中欧养老产业混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§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遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 59
8.1 期末基金资产组合情况 60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 69

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 70
8.12 投资组合报告附注 70
§9 基金份额持有人信息 71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 72
§10 开放式基金份额变动 72
§11 重大事件揭示 73
11.1 基金份额持有人大会决议 73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 73
11.4 基金投资策略的改变 73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 73
11.8 其他重大事件 76
§12 影响投资者决策的其他重要信息 78
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 78
§13 备查文件目录 78
13.1 备查文件目录 79
13.2 存放地点 79
13.3 查阅方式 79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧养老产业混合型证券投资基金	
基金简称	中欧养老混合	
基金主代码	001955	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年05月13日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,473,774,746.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧养老混合A	中欧养老混合C
下属分级基金的交易代码	001955	012778
报告期末下属分级基金的份额总额	1,199,569,963.54份	274,204,782.49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	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%
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，属于较高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	黎忆海	李申
	联系电话	021-68609600	021-60637102
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	021-60637111
传真		021-33830351	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		窦玉明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年		2020年		2019年	
	中欧养老混合A	中欧养老混合C	中欧养老混合A	中欧养老混合C	中欧养老混合A	中欧养老混合C
本期已实现收益	205,389,184.24	9,265,743.04	311,689,687.20	-	70,378,295.59	-
本期利润	418,906,311.40	40,468,882.65	271,436,423.29	-	107,486,362.09	-
加权平均基金份额本期利润	1.0044	0.8982	0.6146	-	0.6231	-
本期加权平均净值利润率	35.43%	28.69%	30.80%	-	41.66%	-
本期基金份额净值增长率	33.79%	22.61%	43.46%	-	70.01%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	2,359,599,037.63	536,338,323.55	483,162,307.88	-	280,931,861.77	-
期末可供分配基金份额利润	1.9670	1.9560	1.4556	-	0.6533	-
期末基金资产净值	3,942,352,823.62	897,947,192.64	815,094,705.23	-	736,174,804.84	-
期末基金份额净值	3.286	3.275	2.456	-	1.712	-
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	228.60%	22.61%	145.60%	-	71.20%	-

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

中欧养老混合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
过去三个月	13.98%	0.81%	1.33%	0.59%	12.65%	0.22%
过去六个月	23.03%	1.00%	-3.64%	0.77%	26.67%	0.23%
过去一年	33.79%	1.03%	-3.12%	0.88%	36.91%	0.15%
过去三年	226.32%	1.36%	47.93%	0.96%	178.39%	0.40%
过去五年	210.59%	1.28%	38.92%	0.90%	171.67%	0.38%
自基金合同生效起至今	228.60%	1.23%	45.94%	0.87%	182.66%	0.36%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%。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。

中欧养老混合C

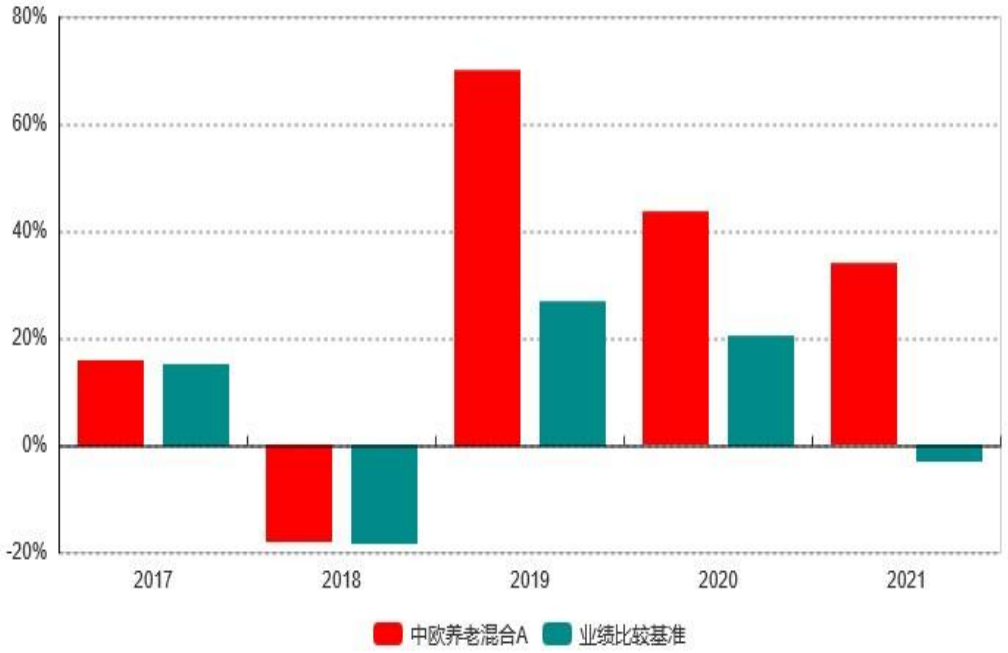
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.79%	0.82%	1.33%	0.59%	12.46%	0.23%
过去六个月	22.61%	1.00%	-3.64%	0.77%	26.25%	0.23%
自基金份额运作日至今	22.61%	1.00%	-3.64%	0.77%	26.25%	0.23%

