

中欧价值智选回报混合型证券投资基金

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:中国工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。

基金托管人中国工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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
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	53
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	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

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	68
§9 开放式基金份额变动	68
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧价值智选回报混合型证券投资基金		
基金简称	中欧价值智选混合		
基金主代码	166019		
基金运作方式	契约型、开放式		
基金合同生效日	2013年05月14日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,799,288,987.04份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧价值智选混合A	中欧价值智选混合E	中欧价值智选混合C
下属分级基金的交易代码	166019	001887	004235
报告期末下属分级基金的份额总额	1,241,680,563.91份	77,625,507.45份	479,982,915.68份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采取积极主动的资产配置策略，投资于价值型上市公司股票或固定收益类资产，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	黎忆海	郭明

露负责人	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司；C、E类份额：中欧基金管理有限公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号；C、E类份额：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§ 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)
---------------	----------------------------------

	中欧价值智选混 合A	中欧价值智选混 合E	中欧价值智选混 合C
本期已实现收益	100,407,381.47	9,618,161.34	21,622,111.89
本期利润	534,248,792.44	47,058,368.36	137,396,975.25
加权平均基金份额本期 利润	0.8861	0.9924	0.8268
本期加权平均净值利润 率	19.29%	19.70%	18.58%
本期基金份额净值增长 率	32.50%	32.49%	31.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)		
期末可供分配利润	3,169,784,979.94	211,398,862.89	1,151,086,952.46
期末可供分配基金份额 利润	2.5528	2.7233	2.3982
期末基金资产净值	6,071,248,854.79	418,850,933.84	2,243,923,505.16
期末基金份额净值	4.8895	5.3958	4.6750
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)		
基金份额累计净值增长 率	476.12%	251.74%	169.17%

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、所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

中欧价值智选混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.61%	0.69%	0.23%	0.01%	2.38%	0.68%
过去三个月	9.45%	0.75%	0.69%	0.01%	8.76%	0.74%
过去六个月	32.50%	1.20%	1.36%	0.01%	31.14%	1.19%
过去一年	81.78%	1.26%	2.75%	0.01%	79.03%	1.25%
过去三年	191.91%	1.45%	8.25%	0.01%	183.6 6%	1.44%
自基金合同 生效起至今	476.12%	1.48%	25.40%	0.01%	450.7 2%	1.47%

中欧价值智选混合E

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.61%	0.69%	0.23%	0.01%	2.38%	0.68%
过去三个月	9.45%	0.75%	0.69%	0.01%	8.76%	0.74%
过去六个月	32.49%	1.20%	1.36%	0.01%	31.13%	1.19%
过去一年	81.77%	1.26%	2.75%	0.01%	79.02%	1.25%
过去三年	192.74%	1.45%	8.25%	0.01%	184.4 9%	1.44%
自基金份额 运作日至今	251.74%	1.39%	15.87%	0.01%	235.8 7%	1.38%

中欧价值智选混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.54%	0.69%	0.23%	0.01%	2.31%	0.68%

过去三个月	9.23%	0.75%	0.69%	0.01%	8.54%	0.74%
过去六个月	31.99%	1.20%	1.36%	0.01%	30.63%	1.19%
过去一年	80.36%	1.26%	2.75%	0.01%	77.61%	1.25%
过去三年	184.97%	1.46%	8.25%	0.01%	176.72%	1.45%
自基金份额 运作日至今	169.17%	1.30%	12.22%	0.01%	156.95%	1.29%

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

中欧价值智选混合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

(2013年05月14日-2021年06月30日)



中欧价值智选混合E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年09月25日-2021年06月30日)



注：本基金于 2015 年 9 月 22 日新增 E 类份额。图示日期为 2015 年 9 月 25 日至 2021 年 06 月 30 日。

中欧价值智选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月20日-2021年06月30日)



注：本基金自 2017 年 1 月 19 日起增加 C 份额，图示为 2017 年 1 月 20 日至 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		
袁维德	基金经理	2020-05-15	-	9年	历任新华基金行业研究员。2015/07/24加入中欧基金管理有限公司, 历任研究员。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

我们对价值的理解包括两个方面：“价”代表估值，“值”代表质量。其中，估值不仅是预期回报率的呈现，也包含了为了取得潜在的回报所需要承受的波动，考虑到A股权益市场相对较高的波动水平以及今年以来流动性边际趋紧的宏观环境，我们对估值的要求会更加严格。今年一季度以来，我们减持了一些短期估值涨幅过高的周期类龙头，利用年初小市值公司集体下跌的机会增加了一些跌幅较大、估值合理，具备突出成长性的优质传媒、医药公司的比例，进一步使组合的行业分布更加分散，降低了一部分对宏观的暴露度，二季度相比一季度的组合结构没有显著变化，下半年随着各种行业、各种属性的公司估值越来越均衡，将进一步平衡组合的结构，自下而上精选各种类型资产中最优质的公司。行业配置上目前以银行、轻工、传媒、汽车、地产、医药和各种优质制造业公司为主。

