 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股流通受限 | 24.69 | 31.71  | 492   | 12,147.48 | 15,601.32 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股流通受限 | 15.83 | 45.29  | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |

|        |      |            |            |        |       |       |       |          |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300940 | 南极光  | 2021-01-27 | 2021-08-03 | 新股流通受限 | 12.76 | 43.38 | 307   | 3,917.32 | 13,317.66 | - |
| 300614 | 百川畅银 | 2021-05-18 | 2021-11-25 | 新股流通受限 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 300937 | 药易购  | 2021-01-20 | 2021-07-27 | 新股流通受限 | 12.25 | 53.71 | 244   | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股流通受限 | 5.31  | 28.52 | 443   | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股流通受限 | 3.37  | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021-05-27 | 2021-12-07 | 新股流通受限 | 18.71 | 57.62 | 201   | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市  | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.4 | 11,014.4  | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 新股流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232   | 3,834.96 | 10,688.24 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021-05-26 | 2021-12-03 | 新股流通受限 | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40 | 9,429.12  | - |

|        |      |            |            |        |       |       |       |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|----------|----------|---|
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股流通受限 | 11.72 | 27.08 | 340   | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股流通受限 | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25 | 9,069.50 | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.64 | 9,020.44 | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股流通受限 | 4.56  | 18.88 | 474   | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021-02-18 | 2021-08-25 | 新股流通受限 | 8.67  | 27.42 | 324   | 2,808.00 | 8,884.08 | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股流通受限 | 4.31  | 13.11 | 672   | 2,896.32 | 8,809.92 | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021-03-23 | 2021-09-30 | 新股流通受限 | 8.48  | 22.07 | 394   | 3,341.12 | 8,695.58 | - |
| 300950 | 德固特  | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 新股流通受限 | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 605162 | 新中港  | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 新股未上市  | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021-03-18 | 2021-09-29 | 新股流通受限 | 8.53  | 27.22 | 300   | 2,559.00 | 8,166.00 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021-04-21 | 2021-11-01 | 新股流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.56 | 8,070.48 | - |

|        |      |            |            |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 300987 | 川网传媒 | 2021-04-28 | 2021-11-11 | 新股流通受限 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021-04-15 | 2021-10-26 | 新股流通受限 | 8.42  | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020-12-29 | 2021-07-12 | 新股流通受限 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021-05-17 | 2021-11-24 | 新股流通受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股流通受限 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021-04-21 | 2021-10-29 | 新股流通受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021-06-18 | 2021-12-27 | 新股流通受限 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 新股流通受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股流通受限 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2022-01-07 | 新股流通受限 | 8.29  | 8.29  | 782 | 6,482.78 | 6,482.78 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021-04-14 | 2021-10-21 | 新股流通受限 | 5.48  | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |

|        |      |            |            |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 300963 | 中洲特材 | 2021-03-30 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 新股流通受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股流通受限 | 9.79  | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021-04-02 | 2021-10-13 | 新股流通受限 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021-04-08 | 2021-10-19 | 新股流通受限 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021-01-12 | 2021-07-21 | 新股流通受限 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 新股流通受限 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2022-01-05 | 新股流通受限 | 8.86  | 8.86  | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021-05-17 | 2021-11-26 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 新股流通受限 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021-05-25 | 2021-12-02 | 新股流通受限 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |

| 301012               | 扬电科技 | 2021-06-15 | 2021-12-22 | 新股流通受限 | 8.05   | 24.26  | 170      | 1,368.50     | 4,124.20     | -  |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 300992               | 泰福泵业 | 2021-05-17 | 2021-11-25 | 新股流通受限 | 9.36   | 20.32  | 200      | 1,872.00     | 4,064.00     | -  |
| 301010               | 晶雪节能 | 2021-06-09 | 2021-12-20 | 新股流通受限 | 7.83   | 17.61  | 218      | 1,706.94     | 3,838.98     | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股流通受限 | 9.46   | 9.46   | 290      | 2,743.40     | 2,743.40     | -  |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |            |            |        |        |        |          |              |              |    |
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 113050               | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 10,390   | 1,039,000.00 | 1,039,000.00 | -  |

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

#### 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2021年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021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52,000,000.00元，于2021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