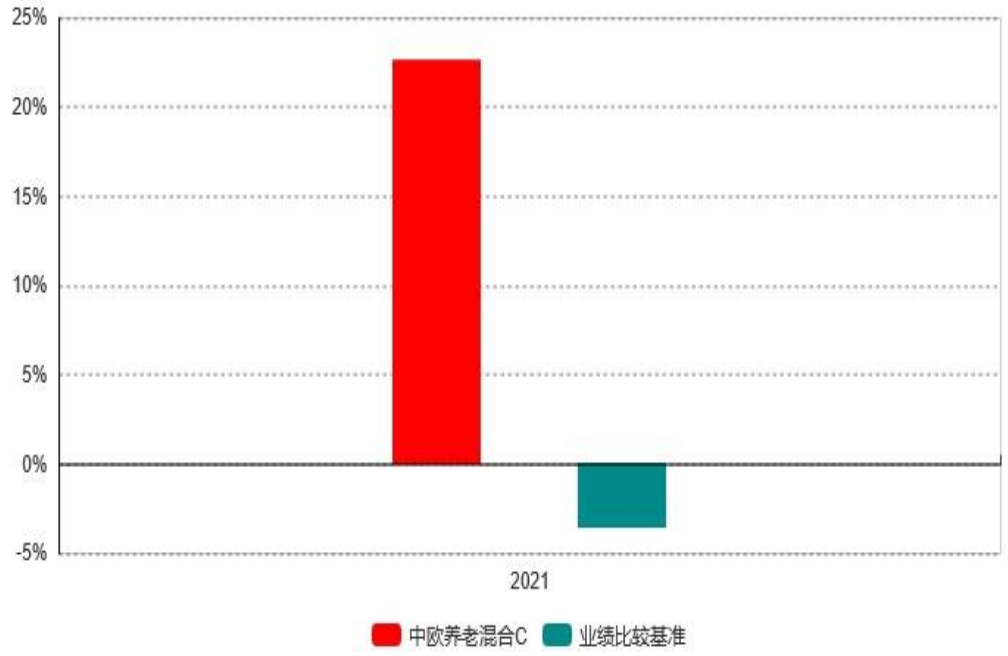
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

注：本基金于 2021 年 6 月 30 日新增 C 类份额，图示日期为 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：2021 年 6 月 30 日本基金新增 C 份额,2021 年度数据为 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、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12月31日，本基金管理人共管理106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		
许文星	基金经理	2018-04-16	-	7年	历任光大保德信基金管理有限公司研究部行业研究员，光大保德信基金管理有限公司投资经理。2018/02/05加入中欧基金管理有限公司。
王健	投资总监/基金经理	2016-11-03	-	18年	历任红塔证券研究中心医药行业研究员，光大保德信基金管理有限公司医药行业研究员、基金经理。2015/06/01加入中欧基金

					管理有限公司,历任投资经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有32次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，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

2021年的股票市场跌宕起伏，核心资产的估值泡沫破灭，全球新冠疫情的不断变种反复，教育/互联网/房地产等行业出现的政策变化，一些市场参与者阶段性的“共识”不断被挑战，都是作为投资者的我们又一次从市场中学到的宝贵经验和教训。

2021年，在全球新冠疫情仍未结束的背景之下，资本市场整体流动性较为宽松，全球主要权益市场表现较好，而前期涨幅较大的A股大盘成长股，香港科技股，和中概股因基本面，估值，政策等多重因素叠加，表现相对落后；中上游材料股，新能源产业链和中小市值公司，分别在不同阶段表现占优。市场整体呈现出低估值股票回升，高估值股票回落的结构性行情。

回顾本基金的运作过程，我们整体延续此前整个组合长期的配置思路，以逆向策略为核心，围绕企业长期可持续增长和核心竞争力自下而上寻找投资机会，并始终将安全边际作为投资决策的重要决策因子。构建一个低相关度，中期风险回报比高的投资组合，以期能够在控制风险的基础上，通过持有企业业务增长推动股权价值增长，不断将我们对于产业发展的认知和研究，最大程度转化为投资回报，是一直以来本基金的主要管理运作模式。因此我们尽可能立足于中长期视角评估公司核心竞争力和企业价值，规避因为短期市场风格情绪，或者产业周期性盈利动量而带来的估值溢价。21年整体组合运作保持相对稳定的状态，部分新兴行业企业盈利的快速增长，推动了股权价值的上升；当面临市场对某些行业估值快速扩张的背景下，我们希望能够继续保持客观冷静，立足长远，维持整体组合的风险回报比；而部分行业因受到外部环境变化而持续低迷的时候，我们也希望能够发现在行业压力测试中竞争优势不断扩张的优质企业，等待企业的价值回归。

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33.79%，同期业绩比较基准收益率为-3.12%；C类份额净值增长率为22.61%，同期业绩比较基准收益率为-3.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球视角下，科技行业中分布于微笑曲线两端的集成电路设计和软件互联网应用，是在数字化社会背景下能够持续创造较高股东回报的两大赛道，也是本基金投资组合中长期重要投向；在人口红利逐步放缓的背景下，消费领域中的老龄化，性价比，全球化成为中国品牌的主要增长方向；而在占据存量经济比重较高的传统行业中，主要的投资机会将以存量供给格局的不断优化，优胜劣汰为主导。