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32.50%，同期业绩比较基准收益率为1.36%；E类份额净值增长率为32.49%，同期业绩比较基准收益率为1.36%；C类份额净值增长率为31.99%，同期业绩比较基准收益率为1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年二季度，海外国家疫情再次出现反复，经济复苏的趋势稍有受阻，长端利率有所回落。国内PMI和社融依然维持较高水平，但有边际向下的趋势，国内利率也有所下行。在这种市场环境下，以医药、消费、新兴产业为代表的非周期类资产二季度表现较好，估值不断上行。

当前，中国的股票市场存在很多无名之璞，他们分布在各行各业，其中不乏细分行业龙头，在过去两年的市场环境中，尽管很多公司依靠自身积累努力实现了较好的增长，但估值一路下滑，很多公司估值已经低于18年水平，但很多公司已经逐渐形成了自己技术或成本上的壁垒，在当期的时点上具备了较高的投资价值。二季度以来，很多盈利质量高，长期再投资能力确定的公司实现了一定的涨幅，估值有所修复，但目前依然有很多盈利质量好，公司治理佳，分红率高的传统行业优质公司处于较为低估的水平之上。整体上此类资产依然存在较高的长期投资价值。此外，一些中游制造业、下游消费行业的优质大市值龙头公司因为短期景气下降，二季度出现较大跌幅，下半年可能将出现较好的长期投资时点。

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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧价值智选回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧价值智选回报混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧价值智选回报混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧价值智选回报混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中欧价值智选回报混合型证券投资基金

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	922,998,540.14	28,628,244.73
结算备付金		44,266,529.80	1,728,098.10
存出保证金		139,982,456.62	122,297.41
交易性金融资产	6.4.7.2	7,804,426,483.84	506,773,446.10
其中：股票投资		7,707,553,288.34	506,773,446.10
基金投资		—	—
债券投资		96,873,195.50	—
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		-	17,057,555.06
应收利息	6.4.7.5	219,906.43	4,241.68
应收股利		-	-
应收申购款		141,042,199.64	1,059,172.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,052,936,116.47	555,373,055.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		282,531,535.58	5,117,468.05
应付赎回款		18,746,581.60	1,020,972.86
应付管理人报酬		9,168,537.01	683,748.47
应付托管费		1,528,089.51	113,958.07
应付销售服务费		1,167,041.33	27,145.97
应付交易费用	6.4.7.7	5,436,211.41	586,778.74
应交税费		204,782.20	203,602.83
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,044.04	62,026.73
负债合计		318,912,822.68	7,815,701.72
所有者权益:			

实收基金	6.4.7.9	1,799,288,987.04	147,500,499.09
未分配利润	6.4.7.10	6,934,734,306.75	400,056,854.69
所有者权益合计		8,734,023,293.79	547,557,353.78
负债和所有者权益总计		9,052,936,116.47	555,373,055.50

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额1,799,288,987.04份，其中A类基金份额参考净值4.8895元，基金份额1,241,680,563.91份；C类基金份额参考净值4.6750元，基金份额479,982,915.68份；E类基金份额参考净值5.3958元，基金份额77,625,507.45份。

6.2 利润表

会计主体：中欧价值智选回报混合型证券投资基金

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 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		764,821,850.77	34,230,084.03
1. 利息收入		925,776.07	274,929.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	742,621.35	106,111.35
债券利息收入		183,154.72	63,672.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	105,145.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		173,490,467.04	41,470,970.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	71,470,906.94	39,491,759.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,521,379.96	274,969.78

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	6,283,683.49	-
股利收益	6.4.7.15	86,214,496.65	1,704,240.93
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	587,056,481.35	-7,772,525.12
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	3,349,126.31	256,709.28
减：二、费用		46,117,714.72	4,680,579.47
1. 管理人报酬		27,323,392.32	1,543,390.66
2. 托管费		4,553,898.66	257,231.85
3. 销售服务费		2,870,303.11	27,498.20
4. 交易费用	6.4.7.18	11,219,257.23	2,743,525.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		34,332.84	1.21
7. 其他费用	6.4.7.19	116,530.56	108,931.60
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		718,704,136.05	29,549,504.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		718,704,136.05	29,549,504.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧价值智选回报混合型证券投资基金

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
-----	----

	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 (基金净值)	147,500,499.09	400,056,854.69	547,557,353.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	718,704,136.05	718,704,136.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,651,788,487.95	5,815,973,316.01	7,467,761,803.96
其中: 1. 基金申购款	1,966,346,869.79	6,927,726,355.33	8,894,073,225.12
2. 基金赎回款	-314,558,381.84	-1,111,753,039.32	-1,426,311,421.16
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)	1,799,288,987.04	6,934,734,306.75	8,734,023,293.79
项 目	上年度可比期间 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 (基金净值)	94,559,533.83	124,499,951.60	219,059,485.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,549,504.56	29,549,504.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-21,346,161.92	-30,063,232.19	-51,409,394.11