本基金为基金中基金，基金随着所设定目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例，从而逐步降低整体组合的波动性，并实现风险分散的目标。本基金相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险和预期收益较小，但高于债券基金和货币市场基金。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。本基金是基金中基金，依照下滑曲线进行大类资产配置，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在力争实现养老目标的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核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提出意见和建议。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，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。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%。在开放期，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年6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无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，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<br>2021年0<br>6月30日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息              | 合计               |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|------------------|------------------|
| 资产                     |               |               |               |                  |                  |
| 银行存款                   | 5,822,721.97  | -             | -             | -                | 5,822,721.97     |
| 结算备付金                  | 643,925.43    | -             | -             | -                | 643,925.43       |
| 存出保证金                  | 66,200.25     | -             | -             | -                | 66,200.25        |
| 交易性金融资产                | 74,559,300.00 | 20,665,352.00 | 42,361,926.52 | 1,229,050,627.18 | 1,366,637,205.70 |
| 应收证券清算款                | -             | -             | -             | 2,000,000.00     | 2,000,000.00     |
| 应收利息                   | -             | -             | -             | 938,714.73       | 938,714.73       |
| 应收申购款                  | -             | -             | -             | 4,986,146.87     | 4,986,146.87     |
| 其他资产                   | -             | -             | -             | 40,942.09        | 40,942.09        |
| 资产总计                   | 81,092,147.65 | 20,665,352.00 | 42,361,926.52 | 1,237,016,430.87 | 1,381,135,857.04 |
| 负债                     |               |               |               |                  |                  |
| 卖出回购金融资产款              | 52,000,000.00 | -             | -             | -                | 52,000,000.00    |
| 应付管理人报酬                | -             | -             | -             | 226,994.69       | 226,994.69       |
| 应付托管费                  | -             | -             | -             | 157,915.39       | 157,915.39       |
| 应付销售服务费                | -             | -             | -             | 46,514.04        | 46,514.04        |

|                     |               |               |               |                  |                  |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|------------------|------------------|
| 应付交易费用              | -             | -             | -             | 54,845.69        | 54,845.69        |
| 应交税费                | -             | -             | -             | 91.56            | 91.56            |
| 应付利息                | -             | -             | -             | 47,542.43        | 47,542.43        |
| 其他负债                | -             | -             | -             | 106,616.24       | 106,616.24       |
| 负债总计                | 52,000,000.00 | -             | -             | 640,520.04       | 52,640,520.04    |
| 利率敏感度缺口             | 29,092,147.65 | 20,665,352.00 | 42,361,926.52 | 1,236,375,910.83 | 1,328,495,337.00 |
| 上年度末<br>2020年12月31日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息              | 合计               |
| 资产                  |               |               |               |                  |                  |
| 银行存款                | 12,695,434.99 | -             | -             | -                | 12,695,434.99    |
| 结算备付金               | 1,576,788.70  | -             | -             | -                | 1,576,788.70     |
| 存出保证金               | 75,013.48     | -             | -             | -                | 75,013.48        |
| 交易性金融资产             | 67,484,850.00 | 1,203,532.00  | 2,924,365.92  | 1,050,880,298.14 | 1,122,493,046.06 |
| 应收证券清算款             | -             | -             | -             | 4,132,123.31     | 4,132,123.31     |
| 应收利息                | -             | -             | -             | 720,310.50       | 720,310.50       |
| 应收申购款               | -             | -             | -             | 3,186,249.40     | 3,186,249.40     |
| 其他资产                | -             | -             | -             | 18,132.99        | 18,132.99        |
| 资产总计                | 81,832,087.17 | 1,203,532.00  | 2,924,365.92  | 1,058,937,114.34 | 1,144,897,099.43 |
| 负债                  |               |               |               |                  |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 15,000,000.00 | -             | -             | -                | 15,000,000.00    |
| 应付管理人报酬             | -             | -             | -             | 214,833.00       | 214,833.00       |

|         |               |              |              |                  |                  |
|---------|---------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 应付托管费   | -             | -            | -            | 136,970.16       | 136,970.16       |
| 应付销售服务费 | -             | -            | -            | 41,390.60        | 41,390.60        |
| 应付交易费用  | -             | -            | -            | 117,109.89       | 117,109.89       |
| 应交税费    | -             | -            | -            | 81.07            | 81.07            |
| 应付利息    | -             | -            | -            | 5,745.20         | 5,745.20         |
| 其他负债    | -             | -            | -            | 215,000.00       | 215,000.00       |
| 负债总计    | 15,000,000.00 | -            | -            | 731,129.92       | 15,731,129.92    |
| 利率敏感度缺口 | 66,832,087.17 | 1,203,532.00 | 2,924,365.92 | 1,058,205,984.42 | 1,129,165,969.51 |