展望2022年，权益市场整体估值处于合理水平，全球供应链将逐步从新冠疫情中恢复新常态，上中下游企业盈利趋势将有所分化，对投资者将提出更大挑战。我们将立足企业长期竞争力研究，努力寻找估值合理，盈利不断增长的价值成长企业，同时谨慎看待周期性因素推升短期盈利的价值陷阱。

从组合管理角度出发，安全边际和企业盈利仍是我们持续优化组合风险收益比的最重要基础，逆向投资是我们长期超额收益的主要来源。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2021年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2021年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程55项，内容涵盖投资研究、合规管理、信息技术、反洗钱等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2021年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61362990_B22号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧养老产业混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中欧养老产业混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧养老产业混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧养老产业混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧养老产业混合型证券投资基

	金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中欧养老产业混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估中欧养老产业混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督中欧养老产业混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作

	出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧养老产业混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧养老产业混合型证券投资基金不能持续经营。(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露、张亚旎
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

审计报告日期	2022-03-30

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧养老产业混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	651,983,378.41	75,742,978.25
结算备付金		31,157,142.38	2,583,768.11
存出保证金		486,862.20	506,300.96
交易性金融资产	7.4.7.2	3,652,158,970.71	751,187,325.44
其中：股票投资		3,652,158,970.71	729,730,143.24
基金投资		-	-
债券投资		-	21,457,182.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	532,800,000.00	-
应收证券清算款		-	4,941,982.52
应收利息	7.4.7.5	-134,403.50	42,385.58
应收股利		-	-
应收申购款		83,290,079.90	1,808,677.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,951,742,030.10	836,813,418.71
负债和所有者权益	**附注号**	本期末	上年度末

		2021年12月31日	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		99,551,882.65	11,474,022.95
应付赎回款		1,731,558.00	7,858,837.34
应付管理人报酬		4,503,298.09	1,079,602.35
应付托管费		750,549.68	179,933.71
应付销售服务费		348,231.20	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,463,098.80	1,037,881.72
应交税费		0.50	232.63
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	93,394.92	88,202.78
负债合计		111,442,013.84	21,718,713.48
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,473,774,746.03	331,932,397.35
未分配利润	7.4.7.10	3,366,525,270.23	483,162,307.88
所有者权益合计		4,840,300,016.26	815,094,705.23
负债和所有者权益总计		4,951,742,030.10	836,813,418.71

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值为人民币3.284元，基金份额总额1,473,774,746.03份，其中A类基金份额参考净值为人民币3.286元，份额总额为1,199,569,963.54份；C类基金份额参考净值为人民币3.275元，份额总额为274,204,782.49份。

7.2 利润表

会计主体：中欧养老产业混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		495,583,874.31	302,069,129.04
1.利息收入		2,375,798.60	579,147.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	649,501.16	535,214.14
债券利息收入		27,054.35	43,933.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,699,243.09	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		246,239,468.43	338,730,688.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	236,767,523.00	329,526,796.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,410,069.29	774,863.15
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	10,882,014.72	8,429,029.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	244,720,266.77	-40,253,263.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,248,340.51	3,012,556.65
减：二、费用		36,208,680.26	30,632,705.75
1. 管理人报酬		18,402,652.54	13,185,219.37

2．托管费		3,067,108.72	2,197,536.53
3．销售服务费		530,339.99	-
4．交易费用	7.4.7.18	13,965,001.95	15,008,531.98
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		97.41	119.66
7．其他费用	7.4.7.19	243,479.65	241,298.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		459,375,194.05	271,436,423.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		459,375,194.05	271,436,423.29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧养老产业混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	331,932,397.35	483,162,307.88	815,094,705.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	459,375,194.05	459,375,194.05
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）	1,141,842,348.68	2,423,987,768.30	3,565,830,116.98

其中：1.基金申购款	1,506,760,407.04	3,028,727,464.46	4,535,487,871.50
2.基金赎回款	-364,918,058.36	-604,739,696.16	-969,657,754.52
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）	1,473,774,746.03	3,366,525,270.23	4,840,300,016.26
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	430,025,801.01	306,149,003.83	736,174,804.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	271,436,423.29	271,436,423.29
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）	-98,093,403.66	-94,423,119.24	-192,516,522.90
其中：1.基金申购款	554,492,596.12	540,484,362.50	1,094,976,958.62
2.基金赎回款	-652,585,999.78	-634,907,481.74	-1,287,493,481.52
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）	331,932,397.35	483,162,307.88	815,094,705.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘建平	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧养老产业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[2015]2215号文《关于准予中欧养老产业混合型证券投资基金注册的批复》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《中欧养老产业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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集210,786,707.96元，经向中国证监会备案，《中欧养老产业混合型证券投资基金基金合同》于2016年5月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为210,950,753.54份基金份额，其中认购资金利息折合164,045.58基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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，经征托管人中国建设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2021年6月30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。本基金在现有份额的基础上增加C类基金份额，原份额转为A类基金份额。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧养老产业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、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货、股票期权等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股