“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	52,183,568.83	81,734,573.89	133,918,142.72
2. 基金赎回款	-73,529,730.75	-111,797,806.08	-185,327,536.83
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)	73,213,371.91	123,986,223.97	197,199,595.88

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

中欧价值智选回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第259号《关于核准中欧价值智选回报混合型证券投资基金募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集476,323,264.11元。经向中国证监会备案,《中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金合同》于2013年5月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为476,420,551.02份基金份额,其中认购资金利息折合97,286.91份基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定,为满足投资者的理财需求,经征托管人中国工商银行股份有限公司同意并报中国证监会备案,本基金管理人决定自2017年1月19日起增加本基金的场外C类基金份额类别并相应修改基金合同、托管协议。本基金根据注册登记机构或申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,A类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算

有限责任公司，C类和E类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等固定收益类资产（固定收益类资产包括通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等），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相关规定）。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）。

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>》及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06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

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 2021年06月30日
活期存款	922,998,540.14
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	922,998,540.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,060,115,966.80	7,707,553,288.34	647,437,321.54
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	84,605,149.44	96,873,195.50	12,268,046.06
	银行间市场	—	—	—
	合计	84,605,149.44	96,873,195.50	12,268,046.06

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,144,721,116.24	7,804,426,483.84	659,705,367.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,122,006,120.00	-	-	-
——股指期货	1,122,006,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,122,006,120.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

本期末 2021 年 6 月 30 日					
代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2109	IF2109	-697	-1,080,294,240.00	-35,138,700.00	套保
IF2112	IF2112	-50	-77,103,000.00	-252,420.00	套保

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	61,953.04
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	64,569.39
应收债券利息	92,891.40
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	492.60
合计	219,906.43

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	5,436,211.41
银行间市场应付交易费用	—
合计	5,436,211.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,269.25
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	37,191.88
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出费	12.85
应付转出补差费	62.69
合计	130,044.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合A)	本期 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	122,504,760.59	122,504,760.59
本期申购	1,290,233,666.29	1,290,233,666.29
本期赎回（以“-”号填列）	-171,057,862.97	-171,057,862.97
本期末	1,241,680,563.91	1,241,680,563.91

金额单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合E)	本期 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	13,088,272.57	13,088,272.57
本期申购	81,219,562.54	81,219,562.54
本期赎回（以“-”号填列）	-16,682,327.66	-16,682,327.66
本期末	77,625,507.45	77,625,507.45

金额单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合C)	本期 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	11,907,465.93	11,907,465.93
本期申购	594,893,640.96	594,893,640.96
本期赎回（以“-”号填列）	-126,818,191.21	-126,818,191.21
本期末	479,982,915.68	479,982,915.68

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 中欧价值智选混合A

单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	277,440,652.34	52,133,904.24	329,574,556.58
本期利润	100,407,381.47	433,841,410.97	534,248,792.44
本期基金份额交易产生的变动数	2,791,936,946.13	1,173,807,995.73	3,965,744,941.86
其中：基金申购款	3,218,092,013.27	1,358,142,382.64	4,576,234,395.91
基金赎回款	-426,155,067.14	-184,334,386.91	-610,489,454.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,169,784,979.94	1,659,783,310.94	4,829,568,290.88

6.4.7.10.2 中欧价值智选混合E

单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,484,616.16	8,729,360.31	40,213,976.47
本期利润	9,618,161.34	37,440,207.02	47,058,368.36

本期基金份额交易产生的变动数	170,296,085.39	83,656,996.17	253,953,081.56
其中：基金申购款	214,710,486.79	107,101,766.50	321,812,253.29
基金赎回款	-44,414,401.40	-23,444,770.33	-67,859,171.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	211,398,862.89	129,826,563.50	341,225,426.39

6.4.7.10.3 中欧价值智选混合C

单位：人民币元

项目 (中欧价值智选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,462,126.35	4,806,195.29	30,268,321.64
本期利润	21,622,111.89	115,774,863.36	137,396,975.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,104,002,714.22	492,272,578.37	1,596,275,292.59
其中：基金申购款	1,402,968,270.75	626,711,435.38	2,029,679,706.13
基金赎回款	-298,965,556.53	-134,438,857.01	-433,404,413.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,151,086,952.46	612,853,637.02	1,763,940,589.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	455,004.37
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	207,823.17
其他	79,793.81
合计	742,621.35

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,507,645,027.33
减：卖出股票成本总额	1,436,174,120.39
买卖股票差价收入	71,470,906.94

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 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	9,521,379.96
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	9,521,379.96

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	114,780,601.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	105,116,831.27
减：应收利息总额	142,390.39
买卖债券差价收入	9,521,379.96

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	6,564,300.00
减：期货投资差价收入增值税抵减	280,616.51
合计	6,283,683.49

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	86,214,496.65
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	86,214,496.65

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	622,447,601.35
——股票投资	610,179,555.29
——债券投资	12,268,046.06
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—

2. 衍生工具	-35,391,120.00
——权证投资	—
——期货投资	-35,391,120.00
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	587,056,481.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	3,300,890.97
转换费收入	48,235.34
合计	3,349,126.31