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2021年06月30日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为10.36% (2020年12月31日:6.34%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020年12月31日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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<br>2021年06月30日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 134,307,236.03     | 10.11                    | 127,510,277.66      | 11.29                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | 1,094,743,391.15   | 82.40                    | 923,370,020.48      | 81.77                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                  | —                        | —                   | —                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                  | —                        | —                   | —                        |
| 其他            | —                  | —                        | —                   | —                        |
| 合计            | 1,229,050,627.18   | 92.51                    | 1,050,880,298.14    | 93.07                    |

## 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<br>2021年06月30日          | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 1. 业绩比较基准上升5%        | 85,139,907.94               | 53,957,797.58       |
|    | 2. 业绩比较基准下降5%        | -85,139,907.94              | -53,957,797.58      |

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 1. 公允价值

## 1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

## 1.2 以公允价值计量的金融工具

### 1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,284,210,909.76 元，属于第二层次的余额为82,426,295.94元，无划分为第三层次的余额(2020年12月31日：本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,040,890,451.69元，属于第二层次的余额为人民币81,602,594.37元，无划分为第三层次的余额。)

### 1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开募集的证券投资基金及证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### 1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## 2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

## 3. 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

## 4. 财务报表的批准

本财务报表已于2021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  | 134,307,236.03 | 9.72          |
|    | 其中：股票 | 134,307,236.03 | 9.72          |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资              | 1,094,743,391.15 | 79.26  |
| 3 | 固定收益投资            | 137,586,578.52   | 9.96   |
|   | 其中：债券             | 137,586,578.52   | 9.96   |
|   | 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      | 6,466,647.40     | 0.47   |
| 8 | 其他各项资产            | 8,032,003.94     | 0.58   |
| 9 | 合计                | 1,381,135,857.04 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 11,290.28     | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 3,008,745.00  | 0.23         |
| C  | 制造业              | 34,812,119.75 | 2.62         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,595,556.60  | 0.57         |
| E  | 建筑业              | 25,371.37     | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 328,753.90    | 0.02         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,181,900.00  | 0.24         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,645,817.70  | 0.20         |
| J  | 金融业              | 73,049,174.10 | 5.50         |
| K  | 房地产业             | 5,831,069.00  | 0.44         |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 44,438.33     | 0.00         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 3,773,000.00   | 0.28  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 134,307,236.03 | 10.11 |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告本期末未持有港股通股票投资。