票投资占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于受益于人口老龄化进程的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1） 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资和债券投资等；

（2） 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券 以及不作为有效套期工具的衍生工具等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1） 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2） 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3） 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4） 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

（5） 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（6） 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1） 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2） 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3） 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4） 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/（累计亏损）"。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1） 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2） 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3） 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4） 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5） 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6） 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7） 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（8） 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

（9） 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

（10）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

（11）公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（12）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	651,983,378.41	75,742,978.25
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	651,983,378.41	75,742,978.25

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,413,261,875.87	3,652,158,970.71	238,897,094.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,413,261,875.87	3,652,158,970.71	238,897,094.84
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		732,120,092.19	729,730,143.24	-2,389,948.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	24,890,405.18	21,457,182.20	-3,433,222.98
	银行间市场	-	-	-
	合计	24,890,405.18	21,457,182.20	-3,433,222.98
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		757,010,497.37	751,187,325.44	-5,823,171.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	532,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	532,800,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	83,260.58	6,126.30
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	15,422.77	1,278.97
应收债券利息	-	34,729.73
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	-233,327.75	-
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	240.90	250.58
合计	-134,403.50	42,385.58

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,463,098.80	1,037,881.72
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,463,098.80	1,037,881.72

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,394.10	13,182.44
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	90,000.00	75,000.00
应付转出费	0.82	20.34
合计	93,394.92	88,202.78

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

(中欧养老混合A)	2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	331,932,397.35	331,932,397.35
本期申购	1,226,049,294.23	1,226,049,294.23
本期赎回（以“-”号填列）	-358,411,728.04	-358,411,728.04
本期末	1,199,569,963.54	1,199,569,963.54

金额单位：人民币元

项目 (中欧养老混合C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	280,711,112.81	280,711,112.81
本期赎回（以“-”号填列）	-6,506,330.32	-6,506,330.32
本期末	274,204,782.49	274,204,782.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中欧养老混合A

单位：人民币元

项目 (中欧养老混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	487,059,430.23	-3,897,122.35	483,162,307.88
本期利润	205,389,184.24	213,517,127.16	418,906,311.40
本期基金份额交易产生的变动数	1,667,150,423.16	173,563,817.64	1,840,714,240.80
其中：基金申购款	2,257,918,347.16	174,517,114.53	2,432,435,461.69
基金赎回款	-590,767,924.00	-953,296.89	-591,721,220.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,359,599,037.63	383,183,822.45	2,742,782,860.08

7.4.7.10.2 中欧养老混合C

单位：人民币元

项目 (中欧养老混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	9,265,743.04	31,203,139.61	40,468,882.65
本期基金份额交易产生的变动数	527,072,580.51	56,200,946.99	583,273,527.50
其中：基金申购款	539,299,118.05	56,992,884.72	596,292,002.77
基金赎回款	-12,226,537.54	-791,937.73	-13,018,475.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	536,338,323.55	87,404,086.60	623,742,410.15

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	538,491.93	455,217.20
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	104,704.92	61,266.34
其他	6,304.31	18,730.60
合计	649,501.16	535,214.14

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	3,805,706,680.51	4,983,549,718.57
减：卖出股票成本总额	3,568,939,157.51	4,654,022,922.41

买卖股票差价收入	236,767,523.00	329,526,796.16

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	-1,410,069.29	774,863.15
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	-1,410,069.29	774,863.15

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	34,233,331.59	21,296,751.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	35,580,805.18	20,271,108.03
减：应收利息总额	62,595.70	250,780.46
买卖债券差价收入	-1,410,069.29	774,863.15

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,882,014.72	8,429,029.47
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	10,882,014.72	8,429,029.47

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	244,720,266.77	-40,253,263.91
——股票投资	241,287,043.79	-36,806,237.51
——债券投资	3,433,222.98	-3,447,026.40
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	244,720,266.77	-40,253,263.91

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	2,168,647.03	2,743,546.27
转换费收入	79,693.48	269,010.38
合计	2,248,340.51	3,012,556.65

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	13,965,001.95	15,008,531.98
银行间市场交易费用	-	-
合计	13,965,001.95	15,008,531.98

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
审计费用	90,000.00	75,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	15,119.65	27,938.21
账户维护费	18,360.00	18,360.00
合计	243,479.65	241,298.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（"中欧基金"）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	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
万盛基业投资有限责任公司(“万盛基业”)	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）("上海睦亿合伙")	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司("中欧盛世资管")	基金管理人的全资子公司
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
中欧基金国际有限公司（“中欧国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会批准，公司原股东北京百骏投资有限公司将其持有的公司 20%股权转让给自然人股东窦玉明先生，本次股权变更的工商变更登记手续已于2021年7月27日办理完毕。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额的比例		交总额的比例
国都证券	-	-	1,210,089,510.92	12.47%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	1,127,265.98	12.47%	-	-

注：1.本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

2.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。

3. 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	18,402,652.54	13,185,219.37
其中：支付销售机构的客户维护费	3,207,749.96	2,095,450.25

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×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,067,108.72	2,197,536.53

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×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧养老混合A	中欧养老混合C	合计
中欧基金	0.00	121,856.54	121,856.54
合计	0.00	121,856.54	121,856.54

