

中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 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：2023 年 8 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 2023 年 08 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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56

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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12	投资组合报告附注.....	57
§ 8	基金份额持有人信息	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	59
§ 9	开放式基金份额变动	59
§ 10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4	基金投资策略的改变.....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8	其他重大事件.....	63
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§ 12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录.....	64
12.2	存放地点.....	64
12.3	查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧创新成长灵活配置混合	
基金主代码	005275	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 26 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	1,869,615,057.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	005275	005276
报告期末下属分级基金的份额总额	1,265,441,788.13 份	604,173,269.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格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	<p>本基金持续跟踪宏观经济面、政策面等重要指标，进行自上而下宏观分析，并有机结合市场环境趋势分析，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。本基金为混合型基金，长期来看整体将积极配置于股票类资产，并根据市场环境动态调整。</p> <p>宏观经济面的主要指标：包括但不限于国民生产总值、居民消费价值指数、工业增加值、固定资产投资总量及增速、社会消费品零售总额及增长率、进出口额及增长率、发电量、PMI 等主要宏观经济统计数据；</p> <p>政策面的主要指标：包括但不限于货币政策、财政政策、资本市场相关的各项政策、经济各领域中改革、转型推进等相关政策等</p> <p>市场环境趋势分析的主要指标：包括但不限于市场资金面趋势、市场估值水平、市场情绪、开户数、市场仓位水平等；</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×50%+恒生指数收益率×10%+中债综合债券指数收益率×40%
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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C
本期已实现收益	-159,436,648.25	-77,092,384.94
本期利润	-53,286,688.89	-28,811,915.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0416	-0.0467
本期加权平均净值利润率	-2.80%	-3.27%
本期基金份额净	-2.92%	-3.31%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	164,162,889.07	42,108,087.88
期末可供分配基金份额利润	0.1297	0.0697
期末基金资产净值	1,815,840,368.14	831,921,788.61
期末基金份额净值	1.4349	1.3770
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	43.49%	37.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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

中欧创新成长灵活配置混合 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	3.05%	0.82%	0.06%	0.57%	2.99%	0.25%
过去三个月	-4.07%	0.82%	-3.03%	0.49%	-1.04%	0.33%
过去六个月	-2.92%	0.84%	1.34%	0.48%	-4.26%	0.36%
过去一年	-19.86%	1.11%	-3.99%	0.58%	-15.87%	0.53%
过去三年	-19.39%	1.41%	1.52%	0.68%	-20.91%	0.73%

自基金合同生效起 至今	43.49%	1.43%	4.21%	0.76%	39.28%	0.67%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*50%+中债综合债券指数收益率*40%+恒生指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

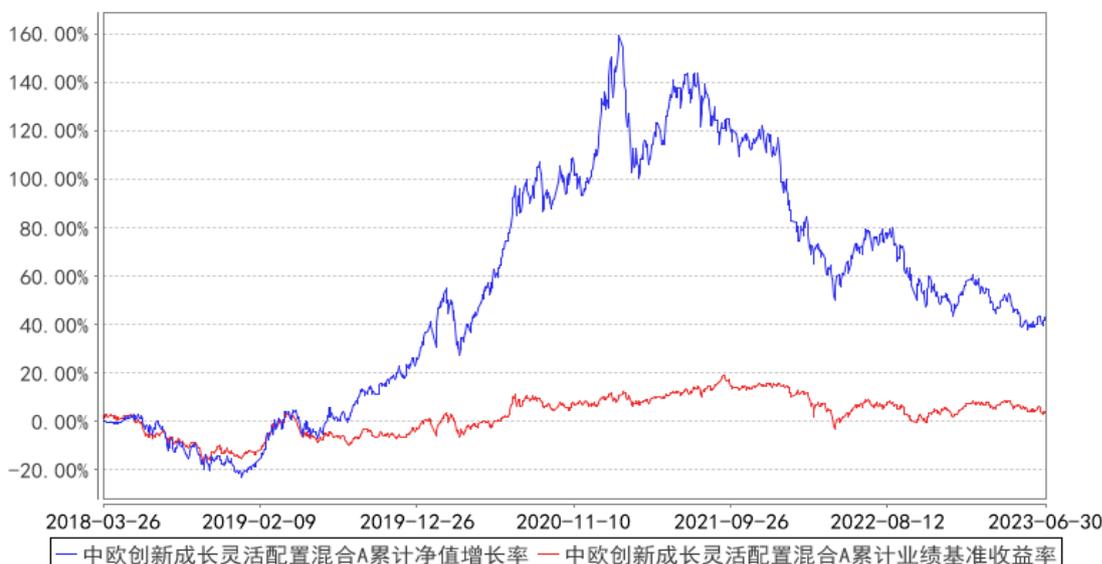
中欧创新成长灵活配置混合 C

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	2.99%	0.82%	0.06%	0.57%	2.93%	0.25%
过去三个月	-4.26%	0.82%	-3.03%	0.49%	-1.23%	0.33%
过去六个月	-3.31%	0.84%	1.34%	0.48%	-4.65%	0.36%
过去一年	-20.49%	1.11%	-3.99%	0.58%	-16.50%	0.53%
过去三年	-21.30%	1.41%	1.52%	0.68%	-22.82%	0.73%
自基金合同生效起 至今	37.70%	1.43%	4.21%	0.76%	33.49%	0.67%