## 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 601658 | 邮储银行 | 2,742,000 | 13,764,840.00 | 1.04                 |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 571,000   | 12,916,020.00 | 0.97                 |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 288,000   | 9,443,520.00  | 0.71                 |
| 4  | 002142 | 宁波银行 | 239,700   | 9,341,109.00  | 0.70                 |
| 5  | 688696 | 极米科技 | 8,000     | 6,656,000.00  | 0.50                 |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 20,800    | 6,196,112.00  | 0.47                 |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 247,000   | 6,160,180.00  | 0.46                 |
| 8  | 000002 | 万科A  | 244,900   | 5,831,069.00  | 0.44                 |
| 9  | 000783 | 长江证券 | 734,000   | 5,372,880.00  | 0.40                 |
| 10 | 600905 | 三峡能源 | 907,763   | 5,147,016.21  | 0.39                 |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 412,000   | 4,738,000.00  | 0.36                 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 61,500    | 3,953,220.00  | 0.30                 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 243,400   | 3,845,720.00  | 0.29                 |
| 14 | 600104 | 上汽集团 | 173,000   | 3,800,810.00  | 0.29                 |
| 15 | 300413 | 芒果超媒 | 55,000    | 3,773,000.00  | 0.28                 |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 330,700   | 3,478,964.00  | 0.26                 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 17 | 603986 | 兆易创新 | 17,500  | 3,288,250.00 | 0.25 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 89,000  | 3,277,870.00 | 0.25 |
| 19 | 002352 | 顺丰控股 | 47,000  | 3,181,900.00 | 0.24 |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 310,500 | 3,008,745.00 | 0.23 |
| 21 | 000333 | 美的集团 | 41,200  | 2,940,444.00 | 0.22 |
| 22 | 600406 | 国电南瑞 | 111,000 | 2,579,640.00 | 0.19 |
| 23 | 600900 | 长江电力 | 118,000 | 2,435,520.00 | 0.18 |
| 24 | 300957 | 贝泰妮  | 8,523   | 2,298,784.18 | 0.17 |
| 25 | 002415 | 海康威视 | 30,500  | 1,967,250.00 | 0.15 |
| 26 | 600690 | 海尔智家 | 60,000  | 1,554,600.00 | 0.12 |
| 27 | 600276 | 恒瑞医药 | 14,400  | 978,768.00   | 0.07 |
| 28 | 688161 | 威高骨科 | 3,069   | 325,467.45   | 0.02 |
| 29 | 301015 | 百洋医药 | 4,614   | 251,115.78   | 0.02 |
| 30 | 688345 | 博力威  | 2,332   | 129,495.96   | 0.01 |
| 31 | 688667 | 菱电电控 | 1,191   | 123,721.08   | 0.01 |
| 32 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747   | 115,711.58   | 0.01 |
| 33 | 300919 | 中伟股份 | 610     | 99,430.00    | 0.01 |
| 34 | 688499 | 利元亨  | 2,149   | 83,488.65    | 0.01 |
| 35 | 300979 | 华利集团 | 925     | 80,937.50    | 0.01 |
| 36 | 688113 | 联测科技 | 1,415   | 69,745.35    | 0.01 |
| 37 | 301018 | 申菱环境 | 7,811   | 64,753.19    | 0.00 |
| 38 | 688350 | 富淼科技 | 2,552   | 57,266.88    | 0.00 |
| 39 | 688239 | 航宇科技 | 4,926   | 56,550.48    | 0.00 |
| 40 | 300981 | 中红医疗 | 601     | 54,324.39    | 0.00 |
| 41 | 688087 | 英科再生 | 2,469   | 54,219.24    | 0.00 |
| 42 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550   | 49,173.00    | 0.00 |
| 43 | 300894 | 火星人  | 628     | 42,704.00    | 0.00 |
| 44 | 300973 | 立高食品 | 360     | 41,655.60    | 0.00 |
| 45 | 688597 | 煜邦电力 | 3,907   | 39,695.12    | 0.00 |
| 46 | 688395 | 正弦电气 | 1,627   | 36,395.99    | 0.00 |
| 47 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230   | 34,721.10    | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 48 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 49 | 300953 | 震裕科技 | 240   | 23,964.00 | 0.00 |
| 50 | 001207 | 联科科技 | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 51 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 52 | 300941 | 创识科技 | 399   | 19,926.06 | 0.00 |
| 53 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 54 | 300925 | 法本信息 | 600   | 15,774.00 | 0.00 |
| 55 | 300932 | 三友联众 | 492   | 15,601.32 | 0.00 |
| 56 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 57 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 58 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 59 | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 60 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 61 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 62 | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 63 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 64 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 65 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 66 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 67 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 68 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 69 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 70 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 71 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 72 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 73 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 74 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 75 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 76 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 77 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 78 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 79  | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 80  | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 81  | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 82  | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 83  | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 84  | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 85  | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 86  | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 87  | 300991 | 创益通  | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 88  | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 89  | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 90  | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 91  | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 92  | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 93  | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 94  | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 95  | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 96  | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 97  | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 98  | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 99  | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 100 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 101 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 102 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 103 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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  | 601658 | 邮储银行 | 15,078,927.00 | 1.34 |
| 2  | 688696 | 极米科技 | 7,001,283.82  | 0.62 |
| 3  | 601818 | 光大银行 | 4,833,268.00  | 0.43 |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 4,159,000.00  | 0.37 |
| 5  | 000002 | 万科A  | 3,811,943.00  | 0.34 |
| 6  | 600893 | 航发动力 | 3,445,000.00  | 0.31 |
| 7  | 600905 | 三峡能源 | 3,436,527.95  | 0.30 |
| 8  | 601009 | 南京银行 | 3,155,628.00  | 0.28 |
| 9  | 000783 | 长江证券 | 3,144,700.00  | 0.28 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 2,797,928.00  | 0.25 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 2,250,923.00  | 0.20 |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 2,026,081.00  | 0.18 |
| 13 | 003011 | 海象新材 | 1,665,160.00  | 0.15 |
| 14 | 600104 | 上汽集团 | 1,664,400.00  | 0.15 |
| 15 | 600030 | 中信证券 | 1,420,000.00  | 0.13 |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,197,000.00  | 0.11 |
| 17 | 300413 | 芒果超媒 | 998,610.00    | 0.09 |
| 18 | 688538 | 和辉光电 | 860,547.75    | 0.08 |
| 19 | 688819 | 天能股份 | 735,378.63    | 0.07 |
| 20 | 300957 | 贝泰妮  | 403,393.59    | 0.04 |