注：

1、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 0.80%，销售服务费按前一日 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×0.80%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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。

2、本基金自2021年6月30日起新增C类份额，2020年本基金未计提销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧养老混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31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%

中欧养老混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31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	56,158.74	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	56,158.74	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	0.00%

注： 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧养老混合A

关联方名称	本期末 2021年12月31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	844,036.45	0.07%	413,478.80	0.12%

东				

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、本报告期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有C类基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	651,983,378.41	538,491.93	75,742,978.25	455,217.20

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
6883	致远	2021	2022	大宗	60.2	66.1	600,00	36,1	39,6	-

69	互联	-12-13	-06-13	交易流通受限	8	3	0	68,000.00	78,000.00	
689009	九号公司	2021-12-16	2022-06-15	大宗交易流通受限	57.00	64.17	260,000	14,820,000.00	16,684,200.00	-
689009	九号公司	2021-12-21	2022-06-20	大宗交易流通受限	58.00	64.14	250,000	14,500,000.00	16,035,000.00	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688232	新点软件	2021-11-10	2022-05-17	新股流通受限	48.49	41.99	18,735	908,460.15	786,682.65	-
688739	成大生物	2021-10-21	2022-04-28	新股流通受限	110.00	70.32	5,064	557,040.00	356,100.48	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688248	南网科技	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	12.24	18.90	11,763	143,979.12	222,320.70	-
688257	新锐股份	2021-10-19	2022-04-27	新股流通受限	62.30	61.10	2,899	180,607.70	177,128.90	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
3011	迪阿	2021	2022	新股	116.	116.	792	92,5	91,9	-

77	股份	-12-08	-06-15	流通受限	88	08		68.96	35.36	
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
3009	久祺	2021	2022	新股	11.9	45.4	420	4,99	19,0	-

94	股份	-08-02	-02-14	流通受限	0	5		8.00	89.00	
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
3011	迈赫	2021	2022	新股	29.2	32.0	402	11,7	12,8	-

99	股份	-11-30	-06-07	流通受限	8	0		70.56	64.00	
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
3010	万事	2021	2022	新股	5.24	22.8	344	1,80	7,85	-

66	利	-09-13	-03-22	流通受限		4		2.56	6.96	
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
3010	中捷	2021	2022	新股	7.46	33.4	181	1,35	6,04	-

72	精工	-09-22	-03-29	流通受限		1		0.26	7.21	
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易

所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。 针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。 针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。 于2021年12月31日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注7.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021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	651,983,378.41	-	-	-	651,983,378.41
结算备付金	31,157,142.38	-	-	-	31,157,142.38
存出保证金	486,862.20	-	-	-	486,862.20
交易性金融资产	-	-	-	3,652,158,970.71	3,652,158,970.71
买入返售金融资产	532,800,000.00	-	-	-	532,800,000.00
应收利息	-	-	-	-134,403.50	-134,403.50
应收申购款	-	-	-	83,290,079.90	83,290,079.90
资产总计	1,216,427,382.99	-	-	3,735,314,647.11	4,951,742,030.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	99,551,882.65	99,551,882.65
应付赎	-	-	-	1,731,558.00	1,731,558.00

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	4,503,298.09	4,503,298.09
应付托管费	-	-	-	750,549.68	750,549.68
应付销售服务费	-	-	-	348,231.20	348,231.20
应付交易费用	-	-	-	4,463,098.80	4,463,098.80
应交税费	-	-	-	0.50	0.50
其他负债	-	-	-	93,394.92	93,394.92
负债总计	-	-	-	111,442,013.84	111,442,013.84
利率敏感度缺口	1,216,427,382.99	-	-	3,623,872,633.27	4,840,300,016.26
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	75,742,978.25	-	-	-	75,742,978.25
结算备付金	2,583,768.11	-	-	-	2,583,768.11
存出保证金	506,300.96	-	-	-	506,300.96
交易性金融资产	-	19,457,182.20	2,000,000.00	729,730,143.24	751,187,325.44
应收证券清算款	-	-	-	4,941,982.52	4,941,982.52
应收利息	-	-	-	42,385.58	42,385.58
应收申购款	-	-	-	1,808,677.85	1,808,677.85
资产总计	78,833,047.32	19,457,182.20	2,000,000.00	736,523,189.19	836,813,418.71
负债					
应付证	-	-	-	11,474,022.95	11,474,022.95

券清算款					
应付赎回款	-	-	-	7,858,837.34	7,858,837.34
应付管理人报酬	-	-	-	1,079,602.35	1,079,602.35
应付托管费	-	-	-	179,933.71	179,933.71
应付交易费用	-	-	-	1,037,881.72	1,037,881.72
应交税费	-	-	-	232.63	232.63
其他负债	-	-	-	88,202.78	88,202.78
负债总计	-	-	-	21,718,713.48	21,718,713.48
利率敏感度缺口	78,833,047.32	19,457,182.20	2,000,000.00	714,804,475.71	815,094,705.23

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为0.00%(2020年12月31日:2.63%),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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。 本基金的基金管理人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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	3,652,158,970.71	75.45	729,730,143.24	89.53
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	3,652,158,970.71	75.45	729,730,143.24	89.53

