

中欧小盘成长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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券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	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 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	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62

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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12	投资组合报告附注.....	62
§ 8	基金份额持有人信息	63
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 9	开放式基金份额变动	64
§ 10	重大事件揭示	65
10.1	基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4	基金投资策略的改变.....	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8	其他重大事件.....	66
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录.....	67
12.2	存放地点.....	67
12.3	查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧小盘成长混合型证券投资基金	
基金简称	中欧小盘成长混合	
基金主代码	015880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 28 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	644,110,916.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
下属分级基金的交易代码	015880	015881
报告期末下属分级基金的份额总额	357,914,045.87 份	286,196,870.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过精选股票，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 小盘股票的定义</p> <p>对于中国 A 股市场和香港股票市场，本基金将股票总市值处于国证 2000 指数成分股的总市值区间内的股票定义为小盘股票，并每半年根据指数变动进行相应调整。</p> <p>在此期间，对于未纳入的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其总市值或预计总市值（如对于未上市新股）能够满足以上标准，也将纳入小盘股票的备选投资范围。遇到停牌或暂停交易的股票，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算其总市值。</p> <p>(2) 成长的定义</p> <p>本基金将在上述定义的小盘股票中，采用量化选股模型，精选资产规模、盈利能力、市场占有率持续高增长的公司。对于成长性本基金将分别对公司资产规模、盈利能力、市场占有率的维度的增长进行重点考量并打分，同时综合评估，选择综合打分高于行业平均的优质上市公司。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略，力求获取高于业绩比较基准的回报。</p>
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益

	率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%
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。本基金如投资港股通标的的股票，还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	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	罗琦
	联系电话	021-68609600	020-66338888
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95575
传真		021-33830351	020-87553363-6847
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码		200120	510627
法定代表人		窦玉明	林传辉

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)	
	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
本期已实现收益	11,149,254.62	5,048,082.17
本期利润	33,063,882.14	19,447,455.41
加权平均基金份额本期利润	0.1062	0.1003

本期加权平均净值利润率	10.66%	10.12%
本期基金份额净值增长率	12.12%	11.80%
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	2,525,582.75	306,824.43
期末可供分配基金份额利润	0.0071	0.0011
期末基金资产净值	367,120,957.15	291,799,205.52
期末基金份额净值	1.0257	1.0196
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	2.57%	1.96%

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

中欧小盘成长混合 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	3.62%	0.92%	1.38%	1.03%	2.24%	-0.11%
过去三个月	1.91%	0.92%	-2.34%	0.93%	4.25%	-0.01%
过去六个月	12.12%	0.91%	6.35%	0.88%	5.77%	0.03%
过去一年	2.58%	1.04%	-0.37%	1.07%	2.95%	-0.03%

自基金合同生效起 至今	2.57%	1.03%	-0.90%	1.08%	3.47%	-0.05%
----------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。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。