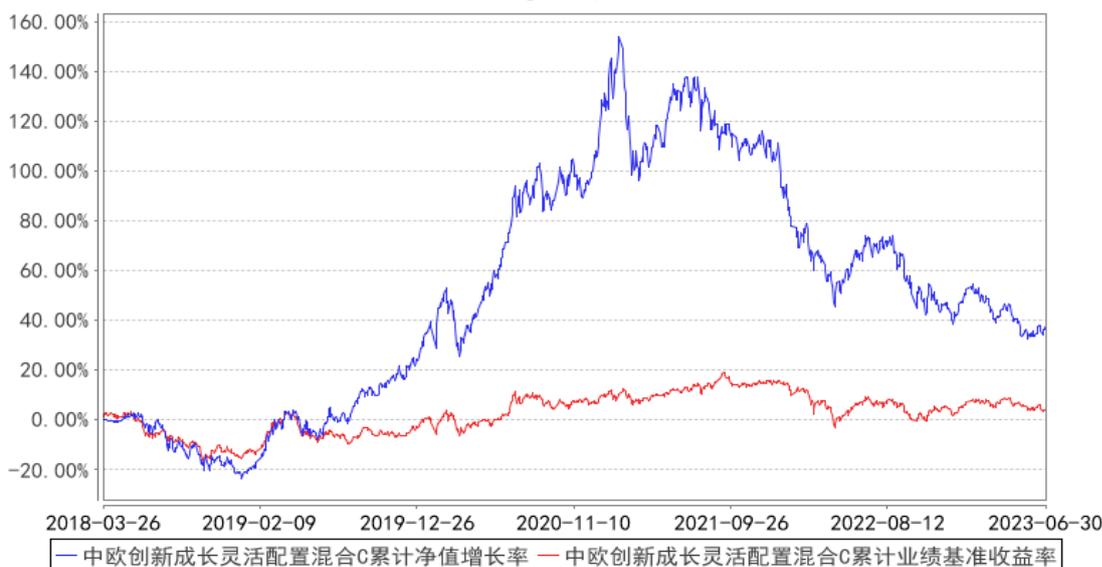
注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*50%+中债综合债券指数收益率*40%+恒生指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧创新成长灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧创新成长灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公

司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 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		
尹为醇	基金经理	2021-03-20	-	11 年	历任国泰君安证券研究员，海通证券投资经理，申港证券投资经理，深圳天风天成资产部门经理。2019-10-09 加入中欧基金管理有限公司，历任高级研究员、投资助理、基金经理助理。
王培	权益投决会副主席 / 投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2018-03-26	-	15 年	历任国泰君安证券研究所助理研究员，银河基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监。2016-02-18 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理、权益投决会委员。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
王培	公募基金	6	16,141,712,529.78	2017 年 7 月 26 日
	私募资产管理计划	2	1,073,094,790.31	2021 年 8 月 30 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	17,214,807,320.09	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，王培离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1 只，离任时间：2023-05-12；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1 只，离任时间：2023-05-04。

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 69 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，在经历 1 季度经济快速恢复后，2 季度很多行业需求边际走弱，国内经济无论消费或是投资都相对乏善可陈，市场更偏向于主题和政策相关的投资方向。主要股指窄幅震荡下跌，小市值占优，主题类股票涨幅较好，代表小市值的国证 2000 指数上涨 7.08%，沪深 300 指数下跌 0.75%。板块表现上，同步于经济周期，1 季度初期顺周期和消费类公司表现较好，后期随着经济指标逐步回落叠加上 AI 主题的兴起，2 季度 AI 相关的板块仍出现阶段性大幅上涨，并伴随板块内快速轮动，后期又逐步向机器人、智能驾驶等方向进行扩散；消费、医药和新能源的低迷叠加传统周期性行业的疲软，使得红利高股息策略也有所表现。受外围影响更大的香港市场整体表现更为弱势，但结构和 A 股类似。上半年以来本基金一直保持着相对较高的仓位，其中，增持了科技行业的持仓，并对医药和顺周期行业做了一些持仓的优化。

业绩表现方面，本基金年初就沿着经济复苏的角度做了配置，随着经济数据走弱同步产生回撤，上半年本基金整体表现不够理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-2.92%，同期业绩比较基准收益率为 1.34%；基金 C 类份额净值增长率为-3.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，本基金认为，海外市场尤其是美国加息进入尾声，国内政策开始发力，同时消费者信心逐步修复，几个因素叠加，股票市场预期会有较好表现。当然，需要观察经济的实际复苏情况，需要寻找一些处于修复阶段的行业和公司。同时，本轮科技创新的脚步相较过去来看，速度会更快，方式也会更加新颖，需要本基金保持高度的敏感性。