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	11,179,288.77
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	39,968.46
合计	11,219,257.23

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	—
汇划手续费	1,231.31
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	116,530.56

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，本基金无其他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
中国工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
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	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	-	-	435,151.00	0.02%

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

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	405.28	0.02%	-	-

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、经手费后的净额列示。

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 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	27,323,392.32	1,543,390.66
其中：支付销售机构的客户维护费	4,754,451.43	304,836.49

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 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	4,553,898.66	257,231.85

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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 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			
	中欧价值智选混 合A	中欧价值智选混 合E	中欧价值智选混 合C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
国都证券	0.00	0.00	6,174.14	6,174.14
中欧基金	0.00	0.00	737,137.44	737,137.44
合计	0.00	0.00	743,311.58	743,311.58
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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			
	中欧价值智选混 合A	中欧价值智选混 合E	中欧价值智选混 合C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
国都证券	0.00	0.00	3,547.78	3,547.78
中欧基金	0.00	0.00	2,866.38	2,866.38
合计	0.00	0.00	6,414.16	6,414.16

注：本基金A类、E类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.80%，销售服务费按照前一日C类基金份额的基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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 3 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。基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

中欧价值智选混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中欧价值智选混合E

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中欧价值智选混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	86,365.73
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	86,365.73
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

中欧价值智选混合A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 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	520.37	0.00%	0.00	0.00%
-------	--------	-------	------	-------

中欧价值智选混合E

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 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	5,644.37	0.01%	343,592.21	2.63%

中欧价值智选混合C

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 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	68,360.29	0.01%	0.00	0.00%

注：

- 1、本报告期末自然人股东持有本基金实际占比为0.00004%，上述展示系四舍五入的结果。
- 2、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。

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 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
中国工商银行股份有限公司	922,998,540.14	455,004.37	13,786,022.19	79,342.91

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

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有中国工商银行发行的同业存单。

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	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
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	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	新股流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-

300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	601	14,784.60	97,963.00	-
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	新股流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
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	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股流通受限	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
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	-

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	-
688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
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	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
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	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
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	-

3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	新股 流通 受限	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 55	嘉亨 家化	2021 -03- 16	2021 -09- 24	新股 流通 受限	16.5 3	46.0 7	232	3,83 4.96	10,6 88.2 4	-
3009 96	普联 软件	2021 -05- 26	2021 -12- 03	新股 流通 受限	20.8 1	42.2 3	241	5,01 5.21	10,1 77.4 3	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	新股 流通 受限	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	新股 流通 受限	11.7 2	27.0 8	340	3,98 4.80	9,20 7.20	-
3010 16	雷尔 伟	2021 -06- 23	2021 -12- 30	新股 流通 受限	13.7 5	32.9 8	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	新股 流通 受限	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021 -02- 18	2021 -08- 25	新股 流通 受限	8.67	27.4 2	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-
3009 31	通用 电梯	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 流通 受限	4.31	13.1 1	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-

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	-

3010 04	嘉益 股份	2021 -06- 18	2021 -12- 27	新股 流通 受限	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	新股 流通 受限	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 流通 受限	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	新股 流通 受限	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	新股 流通 受限	5.48	13.0 3	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	新股 流通 受限	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	新股 流通 受限	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3009 43	春晖 智控	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	9.79	23.0 1	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
3009 67	晓鸣 股份	2021 -04- 02	2021 -10- 13	新股 流通 受限	4.54	11.5 4	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	新股 流通 受限	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 29	华骐 环保	2021 -01- 12	2021 -07- 21	新股 流通 受限	13.8 7	29.5 5	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-

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	-

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注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 2021年06 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	922,998,540.14	-	-	-	922,998,540.14
结算备付金	44,266,529.80	-	-	-	44,266,529.80
存出保证金	139,982,456.62	-	-	-	139,982,456.62
交易性金融资产	-	96,873,195.50	-	7,707,553,288.34	7,804,426,483.84
应收利息	-	-	-	219,906.43	219,906.43
应收申购款	31,000,000.00	-	-	110,042,199.64	141,042,199.64
资产总计	1,138,247,526.56	96,873,195.50	-	7,817,815,394.41	9,052,936,116.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	282,531,535.58	282,531,535.58
应付赎回款	-	-	-	18,746,581.60	18,746,581.60
应付管理人报酬	-	-	-	9,168,537.01	9,168,537.01
应付托管费	-	-	-	1,528,089.51	1,528,089.51
应付销售服务费	-	-	-	1,167,041.33	1,167,041.33
应付交易费用	-	-	-	5,436,211.41	5,436,211.41
应交税费	-	-	-	204,782.20	204,782.20
其他负债	-	-	-	130,044.04	130,044.04
负债总计	-	-	-	318,912,822.68	318,912,822.68
利率敏感度缺口	1,138,247,526.56	96,873,195.50	-	7,498,902,571.73	8,734,023,293.79
上年度末 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	28,628,244.73	-	-	-	28,628,244.73
结算备付金	1,728,098.10	-	-	-	1,728,098.10
存出保证金	122,297.41	-	-	-	122,297.41
交易性金融资产	-	-	-	506,773,446.10	506,773,446.10
应收证券清算款	-	-	-	17,057,555.06	17,057,555.06
应收利息	-	-	-	4,241.68	4,241.68
应收申购款	-	-	-	1,059,172.42	1,059,172.42
资产总计	30,478,640.24	-	-	524,894,415.26	555,373,055.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,117,468.05	5,117,468.05
应付赎回款	-	-	-	1,020,972.86	1,020,972.86
应付管理人报酬	-	-	-	683,748.47	683,748.47
应付托管费	-	-	-	113,958.07	113,958.07
应付销售服务费	-	-	-	27,145.97	27,145.97
应付交易费用	-	-	-	586,778.74	586,778.74
应交税费	-	-	-	203,602.83	203,602.83
其他负债	-	-	-	62,026.73	62,026.73
负债总计	-	-	-	7,815,701.72	7,815,701.72
利率敏感度缺口	30,478,640.24	-	-	517,078,713.54	547,557,353.78