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  | 601398 | 工商银行 | 7,622,000.00 | 0.68           |
| 2  | 601818 | 光大银行 | 7,467,600.00 | 0.66           |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 6,795,958.00 | 0.60           |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 3,578,400.00 | 0.32           |
| 5  | 601009 | 南京银行 | 3,191,255.00 | 0.28           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6  | 688696 | 极米科技 | 3,147,108.80 | 0.28 |
| 7  | 600741 | 华域汽车 | 2,849,866.00 | 0.25 |
| 8  | 601336 | 新华保险 | 2,717,799.00 | 0.24 |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 2,657,575.00 | 0.24 |
| 10 | 001979 | 招商蛇口 | 2,572,322.25 | 0.23 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 2,016,000.00 | 0.18 |
| 12 | 600893 | 航发动力 | 2,001,280.00 | 0.18 |
| 13 | 600905 | 三峡能源 | 1,734,999.00 | 0.15 |
| 14 | 000338 | 潍柴动力 | 1,475,009.72 | 0.13 |
| 15 | 688538 | 和辉光电 | 1,451,619.92 | 0.13 |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 1,388,007.00 | 0.12 |
| 17 | 603195 | 公牛集团 | 1,346,649.91 | 0.12 |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 1,320,949.50 | 0.12 |
| 19 | 003011 | 海象新材 | 1,296,406.00 | 0.11 |
| 20 | 688819 | 天能股份 | 1,117,409.50 | 0.10 |

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 | 73,225,784.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 86,813,243.50 |

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      | 74,559,300.00 | 5.61         |
| 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) | 63,027,278.52  | 4.74  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 137,586,578.52 | 10.36 |

## 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  | 019649 | 21国债01 | 690,000 | 69,048,300.00 | 5.20         |
| 2  | 113043 | 财通转债   | 159,000 | 16,963,710.00 | 1.28         |
| 3  | 110073 | 国投转债   | 129,470 | 13,945,213.70 | 1.05         |
| 4  | 127005 | 长证转债   | 85,150  | 9,974,471.00  | 0.75         |
| 5  | 123107 | 温氏转债   | 51,870  | 5,576,543.70  | 0.42         |

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 投资政策及风险说明

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

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

| 序号 | 基金代码   | 基金名称           | 运作方式       | 持有份额<br>(份)   | 公允价值<br>(元)    | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|----------------|------------|---------------|----------------|--------------|------------------------|
| 1  | 002961 | 中欧双利债券A        | 契约型<br>开放式 | 81,142,435.32 | 100,016,165.78 | 7.53         | 是                      |
| 2  | 002591 | 中欧信用增利债券(L0F)E | 契约型<br>开放式 | 82,223,850.69 | 91,128,693.72  | 6.86         | 是                      |