最近两年，A 股市场中机构重仓的行业和个股出现了一定程度的调整，同时也能看到，过去几年大家投资较多的新能源和 CXO 等行业出现了基本面恶化的趋势，从资金的选择来看，也更多选择了相对价值的高股息类资产，以及相对新颖的主题类资产。从结果来分析，不难看出，过往的投资主线已经受到挑战，在新时代背景下，需要重新寻找新的投资范式。本基金认为，随着全面信息化时代的到来，随着量化产品在金融行业不断应用和迭代，投资者在投资决策层面的投资逻辑在趋于一致。主动股票投资需要在更长的时间维度去思考，并尽量降低交易损耗，这也非常考验对基本面和社会研究的深度。

下半年甚至更长时间维度上，本基金认为需要对新事物的敏感度高度提升，由于传统经济的发展或多或少都到了瓶颈阶段，而新能源的渗透率提升最快的时期也已经过去，整个社会急需新的内生变量。因此，面临各种新生事物，如 AI、人形机器人、常温超导材料等，都被寄予厚望，但是由于技术还非常不成熟，大多数主题投资都需要擦亮双眼。

目前来看，政策和主题主导的股票市场可能还会继续运行一段时间，而这种市场风格的转变取决于是否有一大批基本面主导的公司在中长期维度给投资者带来信心。

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、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲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验。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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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的真实、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创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	79,670,427.72	174,210,378.15
结算备付金		12,237,883.31	5,301,426.35
存出保证金		630,846.30	737,107.18

交易性金融资产	6.4.7.2	2,583,575,410.63	2,583,899,006.30
其中：股票投资		2,463,848,099.23	2,583,899,006.30
基金投资		-	-
债券投资		119,727,311.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	27,779,876.21
应收股利		1,987,079.94	-
应收申购款		570,221.47	879,945.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,678,671,869.37	2,792,807,739.49
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		22,457,149.22	3.26
应付赎回款		1,047,863.43	4,252,060.47
应付管理人报酬		3,224,856.52	3,615,637.24
应付托管费		537,476.09	602,606.22
应付销售服务费		540,507.90	609,258.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14.45	12.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,101,845.01	2,600,096.40
负债合计		30,909,712.62	11,679,674.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,869,615,057.29	1,904,328,456.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	778,147,099.46	876,799,609.20
净资产合计		2,647,762,156.75	2,781,128,065.37

负债和净资产总计		2,678,671,869.37	2,792,807,739.49
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,869,615,057.29 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.4349 元，基金份额总额 1,265,441,788.13 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.3770 元，基金份额总额 604,173,269.16 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-54,284,365.39	-935,237,295.06
1. 利息收入		353,389.48	652,883.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	345,350.38	652,883.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,039.10	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-209,239,367.30	-377,280,071.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-235,316,942.85	-405,706,102.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	671,449.18	1,500,843.08
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	25,406,126.37	26,925,188.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	154,430,428.76	-559,638,942.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以	6.4.7.16	171,183.67	1,028,836.42

“-”号填列)			
减：二、营业总支出		27,814,239.04	37,376,812.08
1. 管理人报酬		20,734,619.54	28,096,743.13
2. 托管费		3,455,769.92	4,682,790.51
3. 销售服务费		3,499,622.76	4,466,101.24
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5.27	-
8. 其他费用	6.4.7.18	124,221.55	131,177.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-82,098,604.43	-972,614,107.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-82,098,604.43	-972,614,107.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-82,098,604.43	-972,614,107.14

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,904,328,456. 17	-	876,799,609.20	2,781,128,065.3 7
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,904,328,456. 17	-	876,799,609.20	2,781,128,065.3 7
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,713,398.88	-	-98,652,509.74	-133,365,908.62
（一）、综合收益	-	-	-82,098,604.43	-82,098,604.43

总额				
(二)、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)	-34,713,398.88	-	-16,553,905.31	-51,267,304.19
其中: 1. 基金申购款	187,692,170.55	-	89,254,082.75	276,946,253.30
2. 基金赎回款	-222,405,569.43	-	-105,807,988.06	-328,213,557.49
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,869,615,057.29	-	778,147,099.46	2,647,762,156.75
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,597,039,905.57	-	3,005,372,724.35	5,602,412,629.92
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,597,039,905.57	-	3,005,372,724.35	5,602,412,629.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-590,808,882.06	-	-1,456,805,497.50	-2,047,614,379.56
(一)、综合收益总额	-	-	-972,614,107.14	-972,614,107.14

(二)、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)	-590,808,882.06	-	-484,191,390.36	-1,075,000,272.42
其中：1. 基金申购款	213,536,193.13	-	158,428,008.21	371,964,201.34
2. 基金赎回款	-804,345,075.19	-	-642,619,398.57	-1,446,964,473.76
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,006,231,023.51	-	1,548,567,226.85	3,554,798,250.36

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

中欧创新成长灵活配置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[2017]第 1720 号《关于准予中欧创新成长灵活配置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《中欧创新成长灵活配置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。经向中国证监会备案,《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,415,132,504.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 149,076.38 份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，各类别基金份额之间可以互相转换。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记

结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	79,670,427.72
等于: 本金	79,656,159.24
加: 应计利息	14,268.48
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	79,670,427.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,422,333,385.04	-	2,463,848,099.23	41,514,714.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	117,152,920.00	1,315,088.20	119,727,311.40	1,259,303.20