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1.11%(2020年12月31日:0.00%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,707,553,288.34	88.25	506,773,446.10	92.55
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	7,707,553,288.34	88.25	506,773,446.10	92.55

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	12,934,910,564.95	1,420,129,713.52
	2. 业绩比较基准下降5%	-12,934,910,564.95	-1,420,129,713.52

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7,796,959,992.14元，属于第二层次的余额为7,466,491.7元，第三层次的余额为0.00元(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币500,209,323.56元，属于第二层次的余额为人民币6,564,122.54元，属于第三层次的余额为0.00元。)。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于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	7,707,553,288.34	85.14
	其中：股票	7,707,553,288.34	85.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	96,873,195.50	1.07
	其中：债券	96,873,195.50	1.07
	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	967,265,069.94	10.68
8	其他各项资产	281,244,562.69	3.11
9	合计	9,052,936,116.47	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	611,087,223.51	7.00
C	制造业	4,513,705,906.57	51.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,981,664.76	0.58
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	77,548,951.56	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	743,671,009.80	8.51
J	金融业	1,379,102,620.02	15.79
K	房地产业	3,415,637.00	0.04
L	租赁和商务服务业	162,167,158.08	1.86
M	科学研究和技术服务业	62,630,066.60	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	351,806.33	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	102,854,582.46	1.18
S	综合	-	-
	合计	7,707,553,288.34	88.25

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600036	招商银行	14,989,766	812,295,419.54	9.30
2	603444	吉比特	1,402,851	743,511,030.00	8.51
3	002318	久立特材	44,832,440	538,885,928.80	6.17
4	002142	宁波银行	13,712,818	534,388,517.46	6.12
5	688198	佰仁医疗	1,427,528	325,476,384.00	3.73
6	002048	宁波华翔	13,715,542	267,453,069.00	3.06
7	601311	骆驼股份	21,035,206	243,377,333.42	2.79
8	600346	恒力石化	8,740,288	229,345,157.12	2.63
9	002088	鲁阳节能	9,195,038	211,393,923.62	2.42
10	002884	凌霄泵业	8,629,912	200,990,650.48	2.30

11	300587	天铁股份	8,113,889	182,156,808.05	2.09
12	000983	山西焦煤	21,705,615	180,373,660.65	2.07
13	600188	兖州煤业	11,625,691	178,570,613.76	2.04
14	601666	平煤股份	23,755,860	168,904,164.60	1.93
15	600884	杉杉股份	7,092,918	165,406,847.76	1.89
16	605168	三人行	1,057,428	162,167,158.08	1.86
17	603326	我乐家居	14,757,899	159,237,730.21	1.82
18	603008	喜临门	4,226,723	139,524,126.23	1.60
19	601677	明泰铝业	6,758,695	132,132,487.25	1.51
20	002493	荣盛石化	7,241,026	125,052,519.02	1.43
21	603313	梦百合	3,902,930	117,283,046.50	1.34
22	600166	福田汽车	32,556,520	112,319,994.00	1.29
23	605099	共创草坪	2,504,300	106,132,234.00	1.22
24	603096	新经典	3,099,897	102,854,582.46	1.18
25	300870	欧陆通	1,441,735	90,137,272.20	1.03
26	002398	垒知集团	12,222,121	87,143,722.73	1.00
27	688093	世华科技	2,191,221	87,122,946.96	1.00
28	688056	莱伯泰科	1,225,037	84,037,538.20	0.96
29	000030	富奥股份	13,191,342	84,028,848.54	0.96
30	601225	陕西煤业	7,024,370	83,238,784.50	0.95
31	603108	润达医疗	6,876,242	77,220,197.66	0.88
32	300833	浩洋股份	1,426,841	74,366,952.92	0.85
33	300853	申昊科技	1,902,978	73,074,355.20	0.84
34	603757	大元泵业	3,213,323	63,816,594.78	0.73
35	300232	洲明科技	6,743,842	60,222,509.06	0.69
36	601968	宝钢包装	6,000,505	57,364,827.80	0.66
37	000488	晨鸣纸业	5,811,699	47,307,229.86	0.54
38	600116	三峡水利	5,481,056	45,821,628.16	0.52
39	002960	青鸟消防	1,698,254	44,426,324.64	0.51
40	300073	当升科技	775,800	43,592,202.00	0.50
41	002832	比音勒芬	1,610,210	41,205,273.90	0.47