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	212,421,187.85	49,548,937.76
	2.业绩比较基准下降5%	-212,421,187.85	-49,548,937.76

7.4.14 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银行存款、结算备付金、存出保证金、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3,576,109,537.60元，属于第二层次的余额为人民币1,253,239.55元，属于第三层次的余额为人民币74,796,193.56元(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币744,492,680.19元，属于第二层次的余额为人民币6,694,645.25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期初余额为人民币0元，期末余额为人民币74,796,193.56元，本期增加人民币74,796,193.56元。

2.承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3.其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号－金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号－金融资产转移》、《企业会计准则第24号－套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

4.财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月30日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,652,158,970.71	73.76
	其中：股票	3,652,158,970.71	73.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	532,800,000.00	10.76
	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	683,140,520.79	13.80
8	其他各项资产	83,642,538.60	1.69
9	合计	4,951,742,030.10	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	20,332.12	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,409,489,268.62	29.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,990.65	0.00
E	建筑业	114,548,754.20	2.37
F	批发和零售业	180,975.48	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	190,610,291.60	3.94
H	住宿和餐饮业	52,914.16	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,082,039,996.35	22.35
J	金融业	3,538.08	0.00
K	房地产业	499,783,284.96	10.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	364,669.60	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	42,919,483.33	0.89
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	312,116,471.56	6.45
S	综合	-	-
	合计	3,652,158,970.71	75.45

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600741	华域汽车	16,562,151	468,708,873.30	9.68
2	000002	万 科A	23,062,846	455,721,836.96	9.42
3	002555	三七互娱	13,870,062	374,769,075.24	7.74
4	688099	晶晨股份	2,867,838	373,392,507.60	7.71
5	300144	宋城演艺	21,794,653	312,099,430.96	6.45
6	688369	致远互联	2,626,353	183,853,015.95	3.80
7	000977	浪潮信息	4,737,424	169,741,901.92	3.51
8	002332	仙琚制药	12,690,805	167,518,626.00	3.46
9	002120	韵达股份	7,729,500	158,145,570.00	3.27
10	300454	深信服	697,700	133,260,700.00	2.75
11	601668	中国建筑	22,906,900	114,534,500.00	2.37

12	688036	传音控股	711,677	111,662,121.30	2.31
13	603228	景旺电子	3,199,632	110,483,292.96	2.28
14	689009	九号公司	1,437,266	97,692,728.62	2.02
15	300747	锐科激光	1,238,923	73,232,738.53	1.51
16	603986	兆易创新	345,900	60,826,515.00	1.26
17	600276	恒瑞医药	1,083,075	54,922,733.25	1.13
18	001914	招商积余	2,174,800	44,061,448.00	0.91
19	603588	高能环境	2,440,017	42,871,098.69	0.89
20	601021	春秋航空	571,562	32,464,721.60	0.67
21	603596	伯特利	325,786	22,674,705.60	0.47
22	601615	明阳智能	728,800	19,021,680.00	0.39
23	002891	中宠股份	588,165	17,786,109.60	0.37
24	603039	泛微网络	222,100	15,495,917.00	0.32
25	600438	通威股份	326,000	14,656,960.00	0.30
26	600993	马应龙	307,500	8,843,700.00	0.18
27	688063	派能科技	27,238	5,365,886.00	0.11
28	600887	伊利股份	64,500	2,674,170.00	0.06
29	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
30	688232	新点软件	18,735	786,682.65	0.02
31	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.01
32	688739	成大生物	5,064	356,100.48	0.01
33	688677	海泰新光	3,279	308,553.90	0.01
34	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
35	301082	久盛电气	9,144	224,355.18	0.00
36	688248	南网科技	11,763	222,320.70	0.00
37	301093	华兰股份	4,088	212,432.45	0.00
38	688257	新锐股份	2,899	177,128.90	0.00
39	301108	洁雅股份	2,800	166,667.20	0.00
40	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.00
41	301199	迈赫股份	4,014	139,825.80	0.00
42	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00

43	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
44	301066	万事利	3,436	85,682.60	0.00
45	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
46	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
47	301073	君亭酒店	1,432	48,812.16	0.00
48	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
49	601965	中国汽研	1,902	35,396.22	0.00
50	688701	卓锦股份	2,340	32,572.80	0.00
51	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
52	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
53	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
54	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
55	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
56	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
57	600803	新奥股份	1,000	18,360.00	0.00
58	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
59	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
60	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
61	002675	东诚药业	1,000	15,780.00	0.00
62	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
63	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
64	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
65	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
66	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
67	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
68	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
69	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
70	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
71	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
72	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
73	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00

74	300943	春晖智控	255	11,801.40	0.00
75	300966	共同药业	286	11,731.72	0.00
76	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
77	605580	恒盛能源	655	10,630.65	0.00
78	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
79	300945	曼卡龙	474	9,968.22	0.00
80	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.00
81	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
82	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
83	605303	园林股份	610	9,540.40	0.00
84	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
85	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
86	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
87	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
88	603258	电魂网络	300	9,000.00	0.00
89	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
90	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
91	300926	博俊科技	359	8,544.20	0.00
92	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
93	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
94	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
95	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
96	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
97	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
98	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
99	605298	必得科技	391	7,397.72	0.00
100	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
101	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
102	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
103	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
104	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00