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	117,152,920.00	1,315,088.20	119,727,311.40	1,259,303.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,539,486,305.04	1,315,088.20	2,583,575,410.63	42,774,017.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,082.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,921,581.74
其中：交易所市场	2,921,581.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	119,671.58
应付转出费	1.52
合计	3,101,845.01

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧创新成长灵活配置混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,280,613,195.47	1,280,613,195.47
本期申购	138,166,519.67	138,166,519.67
本期赎回（以“-”号填列）	-153,337,927.01	-153,337,927.01
本期末	1,265,441,788.13	1,265,441,788.13

中欧创新成长灵活配置混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	623,715,260.70	623,715,260.70
本期申购	49,525,650.88	49,525,650.88
本期赎回（以“-”号填列）	-69,067,642.42	-69,067,642.42
本期末	604,173,269.16	604,173,269.16

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧创新成长灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	324,752,805.47	287,556,286.20	612,309,091.67
本期利润	-159,436,648.25	106,149,959.36	-53,286,688.89
本期基金份额交易产生的变动数	-1,153,268.15	-7,470,554.62	-8,623,822.77
其中：基金申购款	28,264,570.92	39,688,472.38	67,953,043.30
基金赎回款	-29,417,839.07	-47,159,027.00	-76,576,866.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,162,889.07	386,235,690.94	550,398,580.01

中欧创新成长灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,316,062.20	143,174,455.33	264,490,517.53
本期利润	-77,092,384.94	48,280,469.40	-28,811,915.54
本期基金份额交易产生的变动数	-2,115,589.38	-5,814,493.16	-7,930,082.54
其中：基金申购款	6,273,855.29	15,027,184.16	21,301,039.45
基金赎回款	-8,389,444.67	-20,841,677.32	-29,231,121.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,108,087.88	185,640,431.57	227,748,519.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	290,452.73
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	49,899.04
其他	4,998.61
合计	345,350.38

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	3,631,411,529.47
减：卖出股票成本总额	3,856,788,336.16
减：交易费用	9,940,136.16
买卖股票差价收入	-235,316,942.85

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	671,449.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	671,449.18

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	25,406,126.37
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	25,406,126.37

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	154,430,428.76
股票投资	153,171,125.56
债券投资	1,259,303.20
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	154,430,428.76

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	163,058.85
基金转换费收入	8,124.82
合计	171,183.67

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,306.17
账户维护费	18,000.00

其他	600.00
证券组合费	5,136.43
合计	124,221.55

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：
WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

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、登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、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

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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	333,797,820.05	4.65	644,555,787.30	7.69

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	244,332.05	4.78	11,627.32	0.40
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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	460,157.29	7.57	460,157.29	18.94

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,734,619.54	28,096,743.13
其中：支付销售机构的客户维护费	8,448,209.31	10,227,774.10

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,455,769.92	4,682,790.51

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧创新成长灵活配置 混合 A	中欧创新成长灵活配置 混合 C	合计
工商银行	-	46,175.55	46,175.55
国都证券	-	2,802.07	2,802.07
中欧财富	-	15,046.91	15,046.91
中欧基金	-	0.00	0.00
合计	-	64,024.53	64,024.53
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧创新成长灵活配置 混合 A	中欧创新成长灵活配置 混合 C	合计
工商银行	-	63,521.77	63,521.77
国都证券	-	3,435.13	3,435.13
中欧基金	-	78,000.80	78,000.80
合计	-	144,957.70	144,957.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，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：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，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划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

无。

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。

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。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧创新成长灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,168,326.13	0.09%	162,020.31	0.01%

份额单位：份

中欧创新成长灵活配置混合 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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	520,517.84	0.09%	520,517.84	0.08%

注：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 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6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	79,670,427.72	290,452.73	230,071,047.41	411,723.63

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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2023年6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	受限期	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
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301246	宏源药	2023年	6个月	新股流	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-

	业	3月10日		通受限						
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301292	海科新源	2023年6月	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-

		29 日								
30129 2	海科 新源	202 3 年 6 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
30129 3	三博 脑科	202 3 年 4 月 25 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
30130 1	川宁 生物	202 2 年 12 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
30130 5	朗坤 环境	202 3 年 5 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
30130 7	美利 信	202 3 年 4 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
30131 0	鑫宏 业	202 3 年 5 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-

301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

		16日		限						
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧	2023	6个月	新股	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

	科技	年 6 月 14 日		流 通 受 限						
30138 2	蜂 助 手	202 3 年 5 月 9 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
30138 6	未 来 电 器	202 3 年 3 月 21 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
30139 5	仁 信 新 材	202 3 年 6 月 21 日	1 个月 内（含 ）	新 股 未 上 市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
30139 5	仁 信 新 材	202 3 年 6 月 21 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
30139 9	英 特 科 技	202 3 年 5 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
30140 8	华 人 健 康	202 3 年 2 月	6 个月	新 股 流 通 受	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