|    |        |                  |            |                   |                   |      |   |
|----|--------|------------------|------------|-------------------|-------------------|------|---|
| 3  | 166006 | 中欧行业成长混合 (LOF) A | 契约型<br>开放式 | 30,895,54<br>8.57 | 81,487,00<br>9.35 | 6.13 | 是 |
| 4  | 001938 | 中欧时代先锋股票A        | 契约型<br>开放式 | 38,644,31<br>4.56 | 78,861,45<br>2.72 | 5.94 | 是 |
| 5  | 003095 | 中欧医疗健康混合A        | 契约型<br>开放式 | 18,276,92<br>3.89 | 77,018,95<br>7.27 | 5.80 | 是 |
| 6  | 166008 | 中欧增强回报债券 (LOF) A | 契约型<br>开放式 | 73,344,99<br>6.75 | 72,692,22<br>6.28 | 5.47 | 是 |
| 7  | 004994 | 中欧可转债债券C         | 契约型<br>开放式 | 43,952,36<br>6.32 | 62,280,50<br>3.08 | 4.69 | 是 |
| 8  | 166009 | 中欧新动力混合 (LOF) A  | 契约型<br>开放式 | 12,351,38<br>3.44 | 43,809,12<br>1.92 | 3.30 | 是 |
| 9  | 001000 | 中欧明睿新起点混合        | 契约型<br>开放式 | 17,439,50<br>3.70 | 43,459,24<br>3.22 | 3.27 | 是 |
| 10 | 159949 | 创业板50            | 契约型<br>开放式 | 28,000,00<br>0.00 | 43,120,00<br>0.00 | 3.25 | 否 |
| 11 | 511010 | 国债ETF            | 交易型<br>开放式 | 329,100.0<br>0    | 40,651,41<br>9.30 | 3.06 | 否 |
| 12 | 004455 | 中欧康裕混合C          | 契约型<br>开放式 | 26,093,98<br>2.17 | 35,153,81<br>2.78 | 2.65 | 是 |
| 13 | 002685 | 中欧丰泓沪港深灵活配置混合A   | 契约型<br>开放式 | 16,655,25<br>1.59 | 31,694,94<br>3.78 | 2.39 | 是 |
| 14 | 166001 | 中欧新趋势混合 (LOF) A  | 契约型<br>开放式 | 16,217,80<br>0.12 | 28,616,30<br>8.31 | 2.15 | 是 |
| 15 | 512880 | 证券ETF            | 交易型<br>开放式 | 24,810,00<br>0.00 | 27,514,29<br>0.00 | 2.07 | 否 |
| 16 | 002010 | 中欧瑾通灵活配置混合C      | 契约型<br>开放式 | 19,572,33<br>0.52 | 26,162,33<br>4.21 | 1.97 | 是 |
| 17 | 000032 | 易方达信用            | 契约型        | 20,166,29         | 22,400,72         | 1.69 | 否 |

|    |        |              |            |                   |                   |      |   |
|----|--------|--------------|------------|-------------------|-------------------|------|---|
|    |        | 债债券A         | 开放式        | 9.19              | 5.14              |      |   |
| 18 | 001955 | 中欧养老混合A      | 契约型<br>开放式 | 7,831,78<br>6.17  | 20,918,70<br>0.86 | 1.57 | 是 |
| 19 | 512660 | 军工ETF        | 交易型<br>开放式 | 17,430,00<br>0.00 | 20,079,36<br>0.00 | 1.51 | 否 |
| 20 | 166019 | 中欧价值智选混合A    | 契约型<br>开放式 | 4,075,22<br>5.65  | 19,925,81<br>5.82 | 1.50 | 是 |
| 21 | 166005 | 中欧价值发现混合A    | 契约型<br>开放式 | 9,018,06<br>7.41  | 18,672,81<br>0.38 | 1.41 | 是 |
| 22 | 166002 | 中欧新蓝筹混合A     | 契约型<br>开放式 | 7,852,84<br>7.29  | 17,379,13<br>6.34 | 1.31 | 是 |
| 23 | 000015 | 华夏纯债债券A      | 契约型<br>开放式 | 13,600,23<br>2.62 | 16,646,68<br>4.73 | 1.25 | 否 |
| 24 | 233005 | 大摩强收益债券      | 契约型<br>开放式 | 7,842,77<br>8.60  | 11,942,19<br>8.97 | 0.90 | 否 |
| 25 | 000762 | 汇添富绝对收益定开混合A | 契约型<br>开放式 | 7,971,00<br>7.25  | 11,510,13<br>4.47 | 0.87 | 否 |
| 26 | 000024 | 大摩双利增强债券A    | 契约型<br>开放式 | 9,609,97<br>8.34  | 11,243,67<br>4.66 | 0.85 | 否 |
| 27 | 519723 | 交银双轮动债券A     | 契约型<br>开放式 | 10,336,06<br>6.64 | 11,012,04<br>5.40 | 0.83 | 否 |
| 28 | 002521 | 永赢双利债券A      | 契约型<br>开放式 | 7,762,15<br>9.43  | 9,871,13<br>8.15  | 0.74 | 否 |
| 29 | 968000 | 摩根亚洲债券人民币累计  | 契约型<br>开放式 | 600,881.4<br>1    | 8,214,04<br>8.87  | 0.62 | 否 |
| 30 | 001165 | 中欧琪和灵活配置混合C  | 契约型<br>开放式 | 5,361,63<br>4.30  | 6,467,73<br>9.46  | 0.49 | 是 |
| 31 | 001963 | 中欧天禧债券       | 契约型<br>开放式 | 4,295,53<br>2.65  | 4,792,09<br>6.22  | 0.36 | 是 |
| 32 | 511990 | 华宝添益         | 契约型        | 6.00              | 599.96            | 0.00 | 否 |

|  |  |  |     |  |  |  |  |
|--|--|--|-----|--|--|--|--|
|  |  |  | 开放式 |  |  |  |  |
|--|--|--|-----|--|--|--|--|