105	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
106	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
107	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
108	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
109	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
110	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
111	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
112	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
113	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
114	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
115	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
116	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
117	600754	锦江酒店	70	4,102.00	0.00
118	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
119	601336	新华保险	91	3,538.08	0.00
120	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
121	000538	云南白药	20	2,093.00	0.00
122	603612	索通发展	65	1,333.80	0.00
123	601966	玲珑轮胎	28	1,023.40	0.00
124	300849	锦盛新材	72	882.72	0.00
125	000581	威孚高科	1	21.54	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	562,528,316.00	69.01
2	600741	华域汽车	505,550,799.14	62.02
3	688099	晶晨股份	488,675,271.87	59.95
4	300144	宋城演艺	366,828,733.96	45.00

5	002555	三七互娱	344,794,908.89	42.30
6	002332	仙琚制药	214,572,411.28	26.32
7	688369	致远互联	178,511,095.25	21.90
8	000977	浪潮信息	150,690,944.25	18.49
9	600803	新奥股份	148,011,675.08	18.16
10	002120	韵达股份	146,653,873.88	17.99
11	300454	深信服	140,182,450.06	17.20
12	601318	中国平安	139,156,056.01	17.07
13	300747	锐科激光	131,665,747.28	16.15
14	601615	明阳智能	129,957,965.14	15.94
15	601668	中国建筑	113,977,302.70	13.98
16	603596	伯特利	111,302,124.26	13.66
17	688036	传音控股	109,120,038.23	13.39
18	603517	绝味食品	102,573,400.23	12.58
19	000988	华工科技	93,562,008.89	11.48
20	603228	景旺电子	91,822,730.29	11.27
21	601965	中国汽研	87,124,358.10	10.69
22	000049	德赛电池	85,819,632.13	10.53
23	689009	九号公司	83,570,152.20	10.25
24	603986	兆易创新	78,156,404.86	9.59
25	300529	健帆生物	77,674,685.27	9.53
26	601658	邮储银行	72,239,968.52	8.86
27	002007	华兰生物	67,150,452.32	8.24
28	000333	美的集团	65,530,122.53	8.04
29	600276	恒瑞医药	64,165,494.94	7.87
30	002695	煌上煌	61,732,336.95	7.57
31	300196	长海股份	60,422,564.18	7.41
32	603606	东方电缆	59,910,330.78	7.35
33	000651	格力电器	59,884,951.09	7.35
34	603612	索通发展	58,913,234.76	7.23
35	601166	兴业银行	50,833,516.00	6.24

36	688116	天奈科技	50,132,024.93	6.15
37	002299	圣农发展	49,137,757.98	6.03
38	300188	美亚柏科	49,001,788.33	6.01
39	600486	扬农化工	44,737,748.21	5.49
40	603588	高能环境	40,148,186.88	4.93
41	688063	派能科技	37,376,623.88	4.59
42	001914	招商积余	35,997,385.60	4.42
43	002409	雅克科技	34,678,713.00	4.25
44	600976	健民集团	32,741,632.71	4.02
45	001979	招商蛇口	30,779,328.25	3.78
46	601021	春秋航空	30,706,007.58	3.77
47	002032	苏 泊 尔	26,688,963.57	3.27
48	603383	顶点软件	25,896,127.00	3.18
49	600872	中炬高新	22,687,869.75	2.78
50	600383	金地集团	22,107,654.00	2.71
51	300078	思创医惠	21,487,623.00	2.64
52	603898	好莱客	20,767,027.08	2.55
53	300037	新宙邦	19,320,944.00	2.37
54	600521	华海药业	18,198,844.06	2.23
55	002891	中宠股份	17,364,580.30	2.13

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603596	伯特利	251,676,593.57	30.88
2	600803	新奥股份	234,448,191.85	28.76
3	688099	晶晨股份	199,945,756.58	24.53
4	601318	中国平安	198,020,736.25	24.29
5	601965	中国汽研	161,085,921.06	19.76

6	000988	华工科技	159,125,536.87	19.52
7	000002	万 科A	143,850,856.50	17.65
8	601615	明阳智能	136,579,728.55	16.76
9	600741	华域汽车	134,047,653.94	16.45
10	300188	美亚柏科	122,446,928.77	15.02
11	300196	长海股份	111,787,926.52	13.71
12	603517	绝味食品	102,794,859.31	12.61
13	000049	德赛电池	89,234,150.50	10.95
14	603606	东方电缆	79,733,984.85	9.78
15	300529	健帆生物	77,397,473.53	9.50
16	601658	邮储银行	74,735,677.00	9.17
17	603612	索通发展	73,273,634.09	8.99
18	000333	美的集团	67,430,958.54	8.27
19	603898	好莱客	67,175,036.43	8.24
20	002007	华兰生物	66,199,033.25	8.12
21	000651	格力电器	61,854,756.43	7.59
22	300078	思创医惠	61,838,964.81	7.59
23	002332	仙琚制药	56,041,590.48	6.88
24	688116	天奈科技	55,267,484.92	6.78
25	002695	煌上煌	55,197,749.78	6.77
26	300737	科顺股份	54,912,220.40	6.74
27	601166	兴业银行	53,676,528.00	6.59
28	300144	宋城演艺	52,952,375.64	6.50
29	300747	锐科激光	52,842,478.12	6.48
30	600486	扬农化工	45,266,936.50	5.55
31	002299	圣农发展	42,428,072.65	5.21
32	600976	健民集团	37,717,028.02	4.63
33	002409	雅克科技	34,236,407.54	4.20
34	001979	招商蛇口	33,900,352.83	4.16
35	688063	派能科技	32,184,195.57	3.95
36	603383	顶点软件	27,219,561.40	3.34