		22 日		限						
30141 9	阿莱德	202 3 年 2 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
30142 8	世纪恒通	202 3 年 5 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
30143 9	泓淋电力	202 3 年 3 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
30148 6	致尚科技	202 3 年 6 月 30 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
30148 6	致尚科技	202 3 年 6 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
30148 8	豪恩汽电	202 3 年 6 月 26 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
30148	豪	202	6 个月	新	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

8	恩 汽 电	3 年 6 月 26 日		股 流 通 受 限						
60110 0	恒 立 液 压	202 3 年 1 月 10 日	6 个月	非 公 开 发 行 限 售	56.40	63.71	354,61 0	20,000,004.0 0	22,592,203.1 0	-
68814 6	中 船 派 瑞 特 气	202 3 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
68824 9	晶 合 集 成	202 3 年 4 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
68826 8	广 东 华 特 气 体	202 3 年 6 月 13 日	6 个月	大 宗 交 易 流 通 受 限	73.89	74.89	130,00 0	9,605,700.00	9,735,700.00	-
68826 8	广 东 华 特 气 体	202 3 年 6 月 15 日	6 个月	大 宗 交 易 流 通 受 限	74.78	74.87	80,000	5,982,400.00	5,989,600.00	-
68833	西	202	6 个月	新	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-

4	高院	3 年 6 月 9 日		股 流 通 受 限						
68835 2	顾 中 科 技	202 3 年 4 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
68836 1	中 科 飞 测	202 3 年 5 月 12 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
68842 9	时 创 能 源	202 3 年 6 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
68843 3	华 曙 高 科	202 3 年 4 月 7 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
68844 3	智 翔 金 泰	202 3 年 6 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
68846 9	中 芯 集 成	202 3 年 4 月	6 个月	新 股 流 通 受	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-

		28 日		限						
68847 2	阿特斯阳光电力	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流 通 受 限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
68847 8	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股 流 通 受 限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
68847 9	用友汽车信息科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股 流 通 受 限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
68848 4	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 流 通 受 限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
68850 7	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流 通 受 限	165.9 2	122.1 1	222	36,834.00	27,108.42	-
68851 2	慧智微电子	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股 流 通 受 限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

688523	航天环宇科技	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技股份	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科新材料	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件股份	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智	2023年	6个月	新股流	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-

	控	5月29日		通受限						
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思医学	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微电子	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

		31日		限						
688629	四川华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	1,075,400	8,284,598.00	7,495,538.00	-

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 2023 年 06 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 2023 年 06 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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在严格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，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性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，将风险控制可在可承受的范围内。

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上市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 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 2023 年 06 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提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	79,670,427.72	-	-	-	79,670,427.72
结算备付金	12,237,883.31	-	-	-	12,237,883.31
存出保证金	630,846.30	-	-	-	630,846.30
交易性金融资产	116,590,507.09	-	3,136,804.31	2,463,848,099.23	2,583,575,410.63
应收股利	-	-	-	1,987,079.94	1,987,079.94
应收申购款	-	-	-	570,221.47	570,221.47
资产总计	209,129,664.42	-	3,136,804.31	2,466,405,400.64	2,678,671,869.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,047,863.43	1,047,863.43
应付管理人报酬	-	-	-	3,224,856.52	3,224,856.52
应付托管费	-	-	-	537,476.09	537,476.09
应付清算款	-	-	-	22,457,149.22	22,457,149.22
应付销售服务费	-	-	-	540,507.90	540,507.90
应交税费	-	-	-	14.45	14.45
其他负债	-	-	-	3,101,845.01	3,101,845.01
负债总计	-	-	-	30,909,712.62	30,909,712.62
利率敏感度缺口	209,129,664.42	-	3,136,804.31	2,435,495,688.02	2,647,762,156.75
上年度末 2022 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	174,210,378.15	-	-	-	174,210,378.15
结算备付金	5,301,426.35	-	-	-	5,301,426.35
存出保证金	737,107.18	-	-	-	737,107.18
交易性金融资产	-	-	-	2,583,899,006.30	2,583,899,006.30
应收清算款	-	-	-	27,779,876.21	27,779,876.21
应收申购款	-	-	-	879,945.30	879,945.30
资产总计	180,248,911.68	-	-	2,612,558,827.81	2,792,807,739.49
负债					
应付清算款	-	-	-	3.26	3.26
应付赎回款	-	-	-	4,252,060.47	4,252,060.47
应付管理人报酬	-	-	-	3,615,637.24	3,615,637.24

应付托管费	-	-	-	602,606.22	602,606.22
应付销售服务费	-	-	-	609,258.35	609,258.35
应交税费	-	-	-	12.18	12.18
其他负债	-	-	-	2,600,096.40	2,600,096.40
负债总计	-	-	-	11,679,674.12	11,679,674.12
利率敏感度缺口	180,248,911.68	-	-	-2,600,879,153.69	2,781,128,065.37

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 2023 年 6 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 4.52%（2022 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（2022 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	233,123,412.84	-	233,123,412.84
应收股利	-	1,987,079.94	-	1,987,079.94
资产合计	-	235,110,492.78	-	235,110,492.78
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	235,110,492.78	-	235,110,492.78
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币 元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,231,620.20	-	15,231,620.20
资产合计	-	15,231,620.20	-	15,231,620.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	15,231,620.20	-	15,231,620.20