### 7.13 投资组合报告附注

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

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

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 66,200.25    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,000,000.00 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 938,714.73   |
| 5  | 应收申购款   | 4,986,146.87 |
| 6  | 其他应收款   | 40,942.09    |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 8,032,003.94 |

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 113043 | 财通转债 | 16,963,710.00 | 1.28         |
| 2  | 110073 | 国投转债 | 13,945,213.70 | 1.05         |
| 3  | 127005 | 长证转债 | 9,974,471.00  | 0.75         |
| 4  | 110067 | 华安转债 | 5,430,081.00  | 0.41         |
| 5  | 128048 | 张行转债 | 5,260,800.00  | 0.40         |

|   |        |      |              |      |
|---|--------|------|--------------|------|
| 6 | 128134 | 鸿路转债 | 3,397,084.74 | 0.26 |
|---|--------|------|--------------|------|

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 600905 | 三峡能源 | 5,147,016.21 | 0.39         | 新股流通受限   |

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |        |                |         |
|----------------------|----------|-----------|-------|--------|----------------|---------|
|                      |          |           | 机构投资者 |        | 个人投资者          |         |
|                      |          |           | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例  |
| 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A | 67,407   | 10,560.34 | 0.00  | 0.00%  | 711,840,633.69 | 100.00% |
| 中欧预见养老2              | 9,506    | 9,229.48  | 0.00  | 0.00%  | 87,735,469.68  | 100.00% |

|               |        |           |      |       |                |         |
|---------------|--------|-----------|------|-------|----------------|---------|
| 035三年持有（FOF）C |        |           |      |       |                |         |
| 合计            | 76,913 | 10,395.85 | 0.00 | 0.00% | 799,576,103.37 | 100.00% |

## 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 |
|------------------|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A | 4,017,295.71 | 0.56%    |
|                  | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C | 1,103.96     | 0.00%    |
|                  | 合计                   | 4,018,399.67 | 0.50%    |

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金C份额实际比例为0.0013%。上表中的份额占比是经过四舍五入的结果。

## 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 | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A | >100              |
|                                | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C | 0                 |
|                                | 合计                   | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）A | 10~50             |
|                                | 中欧预见养老2035三年持有（FOF）C | 0                 |
|                                | 合计                   | 10~50             |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 中欧预见养老2035三年<br>持有（FOF）A | 中欧预见养老2035三年<br>持有（FOF）C |
|----------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 基金合同生效日(2018年10月10日)基金份额总额 | 289,773,226.94           | 32,048,456.71            |
| 本报告期期初基金份额总额               | 642,823,580.02           | 82,147,751.83            |
| 本报告期基金总申购份额                | 69,017,053.67            | 5,587,717.85             |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | —                        | —                        |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —                        | —                        |
| 本报告期期末基金份额总额               | 711,840,633.69           | 87,735,469.68            |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生的重大影响事件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 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 |    |
| 国都证券 | 1      | 101,123,829.96 | 69.52%       | 94,175.22 | 69.52%     | —  |
| 海通证券 | 1      | 44,339,265.36  | 30.48%       | 41,293.15 | 30.48%     | —  |

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

#### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              | 基金交易           |              |
|------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|----------------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国都证券 | 182,205,515.25 | 89.53%       | 998,600,000.00 | 100.00%        | —    | —            | 119,583,508.93 | 77.13%       |
| 海通证券 | 21,312,977.81  | 10.47%       | —              | —              | —    | —            | 35,462,911.11  | 22.87%       |

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                        | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|---------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）2020年第四季度报告 | 中国证监会指定媒介 | 2021-01-22 |
| 2  | 中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）2020年年度报告   | 中国证监会指定媒介 | 2021-03-31 |
| 3  | 中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）2021年第一季度报告 | 中国证监会指定媒介 | 2021-04-22 |

## § 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、中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）相关批准文件
- 2、《中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- 3、《中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
- 4、《中欧预见养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日