42	603700	宁水集团	1,557,426	37,674,134.94	0.43
43	601058	赛轮轮胎	3,756,000	37,522,440.00	0.43
44	002949	华阳国际	2,019,434	34,128,434.60	0.39
45	603678	火炬电子	493,200	33,291,000.00	0.38
46	603699	纽威股份	3,055,260	32,080,230.00	0.37
47	603267	鸿远电子	233,000	29,805,360.00	0.34
48	601965	中国汽研	1,649,400	28,501,632.00	0.33
49	002028	思源电气	855,605	26,344,077.95	0.30
50	002947	恒铭达	818,320	22,094,640.00	0.25
51	601208	东材科技	1,304,200	21,284,544.00	0.24
52	601658	邮储银行	3,698,600	18,566,972.00	0.21
53	002381	双箭股份	2,239,100	18,405,402.00	0.21
54	002036	联创电子	922,000	12,124,300.00	0.14
55	002045	国光电器	807,100	10,040,324.00	0.11
56	300806	斯迪克	185,180	8,777,532.00	0.10
57	601166	兴业银行	359,200	7,381,560.00	0.08
58	688157	松井股份	51,708	6,445,919.28	0.07
59	600019	宝钢股份	680,141	5,196,277.24	0.06
60	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.06
61	601601	中国太保	144,000	4,171,680.00	0.05
62	000932	华菱钢铁	548,395	3,619,407.00	0.04
63	002637	赞宇科技	226,600	3,464,714.00	0.04
64	300920	润阳科技	85,794	2,889,541.92	0.03
65	601155	新城控股	64,968	2,702,668.80	0.03
66	603788	宁波高发	92,058	1,163,613.12	0.01
67	601838	成都银行	75,384	952,853.76	0.01
68	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.01
69	300737	科顺股份	22,400	704,256.00	0.01
70	603950	长源东谷	27,900	520,056.00	0.01
71	603156	养元饮品	15,993	457,079.94	0.01
72	601288	农业银行	144,000	436,320.00	0.00

73	000961	中南建设	71,785	424,967.20	0.00
74	601318	中国平安	6,347	407,985.16	0.00
75	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
76	000651	格力电器	6,200	323,020.00	0.00
77	300816	艾可蓝	3,600	307,368.00	0.00
78	000001	平安银行	11,900	269,178.00	0.00
79	603626	科森科技	29,101	264,819.10	0.00
80	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
81	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
82	002601	龙鳞佰利	6,983	241,472.14	0.00
83	600984	建设机械	20,200	216,342.00	0.00
84	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
85	601336	新华保险	4,300	197,413.00	0.00
86	603997	继峰股份	21,000	172,620.00	0.00
87	000933	神火股份	16,355	154,554.75	0.00
88	600048	保利地产	12,100	145,684.00	0.00
89	000736	中交地产	22,590	142,317.00	0.00
90	600585	海螺水泥	3,300	135,465.00	0.00
91	603816	顾家家居	1,743	134,699.04	0.00
92	000581	威孚高科	6,400	133,312.00	0.00
93	601877	正泰电器	3,800	126,844.00	0.00
94	688519	南亚新材	3,109	117,395.84	0.00
95	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
96	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
97	002084	海鸥住工	21,185	114,187.15	0.00
98	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
99	300919	中伟股份	601	97,963.00	0.00
100	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.00
101	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.00
102	600309	万华化学	800	87,056.00	0.00
103	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00

104	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
105	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
106	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
107	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
108	002572	索菲亚	2,700	65,340.00	0.00
109	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
110	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
111	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
112	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
113	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
114	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
115	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
116	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
117	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
118	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
119	300703	创源股份	3,700	37,592.00	0.00
120	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
121	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
122	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
123	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
124	000910	大亚圣象	2,200	26,136.00	0.00
125	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
126	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
127	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
128	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
129	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
130	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
131	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
132	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
133	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
134	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00

135	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
136	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
137	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
138	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
139	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
140	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
141	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
142	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
143	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
144	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
145	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
146	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
147	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
148	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
149	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
150	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
151	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
152	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
153	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
154	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
155	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
156	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
157	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
158	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
159	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
160	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
161	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
162	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
163	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
164	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
165	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