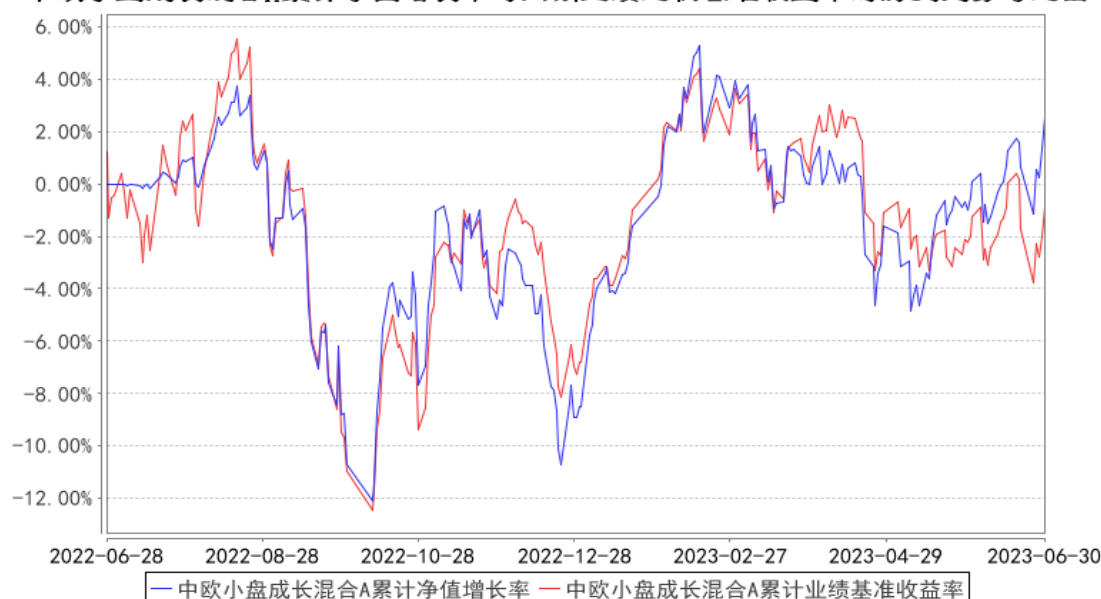
中欧小盘成长混合 C

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	3.57%	0.92%	1.38%	1.03%	2.19%	-0.11%
过去三个月	1.76%	0.92%	-2.34%	0.93%	4.10%	-0.01%
过去六个月	11.80%	0.91%	6.35%	0.88%	5.45%	0.03%
过去一年	1.97%	1.04%	-0.37%	1.07%	2.34%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	1.96%	1.03%	-0.90%	1.08%	2.86%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率*90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。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

中欧小盘成长混合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



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 6 月 28 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。



注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 6 月 28 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

§ 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		
钱亚婷	基金经理	2022-06-28	-	7 年	2016-04-05 加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师、基金经理助理。

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《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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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

回顾上半年，市场先扬后抑，波动加剧。在宏观经济实现恢复性增长的背景下，各行业景气程度较为分化。非制造业 PMI 连续处于荣枯线上方，反映了消费和服务业的景气复苏强于制造业。在我国产业结构转型，高质量发展的大背景下，决策层对于经济刺激的政策比较克制，没有进行大规模的低效投资，因此上游资源品需求不足，PPI 相对较弱，财政政策相对更加向战略新兴产业倾斜。展望下半年，我们当前的观点是“聚焦实业复苏，在短期波动中逢低布局”。

本基金是以国证 2000 指数为主要参考标准配置基金资产，投资于本基金界定的小盘成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，整体组合的平均市值比基准更偏小，且以业绩成长为主要的选股逻辑。上半年里，我们按照“在小市值里寻找未来有业绩增长潜力，同时目前没有得到市

场的充分认知的公司“的选股思路，在不同行业里用多个逻辑链条进行选股，一是关注前两年受到客观因素业绩下滑，今年恢复性增长的机会；二是寻找子赛道处于周期底部，供给存在出清，格局变优的机会；三是筛选存在技术优势，具有国产替代空间或者符合新产业发展的机会。今年很多基本面驱动模型超额收益不够理想，相对而言量价策略更加具有优势。但我们认为，每一只投资风格的相对占优都是具有周期性的，是特定的宏观环境和市场资金结构互相影响的结果，此时我们更应该深入挖掘自己的优势，积累并迭代基本面模型。当然，也需要在自己可控的范围内，把风控做好，而不是简单的越跌越买。总而言之，在方法论方面，我们需要根据自己的禀赋，挖掘自己擅长的方向。仅就中欧量化而言，我们的禀赋是基本面的信息和逻辑，相信优秀企业的基本面业绩，会带来合理的股价回报。

投资操作层面，本基金的行业配置没有做严格约束，相对高配了机械设备行业，通过个股配置上的分散度和逻辑链条的差异度来分散风险，并实现了相对合理的跟踪误差。这里的风险是指投资收益偏离业绩比较基准主要指数——国证 2000 指数的风险，用跟踪误差来衡量。同时，我们加深了行业和个股基本面的研究深度，这有利于我们进一步提高投资的集中度。目前我们的投资分散程度跟传统量化策略比较相似，相比于主动基金还是过于分散。因此，在更深入理解基本面的基础上，提高投资的集中度，才能进一步提高超额收益的锐度。