37	002677	浙江美大	25,939,951.48	3.18
38	002032	苏 泊 尔	25,770,179.83	3.16
39	688369	致远互联	25,132,796.98	3.08
40	600383	金地集团	24,814,900.00	3.04
41	600872	中炬高新	23,883,622.01	2.93
42	603986	兆易创新	20,357,367.34	2.50
43	600521	华海药业	19,320,565.16	2.37
44	300037	新宙邦	19,138,444.00	2.35
45	300630	普利制药	18,202,543.87	2.23

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,250,080,941.19
卖出股票收入（成交）总额	3,805,706,680.51

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的宋城演艺的发行主体宋城演艺发展股份有限公司于2021-11-17受到国家税务总局杭州市税务局第二稽查局的杭税二稽罚〔2020〕275号。 本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	486,862.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-134,403.50

5	应收申购款	83,290,079.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,642,538.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	688369	致远互联	39,678,000.00	0.82	大宗交易流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧养老	137,460	8,726.68	1,001,068,411.56	83.45%	198,501,551.98	16.55%

混合A						
中欧养老混合C	1,275	215,062.57	266,796,655.13	97.30%	7,408,127.36	2.70%
合计	138,735	10,622.95	1,267,865,066.69	86.03%	205,909,679.34	13.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧养老混合A	1,569,915.47	0.13%
	中欧养老混合C	30,519.73	0.01%
	合计	1,600,435.20	0.11%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧养老混合A	50~100
	中欧养老混合C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧养老混合A	50~100
	中欧养老混合C	0
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧养老混合A	中欧养老混合C
基金合同生效日(2016年05月13日)基金份额总额	210,950,753.54	-
本报告期期初基金份额总额	331,932,397.35	-

本报告期基金总申购份额	1,226,049,294.23	280,711,112.81
减：本报告期基金总赎回份额	358,411,728.04	6,506,330.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,199,569,963.54	274,204,782.49

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2017年12月30日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为90,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	813,933,405.91	8.12%	758,018.72	8.26%	-
长江证券	1	144,468,861.28	1.44%	118,743.96	1.29%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	216,168,412.04	2.16%	201,318.06	2.19%	-
广发证券	1	65,488,000.00	0.65%	62,532.15	0.68%	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	1,109,265,344.43	11.06%	884,233.26	9.64%	-
国盛证券	1	1,357,019,259.47	13.53%	1,263,796.39	13.77%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	70,138,845.89	0.70%	65,319.52	0.71%	-
信达	1	554,072,124.23	5.53%	516,009.65	5.62%	-

证券						
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	990,504,741.03	9.88%	922,454.14	10.05%	-
中信证券	1	531,008,329.97	5.30%	494,529.51	5.39%	-
中泰证券	2	1,525,788,662.34	15.22%	1,420,971.27	15.49%	-
中信建投	2	2,648,794,015.73	26.42%	2,467,926.97	26.90%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	9,118,307.50	26.64%	4,151,800,000.00	23.01%	-	-	-	-
国盛证券	390,979.	1.1	-	-	-	-	-	-

	40	4%						
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	7,239,263.50	21.15%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,243,600,000.00	6.89%	-	-	-	-
中泰证券	10,008,646.99	29.24%	-	-	-	-	-	-
中信建投	7,476,134.20	21.84%	12,651,300,000.00	70.10%	-	-	-	-

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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧养老产业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旗下部分基金2020年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
4	中欧养老产业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

5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
6	中欧养老产业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
7	中欧养老产业混合型证券投资基金托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2021-06-29
8	中欧养老产业混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-06-29
9	中欧养老产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年6月）	中国证监会指定媒介	2021-06-29
10	中欧基金管理有限公司关于增加中欧养老产业混合型证券投资基金C类份额并修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-29
11	中欧养老产业混合型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2021-06-29
12	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-07-14
13	中欧养老产业混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
14	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
15	中欧养老产业混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
16	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
17	中欧基金管理有限公司办公	中国证监会指定媒介	2021-09-17

	地址变更公告		
18	中欧养老产业混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-09-30
19	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
20	中欧养老产业混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年10月）	中国证监会指定媒介	2021-10-22
21	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
22	中欧养老产业混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
23	中欧养老产业混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2021-12-16
24	中欧基金管理有限公司关于调整中欧养老产业混合型证券投资基金大额申购、转换转入、定期定额投资限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中欧养老产业混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧养老产业混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧养老产业混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧养老产业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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、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

二〇二二年三月三十一日