166	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
167	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
168	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
169	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
170	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
171	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
172	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
173	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
174	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
175	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
176	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
177	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
178	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	600036	招商银行	814,137,076.20	148.69
2	002318	久立特材	571,328,995.10	104.34
3	603444	吉比特	545,303,907.82	99.59
4	002142	宁波银行	531,224,958.38	97.02
5	000488	晨鸣纸业	393,904,202.86	71.94
6	002048	宁波华翔	238,455,002.89	43.55
7	601311	骆驼股份	236,374,569.67	43.17
8	600346	恒力石化	232,958,874.47	42.55
9	688198	佰仁医疗	182,566,024.83	33.34
10	002884	凌霄泵业	178,256,609.00	32.55
11	601666	平煤股份	169,509,006.02	30.96
12	000983	山西焦煤	168,420,793.29	30.76

13	603326	我乐家居	167,205,270.19	30.54
14	600188	兖州煤业	162,213,280.36	29.62
15	002088	鲁阳节能	150,496,701.59	27.49
16	601155	新城控股	149,476,107.70	27.30
17	600884	杉杉股份	146,489,613.42	26.75
18	002078	太阳纸业	146,088,359.27	26.68
19	605168	三人行	133,600,684.34	24.40
20	300587	天铁股份	132,917,505.26	24.27
21	002493	荣盛石化	129,862,243.31	23.72
22	600166	福田汽车	128,503,772.00	23.47
23	603313	梦百合	117,569,476.72	21.47
24	605099	共创草坪	108,311,652.62	19.78
25	002068	黑猫股份	105,810,274.00	19.32
26	603096	新经典	105,805,195.18	19.32
27	601677	明泰铝业	101,055,803.96	18.46
28	000030	富奥股份	95,448,500.40	17.43
29	000932	华菱钢铁	94,406,530.25	17.24
30	002398	垒知集团	87,610,928.77	16.00
31	603108	润达医疗	81,218,738.02	14.83
32	601225	陕西煤业	81,145,770.18	14.82
33	603008	喜临门	76,925,638.79	14.05
34	300870	欧陆通	72,351,581.45	13.21
35	300853	申昊科技	69,156,709.44	12.63
36	300833	浩洋股份	66,406,884.38	12.13
37	603699	纽威股份	65,951,067.78	12.04
38	688056	莱伯泰科	63,986,474.01	11.69
39	603757	大元泵业	63,842,013.58	11.66
40	300232	洲明科技	62,887,384.56	11.49
41	688093	世华科技	62,839,919.42	11.48
42	002960	青鸟消防	61,489,141.30	11.23
43	603700	宁水集团	58,655,694.70	10.71

44	601968	宝钢包装	53,616,764.10	9.79
45	600116	三峡水利	48,553,833.13	8.87
46	300073	当升科技	43,621,101.28	7.97
47	002949	华阳国际	42,765,011.51	7.81
48	601058	赛轮轮胎	34,700,176.78	6.34
49	002832	比音勒芬	29,615,045.78	5.41
50	603678	火炬电子	29,295,646.60	5.35
51	002028	思源电气	26,174,698.21	4.78
52	603267	鸿远电子	25,413,812.60	4.64
53	002381	双箭股份	22,941,198.24	4.19
54	603612	索通发展	22,505,064.23	4.11
55	601658	邮储银行	20,269,396.00	3.70
56	002947	恒铭达	19,971,985.11	3.65
57	601208	东材科技	19,630,707.28	3.59
58	601965	中国汽研	17,438,346.32	3.18
59	603156	养元饮品	14,852,659.43	2.71
60	000001	平安银行	14,341,617.21	2.62
61	600567	山鹰国际	13,995,387.00	2.56
62	601601	中国太保	11,884,331.71	2.17

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000488	晨鸣纸业	318,057,621.09	58.09
2	002078	太阳纸业	165,762,297.25	30.27
3	601155	新城控股	154,457,979.47	28.21
4	002068	黑猫股份	105,015,870.00	19.18
5	000932	华菱钢铁	89,315,786.36	16.31
6	002318	久立特材	40,745,590.50	7.44

7	600346	恒力石化	38,031,455.61	6.95
8	000001	平安银行	34,605,784.38	6.32
9	603612	索通发展	34,215,527.45	6.25
10	000961	中南建设	33,148,132.00	6.05
11	603444	吉比特	33,062,015.25	6.04
12	688056	莱伯泰科	29,641,696.19	5.41
13	603008	喜临门	28,963,644.00	5.29
14	603699	纽威股份	26,485,195.00	4.84
15	600036	招商银行	25,619,752.40	4.68
16	601166	兴业银行	22,438,825.00	4.10
17	601311	骆驼股份	18,839,366.77	3.44
18	603156	养元饮品	17,832,341.39	3.26
19	603700	宁水集团	16,494,961.22	3.01
20	600166	福田汽车	16,373,382.40	2.99
21	002048	宁波华翔	13,800,407.00	2.52
22	002960	青鸟消防	12,849,722.40	2.35
23	600567	山鹰国际	12,732,331.00	2.33
24	605099	共创草坪	12,105,891.00	2.21
25	601838	成都银行	11,483,871.13	2.10
26	000030	富奥股份	11,345,726.63	2.07
27	600383	金地集团	11,149,687.68	2.04

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	8,026,774,407.34
卖出股票收入（成交）总额	1,507,645,027.33