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 12.12%，同期业绩比较基准收益率为 6.35%；基金 C 类份额净值增长率为 11.80%，同期业绩比较基准收益率为 6.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济可能会维持“弱复苏”的趋势，在权益资产中我们相对看好小盘成长风格。从历史复盘来看，大小盘风格和经济复苏的强度以及主导复苏的产业较为相关。当经济强劲复苏、传统产业主导的时期，大盘风格相对更加占优；当经济弱复苏、新兴产业技术进步较快时小盘风格相对更加占优。当前时期，经济复苏力度较弱，同时人工智能、新能源产业技术升级、工业自动化等新兴产业的活跃度高于传统周期产业，货币政策较为宽松，在这种宏观环境下我们认为小盘风格可能会更加占优，也更受益于经济转型、高质量发展的产业支持政策。

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，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧小盘成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，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、基金费用开支及利润分配等方面，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约定进行。

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小盘成长混合型证券投资基金 2023 年中期报告中的财务指标、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：中欧小盘成长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	42,101,543.28	14,110,874.90
结算备付金		3,723,028.80	-
存出保证金		1,405,046.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	615,075,462.75	372,234,240.11
其中：股票投资		601,732,490.54	354,958,385.25
基金投资		-	-
债券投资		13,342,972.21	17,275,854.86
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		2,999,995.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,916,768.25	337,735.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		677,221,845.00	386,682,850.64
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		3,000,328.51	1,000,385.40
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,069,190.31	301,018.82

应付管理人报酬		751,731.02	508,412.34
应付托管费		75,173.09	50,841.26
应付销售服务费		125,156.54	69,733.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		621.59	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	8,279,481.27	120,000.00
负债合计		18,301,682.33	2,050,390.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	644,110,916.41	420,906,982.18
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,809,246.26	-36,274,522.38
净资产合计		658,920,162.67	384,632,459.80
负债和净资产总计		677,221,845.00	386,682,850.64

注：1. 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 644,110,916.41 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0257 元，基金份额总额 357,914,045.87 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0196 元，基金份额总额 286,196,870.54 份。

2. 本基金基金合同于 2022 年 06 月 28 日生效，上年度可比期间自 2022 年 06 月 28 日至 2022 年 06 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧小盘成长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 6 月 28 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		57,330,082.62	-10,731.53
1. 利息收入		73,331.15	46,412.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	73,331.15	39,724.80
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		-	6,687.49
证券出借利息收 入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		19,356,593.54	-8,576.74

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	14,529,969.32	-8,576.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	207,129.60	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	10,856.28	-
股利收益	6.4.7.14	4,608,638.34	-
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	36,314,000.76	-48,567.08
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	1,586,157.17	-
减：二、营业总支出		4,818,745.07	69,389.64
1. 管理人报酬		3,735,963.44	53,103.56
2. 托管费		373,596.29	5,310.35
3. 销售服务费		571,873.66	8,890.16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		47,984.93	-
其中：卖出回购金融资产 支出		47,984.93	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		66.60	-
8. 其他费用	6.4.7.18	89,260.15	2,085.57
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		52,511,337.55	-80,121.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		52,511,337.55	-80,121.17
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		52,511,337.55	-80,121.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧小盘成长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)	420,906,982.18	-	-36,274,522.38	384,632,459.80
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)	420,906,982.18	-	-36,274,522.38	384,632,459.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	223,203,934.23	-	51,083,768.64	274,287,702.87
（一）、综合收益总额	-	-	52,511,337.55	52,511,337.55
（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）	223,203,934.23	-	-1,427,568.91	221,776,365.32
其中：1. 基金申购款	761,916,519.34	-	1,514,810.93	763,431,330.27
2. 基金赎回款	-538,712,585.11	-	-2,942,379.84	-541,654,964.95
（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)	644,110,916.41	-	14,809,246.26	658,920,162.67
项目	上年度可比期间 2022 年 6 月 28 日（基金合同生效日）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)	-	-	-	-

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）	646,090,840.54	-	-	646,090,840.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-80,121.17	-80,121.17
（一）、综合收益总额	-	-	-80,121.17	-80,121.17
（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）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	646,090,840.54	-	-80,121.17	646,010,719.37