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	港币相对人民币贬值 5%	-11,656,170.64	-761,581.01
港币相对人民币升值 5%	11,656,170.64	761,581.01	

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	2,463,848,099.23	93.05	2,583,899,006.30	92.91
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	2,463,848,099.23	93.05	2,583,899,006.30	92.91

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	192,788,189.46	195,117,288.81
	业绩比较基准下降5%	-192,788,189.46	-195,117,288.81

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	2,418,778,238.09	2,534,077,313.44

第二层次	124,874,974.27	-
第三层次	39,922,198.27	49,821,692.86
合计	2,583,575,410.63	2,583,899,006.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	2,463,848,099.23	91.98
	其中：股票	2,463,848,099.23	91.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,727,311.40	4.47
	其中：债券	119,727,311.40	4.47
	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	91,908,311.03	3.43

8	其他各项资产	3,188,147.71	0.12
9	合计	2,678,671,869.37	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 233,123,412.84 元，占基金资产净值比例 8.80%。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	63,333,159.36	2.39
C	制造业	1,359,922,983.40	51.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	157,444,345.70	5.95
G	交通运输、仓储和邮政业	7,495,538.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	168,226,015.61	6.35
J	金融业	113,524,533.60	4.29
K	房地产业	83,415,545.00	3.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	226,878,912.79	8.57
N	水利、环境和公共设施管理业	165,742.27	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	339,632.66	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	49,978,278.00	1.89
	合计	2,230,724,686.39	84.25

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	29,526,409.50	1.12
消费者常用品	-	-
能源	13,599,573.79	0.51
金融	25,586,162.01	0.97
医疗保健	22,929,633.38	0.87
工业	-	-
信息技术	-	-

电信服务	140,363,433.77	5.30
公用事业	-	-
地产业	1,118,200.39	0.04
合计	233,123,412.84	8.80

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300012	华测检测	10,349,317	201,811,681.50	7.62
2	00700	腾讯控股	442,500	135,284,891.34	5.11
3	000333	美的集团	1,863,907	109,821,400.44	4.15
4	600031	三一重工	4,765,700	79,253,591.00	2.99
5	688012	中微公司	462,113	72,297,578.85	2.73
6	000063	中兴通讯	1,512,462	68,877,519.48	2.60
7	000999	华润三九	1,134,900	68,843,034.00	2.60
8	688111	金山办公	137,313	64,841,944.86	2.45
9	300033	同花顺	363,430	63,702,010.40	2.41
10	002472	双环传动	1,691,197	61,390,451.10	2.32
11	600276	恒瑞医药	1,100,460	52,712,034.00	1.99
12	600309	万华化学	598,600	52,581,024.00	1.99
13	600673	东阳光	6,931,800	49,978,278.00	1.89
14	000028	国药一致	1,083,420	47,247,946.20	1.78
15	603338	浙江鼎力	789,500	44,219,895.00	1.67
16	600612	老凤祥	626,300	43,765,844.00	1.65
17	002154	报喜鸟	7,677,000	42,377,040.00	1.60
18	688269	凯立新材	659,863	42,092,660.77	1.59
19	002867	周大生	2,358,300	41,930,574.00	1.58
20	601607	上海医药	1,851,959	41,502,401.19	1.57
21	600511	国药股份	1,064,500	41,355,825.00	1.56
22	600938	中国海油	1,458,800	26,433,456.00	1.00
22	00883	中国海洋石油	1,317,000	13,599,573.79	0.51
23	600285	羚锐制药	2,421,600	38,890,896.00	1.47
24	300146	汤臣倍健	1,618,313	38,807,145.74	1.47
25	001979	招商蛇口	2,865,700	37,340,071.00	1.41
26	002371	北方华创	117,100	37,196,815.00	1.40
27	600750	江中药业	1,695,700	37,186,701.00	1.40
28	002959	小熊电器	437,200	36,506,200.00	1.38
29	000425	徐工机械	5,376,400	36,398,228.00	1.37
30	600048	保利发展	2,708,700	35,294,361.00	1.33
31	000521	长虹美菱	4,238,396	32,381,345.44	1.22
32	09868	小鹏汽车-W	640,500	29,526,409.50	1.12