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	96,873,195.50	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,873,195.50	1.11

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	113025	明泰转债	516,850	96,873,195.50	1.11

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	-697	-1,080,294,240.00	-35,138,700.00	-
IF2112	IF2112	-50	-77,103,000.00	-252,420.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-35,391,120.00
股指期货投资本期收益（元）					6,283,683.49
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-35,391,120.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

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 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的招商银行的发行主体招商银行股份有限公司于2020-09-29受到国家外汇管理局深圳市分局的深外管检[2020]76号，于2020-11-27受到国家外汇管理局深圳市分局的深外管检（2020）92号，于2021-05-17受到银保监会的银保监罚决字（2021）16号。罚款合计7345万元人民币，没收违法所得128.82万元人民币。 本基金投资的宁波银行的发行主体宁波银行股份有限公司于2020-10-16受到宁波银保监局的甬银保监

罚决字（2020）48号，于2021-06-10受到宁波银保监局的甬银保监罚决字（2021）36号。罚款合计55万元。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,982,456.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	219,906.43
5	应收申购款	141,042,199.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	281,244,562.69

7.12.4 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	113025	明泰转债	96,873,195.50	1.11

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧价值智选混合A	151,072	8,219.13	886,903,704.11	71.43%	354,776,859.80	28.57%
中欧价值智选混合E	27,244	2,849.27	46,146,983.29	59.45%	31,478,524.16	40.55%
中欧价值智选混合C	137,246	3,497.25	231,001,631.46	48.13%	248,981,284.22	51.87%
合计	315,562	5,701.86	1,164,052,318.86	64.70%	635,236,668.18	35.30%

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	中欧价值智选混合A	338,879.00	0.03%
	中欧价值智选混合E	554,646.05	0.71%

	中欧价值智选混合C	282,087.12	0.06%
	合计	1,175,612.17	0.07%

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	中欧价值智选混合A	0~10
	中欧价值智选混合E	0~10
	中欧价值智选混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧价值智选混合A	0~10
	中欧价值智选混合E	10~50
	中欧价值智选混合C	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧价值智选混合A	中欧价值智选混合E	中欧价值智选混合C
基金合同生效日(2013年05月14日)基金份额总额	476,420,551.02	—	—
本报告期期初基金份额总额	122,504,760.59	13,088,272.57	11,907,465.93
本报告期基金总申购份额	1,290,233,666.29	81,219,562.54	594,893,640.96

减：本报告期基金总赎回份额	171,057,862.97	16,682,327.66	126,818,191.21
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,241,680,563.91	77,625,507.45	479,982,915.68

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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	143,243,059.05	1.52%	133,402.13	1.52%	-
东方财富	1	327,198,403.57	3.46%	304,721.60	3.46%	-
东方证券	1	68,600,060.93	0.73%	63,883.09	0.73%	-
东吴证券	1	430,583,313.41	4.56%	401,003.52	4.56%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	147,730,065.86	1.56%	137,581.35	1.56%	-
广发证券	1	581,478,512.62	6.16%	541,515.71	6.16%	-
国金	1	1,179,424,304.25	12.49%	1,098,402.60	12.49%	-

证券						
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	1,709,098,140.40	18.09%	1,591,699.89	18.09%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	775,531,213.75	8.21%	722,256.65	8.21%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	104,531,651.56	1.11%	97,350.70	1.11%	-
天风证券	1	290,008,994.07	3.07%	270,085.52	3.07%	-
西部证券	1	755,682,964.16	8.00%	703,767.98	8.00%	-
西南证券	1	1,346,231,954.71	14.25%	1,253,749.87	14.25%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	1,100,112,680.57	11.65%	1,024,538.90	11.65%	-
中信证券(华南)	1	-	-	-	-	-

国都证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	486,706,746.80	5.15%	453,272.19	5.15%	-

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，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	12,515,591.32	5.42%	-	-	-	-	-	-
广发证券	35,627,534.00	15.43%	-	-	-	-	-	-
国金证券	44,400,529.20	19.23%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	7,595,245.35	3.29%	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	7,925,296.65	3.43%	-	-	-	-	-	-
天风证券	9,080,244.30	3.93%	-	-	-	-	-	-
西部证券	10,608,037.53	4.59%	-	-	-	-	-	-
西南证券	9,739,206.32	4.22%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	64,698,018.10	28.02%	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	28,707,452.40	12.43%	-	-	-	-	-	-

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，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧价值智选回报混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
2	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“科顺股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-09

3	中欧价值智选回报混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
4	中欧价值智选回报混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金产品在中欧财富电子交易平台开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-05-15
6	中欧基金管理有限公司关于中欧价值智选回报灵活配置混合型证券投资基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-05-27

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
机构	1	2021年1月1日至2021年2月2日	30,536,262.14	80,029,516.64	0.00	110,565,778.78
份额占比						
6.14%						
产品特有风险						
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。						

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

11.2 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、中欧价值智选回报混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧价值智选回报混合型证券投资基金托管协议》

- 4、《中欧价值智选回报混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人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)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