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

中欧小盘成长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[2022]1002号文《关于准予中欧小盘成长混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,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《中欧小盘成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币645,959,940.96元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第61362990_B33号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧小盘成长混合型证券投资基金基金合同》于2022年6月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为646,090,840.54份基金份额,其中包含认购资金利息折合130,899.58份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为375,681,461.40份,包含认购利息折合85,711.49份;C类基金的基金份额总额为270,409,379.14份,包含认购利息折合45,188.09份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧小盘成长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(包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具(包括国债期货、股指期货、股票期权)、信用衍生品(不含合约类信用衍生品)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于本基金界定的小盘成长股票的比例不低于非现金基金资产的80%,投资于港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的20%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:国证2000指数收益率 \times 90%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 \times 5%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，

暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金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、营业税的单位和个体，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的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	9,534,819.80
等于：本金	9,533,416.01
加：应计利息	1,403.79
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	32,566,723.48
等于：本金	32,563,615.85
加：应计利息	3,107.63
减：坏账准备	-
合计	42,101,543.28

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	589,633,422.61	-	601,732,490.54	12,099,067.93	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,093,000.39	364,321.51	13,342,972.21	-114,349.69
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,093,000.39	364,321.51	13,342,972.21	-114,349.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	602,726,423.00	364,321.51	615,075,462.75	11,984,718.24	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	11,610,654.54	-	-	
其中: 股指 期货投资	11,610,654.54	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	11,610,654.54	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2309	IM2309	4.00	5,229,120.00	72,720.00
IM2312	IM2312	5.00	6,479,600.00	25,345.46
合计				98,065.46
减：可抵销期货 暂收款				98,065.46
净额				0.00

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	569.12

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	8,189,652.00
预提费用-审计费	29,752.78
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	8,279,481.27

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧小盘成长混合 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	277,371,191.07	277,371,191.07
本期申购	325,171,578.61	325,171,578.61
本期赎回（以“-”号填列）	-244,628,723.81	-244,628,723.81
本期末	357,914,045.87	357,914,045.87

中欧小盘成长混合 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	143,535,791.11	143,535,791.11
本期申购	436,744,940.73	436,744,940.73
本期赎回（以“-”号填列）	-294,083,861.30	-294,083,861.30
本期末	286,196,870.54	286,196,870.54

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

中欧小盘成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,906,431.18	-13,734,617.61	-23,641,048.79
本期利润	11,149,254.62	21,914,627.52	33,063,882.14
本期基金份额交易产生的变动数	1,282,759.31	-1,498,681.38	-215,922.07
其中：基金申购款	-1,436,268.81	3,796,719.35	2,360,450.54
基金赎回款	2,719,028.12	-5,295,400.73	-2,576,372.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,525,582.75	6,681,328.53	9,206,911.28

中欧小盘成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-5,537,614.21	-7,095,859.38	-12,633,473.59
本期利润	5,048,082.17	14,399,373.24	19,447,455.41
本期基金份额交易产生的变动数	796,356.47	-2,008,003.31	-1,211,646.84
其中：基金申购款	-1,791,627.89	945,988.28	-845,639.61
基金赎回款	2,587,984.36	-2,953,991.59	-366,007.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	306,824.43	5,295,510.55	5,602,334.98

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	15,537.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	39,195.29
结算备付金利息收入	18,598.47
其他	-
合计	73,331.15

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	1,587,510,555.05
减：卖出股票成本总额	1,569,194,464.64
减：交易费用	3,786,121.09
买卖股票差价收入	14,529,969.32

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	228,170.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-21,041.25
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	207,129.60

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,102,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,021,041.25
减：应计利息总额	102,800.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-21,041.25

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	10,856.28

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	4,608,638.34
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	4,608,638.34

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	36,215,935.30
股票投资	36,253,147.55
债券投资	-37,212.25
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	98,065.46

权证投资	-
期货投资	98,065.46
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	36,314,000.76

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	1,584,338.96
基金转换费收入	1,818.21
合计	1,586,157.17

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,260.15

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
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	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 6 月 28 日（基金合同生效日） 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 （%）
广发证券	2,133,264,458.76	63.55	1,865,065.97	33.48