33	300031	宝通科技	1,123,291	27,767,753.52	1.05
34	600570	恒生电子	602,300	26,675,867.00	1.01
35	688268	华特气体	342,418	26,415,405.14	1.00
36	002050	三花智控	871,600	26,374,616.00	1.00
37	600332	白云山	815,800	26,007,704.00	0.98
38	03988	中国银行	8,838,000	25,586,162.01	0.97
39	601658	邮储银行	5,106,700	24,971,763.00	0.94
40	600572	康恩贝	3,637,700	24,918,245.00	0.94
41	300347	泰格医药	385,355	24,870,811.70	0.94
42	601939	建设银行	3,969,770	24,850,760.20	0.94
43	601899	紫金矿业	2,184,828	24,841,494.36	0.94
44	601100	恒立液压	354,610	22,592,203.10	0.85
45	603039	泛微网络	267,100	21,803,373.00	0.82
46	688323	瑞华泰	869,257	20,810,012.58	0.79
47	688768	容知日新	249,173	19,901,447.51	0.75
48	301039	中集车辆	1,498,700	19,827,801.00	0.75
49	301190	善水科技	1,022,865	19,219,633.35	0.73
50	000950	重药控股	2,617,400	17,615,102.00	0.67
51	300718	长盛轴承	754,485	16,787,291.25	0.63
52	603927	中科软	387,500	14,942,000.00	0.56
53	600060	海信视像	576,900	14,278,275.00	0.54
54	000404	长虹华意	2,041,100	14,124,412.00	0.53
55	600587	新华医疗	399,700	14,121,401.00	0.53
56	03320	华润医药	2,179,500	13,704,485.90	0.52
57	600422	昆药集团	603,410	12,502,655.20	0.47
58	600489	中金黄金	1,167,300	12,058,209.00	0.46
59	688059	华锐精密	132,450	11,092,687.50	0.42
60	688031	星环科技	82,029	10,929,543.96	0.41
61	600383	金地集团	1,495,300	10,781,113.00	0.41
62	600713	南京医药	1,789,300	9,608,541.00	0.36
63	01099	国药控股	408,400	9,225,147.48	0.35
64	600329	达仁堂	200,900	9,018,401.00	0.34
65	601298	青岛港	1,075,400	7,495,538.00	0.28
66	300009	安科生物	630,800	6,308,000.00	0.24
67	00941	中国移动	86,000	5,078,542.43	0.19
68	000568	泸州老窖	11,900	2,493,883.00	0.09
69	688249	晶合集成	74,041	1,391,155.62	0.05
70	688029	南微医学	15,682	1,279,023.92	0.05
71	688472	阿特斯	62,602	1,141,108.20	0.04
72	03900	绿城中国	154,500	1,118,200.39	0.04
73	688349	三一重能	32,650	1,051,983.00	0.04
74	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.04
75	688469	中芯集成	137,994	778,837.98	0.03

76	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.03
77	688146	中船特气	10,101	422,147.43	0.02
78	301325	曼恩斯特	3,636	413,937.80	0.02
79	688484	南芯科技	10,071	410,399.28	0.02
80	688141	杰华特	9,946	388,888.60	0.01
81	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.01
82	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.01
83	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
84	688507	索辰科技	2,213	287,192.75	0.01
85	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.01
86	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.01
87	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
88	688552	航天南湖	9,556	239,960.00	0.01
89	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.01
90	301307	美利信	6,865	230,766.00	0.01
91	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.01
92	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.01
93	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.01
94	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.01
95	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.01
96	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.01
97	688416	恒烁股份	2,147	168,539.50	0.01
98	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
99	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.01
100	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
101	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.01
102	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
103	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
104	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
105	688512	慧智微	7,209	147,986.20	0.01
106	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
107	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.01
108	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
109	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
110	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
111	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.00
112	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
113	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
114	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.00
115	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.00
116	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
117	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.00
118	688251	井松智能	3,392	103,456.00	0.00

119	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
120	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
121	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
122	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.00
123	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
124	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
125	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
126	301308	江波龙	819	83,341.44	0.00
127	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
128	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.00
129	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
130	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
131	688448	磁谷科技	1,985	67,946.55	0.00
132	301267	华夏眼科	1,006	61,315.70	0.00
133	688281	华秦科技	288	58,320.00	0.00
134	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
135	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
136	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.00
137	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
138	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
139	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
140	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
141	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
142	301389	隆扬电子	1,269	23,070.42	0.00
143	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
144	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
145	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
146	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
147	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
148	301382	蜂助手	480	16,180.80	0.00
149	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
150	301115	建科股份	685	15,659.10	0.00
151	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
152	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
153	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
154	301360	荣旗科技	140	13,034.08	0.00
155	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
156	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
157	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
158	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
159	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
160	301428	世纪恒通	289	9,143.40	0.00
161	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00

162	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
163	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
164	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
165	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
166	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
167	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
168	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
169	300496	中科创达	80	7,708.00	0.00
170	000888	峨眉山 A	200	2,292.00	0.00
171	002475	立讯精密	60	1,947.00	0.00
172	000963	华东医药	18	780.66	0.00
173	002979	雷赛智能	30	712.80	0.00
174	300627	华测导航	20	649.40	0.00
175	600588	用友网络	14	287.00	0.00
176	000625	长安汽车	10	129.30	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	00700	腾讯控股	152,515,500.00	5.48
2	603259	药明康德	115,101,676.46	4.14
3	688012	中微半导体设备	99,294,959.56	3.57
4	688111	金山办公	88,082,078.00	3.17
5	600938	中国海油	52,846,838.00	1.90
5	00883	中国海洋石油	26,512,564.53	0.95
6	300033	同花顺	69,449,640.80	2.50
7	000063	中兴通讯	67,584,715.68	2.43
8	600309	万华化学	66,989,902.00	2.41
9	000999	华润三九	63,720,062.15	2.29
10	03690	美团-W	57,816,905.88	2.08
11	000651	格力电器	55,745,926.00	2.00
12	300496	中科创达	55,282,441.46	1.99
13	002867	周大生	53,231,726.22	1.91
14	600276	恒瑞医药	52,919,841.96	1.90
15	002415	海康威视	49,964,812.92	1.80
16	000963	华东医药	48,436,262.23	1.74
17	002154	报喜鸟	47,442,115.00	1.71
18	03988	中国银行	26,515,940.77	0.95
18	601988	中国银行	19,168,026.00	0.69
19	601117	中国化学	43,859,716.04	1.58