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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 6 月 28 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
广发证券	290,675,000.00	100.00	102,900,000.00	37.30

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 (%)
广发证券	1,125,095.58	58.25	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年6月28日（基金合同生效日）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 (%)
广发证券	3,700.81	44.90	-	-

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6月28日（基金合 同生效日）至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,735,963.44	53,103.56
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,414,282.26	21,046.12

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 28 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	373,596.29	5,310.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 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		
	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C	合计
广发证券	-	206,052.12	206,052.12
中欧基金	-	41,726.43	41,726.43
中欧财富	-	477.71	477.71
合计	-	248,256.26	248,256.26
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 6 月 28 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C	合计
广发证券	-	2,188.91	2,188.91
中欧基金	-	0.00	0.00
合计	-	2,188.91	2,188.91

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 0.60%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧小盘成长混合 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	203,639.79	0.06%	50,015.15	0.02%

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、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 28 日（基金合同生效日）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
广发证券股份有限公司	9,534,819.80	15,537.39	252,020,447.86	31,354.83

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司保管，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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科	2023 年 3 月	6 个月	新股	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

	磁业	月 27 日		流通受限						
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	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	435	21,750.00	13,358.85	-

				限						
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	757	23,353.45	17,887.91	-
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29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023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	-
301293	三博脑	2023年4月	6个月	新股流	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

	科	25 日		通受限						
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,472	17,360.00	31,109.12	-
301305	朗坤环境	2023 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	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	490	15,846.60	15,611.40	-
301310	鑫宏业	2023 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	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-

				限						
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	300	23,040.00	32,385.00	-
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16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	140	10,283.00	6,529.60	-
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	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	470	11,171.90	20,158.30	-
301360	荣	2023	6个月	新	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-

	旗科技	年 4 月 17 日		股流通受限						
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	-
301382	蜂助手	2023 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	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	371	11,126.29	8,826.09	-
301395	仁信新材	2023 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	-
301395	仁信新材	2023 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	-
301399	英特科技	2023 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	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通	16.24	16.95	860	13,966.40	14,577.00	-

		日		受限						
301419	阿莱德	2023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	-
301428	世纪恒通	2023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	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	475	9,495.25	8,027.50	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	3,786	218,300.76	218,300.76	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	421	24,274.86	24,274.86	-
301488	豪恩汽电	2023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	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
603172	浙江	2023年4	6个月	新股	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

	万丰股份	月 28 日		流通受限						
603508	思维列控	2023 年 4 月 12 日	6 个月	大宗交易流通受限	15.96	16.15	125,400	2,001,384.00	2,025,210.00	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,369	66,908.34	60,844.14	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	641	15,127.60	41,453.47	-
688429	时创能源	2023 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	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,032	39,092.16	30,433.68	-
688469	中芯	2023 年 4 月	6 个月	新股	5.69	5.41	5,948	33,844.12	32,178.68	-

	集成	月 28 日		流 通 受 限						
688472	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	2,400	26,640.00	40,896.00	-
688479	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	-
688484	南芯科技	2023 年3 月28 日	6个月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	417	16,675.83	15,308.07	-
688512	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	122	18,590.36	16,588.34	-
688535	华	2023	6个月	新	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

	海诚科新材料	年 3 月 28 日		股 流 通 受 限						
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	809	17,126.53	19,011.50	-
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	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.26	25.33	642	19,426.92	16,261.86	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	135.80	120.41	223	30,283.40	26,851.43	-
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	153	19,247.40	18,058.59	-
688582	芯动	2023 年 6 月	6 个月	新 股	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-

	联科	月 21 日		流 通 受 限						
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 31 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	125.88	86.79	158	19,889.04	13,712.82	-
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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600530	*ST	2023	重大	2.49	2023	2.37	113,200	389,059.01	281,868.00	-

	交易	年 5 月 4 日	事项 停牌		年 7 月 5 日				
--	----	-----------------	----------	--	-----------------	--	--	--	--

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 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 3,000,328.51 元, 于 2023 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金, 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。本基金通过精选股票, 在力争控制投资组合风险的前提下, 追求资产净值的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心, 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。