20	601390	中国中铁	42,797,928.00	1.54
----	--------	------	---------------	------

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	688122	西部超导	111,571,153.68	4.01
2	601899	紫金矿业	110,072,874.99	3.96
3	603259	药明康德	107,616,260.98	3.87
4	300347	泰格医药	83,932,754.82	3.02
5	002475	立讯精密	82,580,904.65	2.97
6	000651	格力电器	82,028,045.00	2.95
7	600588	用友网络	79,533,277.48	2.86
8	002472	双环传动	78,815,683.15	2.83
9	688116	天奈科技	75,652,415.35	2.72
10	603486	科沃斯	64,749,031.20	2.33
11	002959	小熊电器	62,274,962.57	2.24
12	688111	金山办公	58,813,378.58	2.11
13	002271	东方雨虹	58,651,633.88	2.11
14	600519	贵州茅台	56,169,042.83	2.02
15	601100	恒立液压	53,640,128.28	1.93
16	03690	美团-W	53,008,672.13	1.91
17	601689	拓普集团	50,542,027.11	1.82
18	603596	伯特利	50,232,765.95	1.81
19	688268	广东华特气体	49,853,488.15	1.79
20	300496	中科创达	45,769,058.00	1.65

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	3,583,566,303.53
卖出股票收入（成交）总额	3,631,411,529.47

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	116,590,507.09	4.40
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）	3,136,804.31	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,727,311.40	4.52

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	019688	22 国债 23	1,153,000	116,590,507.09	4.40
2	118033	华特转债	22,680	3,136,804.31	0.12

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 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，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、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	630,846.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,987,079.94
4	应收利息	-
5	应收申购款	570,221.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,188,147.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
中欧创新成长灵活配置混合	71,363	17,732.46	260,981,338.75	20.62%	1,004,460,449.38	79.38%

A						
中欧创新成长灵活配置混合 C	128,597	4,698.19	365,646.56	0.06%	603,807,622.60	99.94%
合计	199,960	9,349.95	261,346,985.31	13.98%	1,608,268,071.98	86.02%

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	中欧创新成长灵活配置混合 A	4,476,820.68	0.35%
	中欧创新成长灵活配置混合 C	522,075.98	0.09%
	合计	4,998,896.66	0.27%

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	中欧创新成长灵活配置混合 A	>100
	中欧创新成长灵活配置混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧创新成长灵活配置混合 A	>100
	中欧创新成长灵活配置混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧创新成长灵活配置混合 A	中欧创新成长灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2018年3月26日) 基金份额总额	2,039,389,951.69	105,742,552.93
本报告期期初基金份额总额	1,280,613,195.47	623,715,260.70
本报告期基金总申购份额	138,166,519.67	49,525,650.88
减：本报告期基金总赎回份额	153,337,927.01	69,067,642.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份	1,265,441,788.13	604,173,269.16

额总额		
-----	--	--

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

报告期内本基金未召开持有人大会。

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，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
财通证券	1	1,284,247,571.11	17.89	939,159.31	18.37	-
民生证券	2	1,235,440,750.97	17.21	849,384.30	16.62	-
德邦证券	2	1,074,988,496.19	14.98	786,146.99	15.38	-
华创证券	1	908,401,232.46	12.65	598,366.95	11.71	-
中泰证券	2	590,498,439.19	8.23	431,834.89	8.45	-
兴业证券	1	584,899,855.01	8.15	427,731.45	8.37	-
东北证券	2	362,801,952.71	5.05	259,361.48	5.07	-
国都证券	3	333,797,820.05	4.65	244,332.05	4.78	-
中金公司	1	312,933,666.30	4.36	228,850.52	4.48	-
西南证券	1	207,653,939.43	2.89	151,857.19	2.97	-
中信建投	2	128,800,156.40	1.79	94,191.68	1.84	-
浙商证券	1	82,801,820.19	1.15	60,550.38	1.18	-
国泰君安	1	52,272,828.31	0.73	26,136.42	0.51	-
国信证券	1	9,845,894.69	0.14	7,200.22	0.14	-
华泰证券	2	9,059,967.81	0.13	6,625.03	0.13	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

注：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。

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	
	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(%)
财通证券	115,528,515.15	100.00	56,320,000.00	100.00	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：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。

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	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金投资恒立液压(601100)非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2023-01-12
2	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
4	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
5	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
7	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
9	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
10	中欧创新成长灵活配置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	2023-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧创新成长灵活配置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

基金管理人的办公场所。

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办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日