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	42,101,543.28	-	-	-	42,101,543.28
结算备付金	3,723,028.80	-	-	-	3,723,028.80
存出保证金	-	-	-	1,405,046.40	1,405,046.40
交易性金融资产	13,342,972.21	-	-	-601,732,490.54	615,075,462.75
应收申购款	-	-	-	11,916,768.25	11,916,768.25
应收清算款	-	-	-	2,999,995.52	2,999,995.52
资产总计	59,167,544.29	-	-	-618,054,300.71	677,221,845.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,069,190.31	6,069,190.31
应付管理人报酬	-	-	-	751,731.02	751,731.02
应付托管费	-	-	-	75,173.09	75,173.09
卖出回购金融资产款	3,000,328.51	-	-	-	3,000,328.51
应付销售服务费	-	-	-	125,156.54	125,156.54
应交税费	-	-	-	621.59	621.59
其他负债	-	-	-	8,279,481.27	8,279,481.27
负债总计	3,000,328.51	-	-	-15,301,353.82	18,301,682.33
利率敏感度缺口	56,167,215.78	-	-	-602,752,946.89	658,920,162.67

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	14,110,874.90	-	-	-	14,110,874.90
交易性金融资产	17,275,854.86	-	-	-354,958,385.25	372,234,240.11
应收申购款	-	-	-	337,735.63	337,735.63
资产总计	31,386,729.76	-	-	-355,296,120.88	386,682,850.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	301,018.82	301,018.82
应付管理人报酬	-	-	-	508,412.34	508,412.34
应付托管费	-	-	-	50,841.26	50,841.26
卖出回购金融资产款	1,000,385.40	-	-	-	1,000,385.40
应付销售服务费	-	-	-	69,733.02	69,733.02
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	1,000,385.40	-	-	1,050,005.44	2,050,390.84
利率敏感度缺口	30,386,344.36	-	-	-354,246,115.44	384,632,459.80

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 2.02%（2022 年 12 月 31 日：4.49%），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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人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	601,732,490.54	91.32	354,958,385.25	92.29
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	601,732,490.54	91.32	354,958,385.25	92.29

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%	31,913,434.73	15,747,667.34
	业绩比较基准下降5%	-31,913,434.73	-15,747,667.34

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	597,682,568.56	348,869,815.04

第二层次	14,378,423.81	17,275,854.86
第三层次	3,014,470.38	6,088,570.21
合计	615,075,462.75	372,234,240.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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。本财务报表已于 2023 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	601,732,490.54	88.85
	其中：股票	601,732,490.54	88.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,342,972.21	1.97
	其中：债券	13,342,972.21	1.97
	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	45,824,572.08	6.77

8	其他各项资产	16,321,810.17	2.41
9	合计	677,221,845.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	12,493,353.00	1.90
B	采矿业	1,387,478.00	0.21
C	制造业	458,526,960.80	69.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,978,209.00	1.06
E	建筑业	5,984,817.25	0.91
F	批发和零售业	22,174,372.90	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	6,985,868.10	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,139,782.99	5.79
J	金融业	3,797,531.00	0.58
K	房地产业	3,595,165.00	0.55
L	租赁和商务服务业	5,331,163.90	0.81
M	科学研究和技术服务业	20,846,008.77	3.16
N	水利、环境和公共设施管理业	9,497,991.97	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,215,413.00	0.18
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	552,352.00	0.08
S	综合	4,202,240.00	0.64
	合计	601,732,490.54	91.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	605077	华康股份	346,500	9,175,320.00	1.39
2	002851	麦格米特	240,800	8,781,976.00	1.33
3	603187	海容冷链	409,820	8,192,301.80	1.24
4	600975	新五丰	837,300	8,004,588.00	1.21
5	002852	道道全	607,900	7,860,147.00	1.19

6	603209	兴通股份	319,210	6,770,444.10	1.03
7	688575	亚辉龙生物	352,364	6,501,115.80	0.99
8	300779	惠城环保	118,700	6,325,523.00	0.96
9	688305	科德数控	57,233	5,738,180.58	0.87
10	688556	高测科技股份	107,329	5,703,463.06	0.87
11	688566	吉贝尔药业	131,385	5,125,328.85	0.78
12	002965	祥鑫科技	89,700	4,994,496.00	0.76
13	002356	赫美集团	1,127,100	4,914,156.00	0.75
14	603590	康辰药业	145,700	4,837,240.00	0.73
15	603667	五洲新春	318,300	4,736,304.00	0.72
16	688291	金橙子科技	149,174	4,722,848.84	0.72
17	000521	长虹美菱	612,500	4,679,500.00	0.71
18	603215	比依股份	260,200	4,667,988.00	0.71
19	603859	能科科技	90,600	4,632,378.00	0.70
20	000837	秦川机床	282,000	4,590,960.00	0.70
21	688308	欧科亿数控刀具	114,520	4,580,800.00	0.70
22	002993	奥海科技	133,800	4,538,496.00	0.69
23	002940	昂利康	235,755	4,528,853.55	0.69
24	002046	国机精工	354,400	4,522,144.00	0.69
25	600984	建设机械	998,500	4,513,220.00	0.68
26	603896	寿仙谷	101,600	4,500,880.00	0.68
27	002234	民和股份	246,500	4,488,765.00	0.68
28	688097	博众精工科技	146,924	4,460,612.64	0.68
29	002949	华阳国际	313,200	4,453,704.00	0.68
30	603551	奥普家居	342,500	4,428,525.00	0.67
31	603040	新坐标	166,200	4,419,258.00	0.67
32	300004	南风股份	816,700	4,410,180.00	0.67
33	301030	仕净科技	63,800	4,408,580.00	0.67
34	688621	阳光诺和	74,934	4,407,617.88	0.67
35	688373	盟科药业	515,463	4,407,208.65	0.67
36	300839	博汇股份	329,720	4,381,978.80	0.67
37	300996	普联软件	142,040	4,360,628.00	0.66
38	600285	羚锐制药	271,400	4,358,684.00	0.66
39	688768	容知日新	53,899	4,304,913.13	0.65
40	300411	金盾股份	656,600	4,300,730.00	0.65
41	605016	百龙创园	172,760	4,277,537.60	0.65
42	688300	联瑞新材	90,666	4,238,635.50	0.64
43	688550	瑞联新材料	106,586	4,220,805.60	0.64
44	600212	绿能慧充	448,000	4,202,240.00	0.64
45	600327	大东方	881,300	4,098,045.00	0.62
46	688078	龙软科技	76,827	3,960,431.85	0.60
47	688258	江苏卓易信息科技	58,051	3,873,743.23	0.59

48	300515	三德科技	237,200	3,823,664.00	0.58
49	001216	华瓷股份	280,100	3,686,116.00	0.56
50	002469	三维化学	592,800	3,645,720.00	0.55
51	600807	济南高新	1,218,700	3,595,165.00	0.55
52	300908	仲景食品	78,699	3,568,999.65	0.54
53	002730	电光科技	372,300	3,566,634.00	0.54
54	300265	通光线缆	339,300	3,521,934.00	0.53
55	300680	隆盛科技	140,700	3,499,209.00	0.53
56	688529	大连豪森股份	133,800	3,494,856.00	0.53
57	002066	瑞泰科技	292,300	3,492,985.00	0.53
58	300546	雄帝科技	188,600	3,475,898.00	0.53
59	688329	苏州艾隆科技	106,545	3,452,058.00	0.52
60	603602	纵横通信	279,300	3,432,597.00	0.52
61	688292	浩瀚深度信息技术	110,392	3,168,250.40	0.48
62	688468	科美诊断	330,220	3,137,090.00	0.48
63	002130	沃尔核材	377,900	3,068,548.00	0.47
64	000533	顺钠股份	712,100	3,026,425.00	0.46
65	688630	芯碁微装	35,753	3,003,967.06	0.46
66	002668	奥马电器	344,600	2,977,344.00	0.45
67	301270	汉仪股份	52,600	2,872,486.00	0.44
68	002979	雷赛智能	115,150	2,735,964.00	0.42
69	000663	永安林业	220,200	2,682,036.00	0.41
70	688618	三旺通信	39,030	2,643,111.60	0.40
71	600725	云维股份	921,500	2,478,835.00	0.38
72	002779	中坚科技	93,900	2,470,509.00	0.37
73	002616	长青集团	481,000	2,462,720.00	0.37
74	000554	泰山石油	436,800	2,459,184.00	0.37
75	000626	远大控股	328,762	2,449,276.90	0.37
76	002887	绿茵生态	266,600	2,423,394.00	0.37
77	600101	明星电力	254,700	2,422,197.00	0.37
78	300771	智莱科技	218,700	2,381,643.00	0.36
79	300695	兆丰股份	50,700	2,361,606.00	0.36
80	600053	九鼎投资	187,900	2,324,323.00	0.35
81	600746	江苏索普	330,900	2,160,777.00	0.33
82	603787	新日股份	121,500	2,042,415.00	0.31
83	600626	申达股份	589,800	2,034,810.00	0.31
84	600815	厦工股份	751,000	2,027,700.00	0.31
85	603508	思维列控	125,400	2,025,210.00	0.31
86	603811	诚意药业	162,260	2,016,891.80	0.31
87	600076	康欣新材	777,700	1,998,689.00	0.30
88	002256	兆新股份	913,100	1,990,558.00	0.30
89	002731	萃华珠宝	139,400	1,989,238.00	0.30
90	002991	甘源食品	25,000	1,917,500.00	0.29

91	300950	德固特	89,800	1,903,760.00	0.29
92	600488	津药药业	333,400	1,873,708.00	0.28
93	002877	智能自控	182,260	1,848,116.40	0.28
94	300689	澄天伟业	78,700	1,839,219.00	0.28
95	301092	争光股份	69,900	1,829,982.00	0.28
96	300107	建新股份	373,300	1,825,437.00	0.28
97	301076	新瀚新材	92,900	1,822,698.00	0.28
98	002446	盛路通信	191,500	1,809,675.00	0.27
99	002631	德尔未来	333,600	1,801,440.00	0.27
100	003036	泰坦股份	132,900	1,791,492.00	0.27
101	600379	宝光股份	174,300	1,777,860.00	0.27
102	002161	远望谷	340,200	1,772,442.00	0.27
103	603856	东宏股份	133,000	1,754,270.00	0.27
104	605196	华通线缆	243,600	1,734,432.00	0.26
105	603998	方盛制药	136,800	1,725,048.00	0.26
106	300711	广哈通信	113,820	1,702,747.20	0.26
107	603800	道森股份	62,300	1,694,560.00	0.26
108	603018	华设集团	193,200	1,690,500.00	0.26
109	688670	金迪克生物	34,740	1,635,559.20	0.25
110	002141	贤丰控股	496,600	1,633,814.00	0.25
111	688197	首药控股	34,212	1,630,543.92	0.25
112	000962	东方钽业	132,200	1,619,450.00	0.25
113	605167	利柏特	163,932	1,586,861.76	0.24
114	300592	华凯易佰	56,500	1,537,930.00	0.23
115	301068	大地海洋	45,700	1,535,977.00	0.23
116	300795	米奥会展	36,750	1,532,842.50	0.23
117	688458	美芯晟科技	15,900	1,529,103.00	0.23
118	002880	卫光生物	39,800	1,500,460.00	0.23
119	000811	冰轮环境	94,800	1,494,048.00	0.23
120	300881	盛德鑫泰	44,550	1,467,922.50	0.22
121	605009	豪悦护理	30,500	1,464,000.00	0.22
122	603255	鼎际得股份	28,676	1,455,593.76	0.22
123	688697	纽威数控装备	56,100	1,449,063.00	0.22
124	002334	英威腾	112,200	1,429,428.00	0.22
125	600965	福成股份	225,100	1,424,883.00	0.22
126	300540	蜀道装备	51,600	1,397,328.00	0.21
127	688286	敏芯股份	22,179	1,396,833.42	0.21
128	603611	诺力股份	52,800	1,390,752.00	0.21
129	301312	智立方	12,900	1,369,464.00	0.21
130	603081	大丰实业	74,200	1,363,796.00	0.21
131	603328	依顿电子	164,100	1,358,748.00	0.21
132	300842	帝科股份	14,800	1,353,312.00	0.21
133	002057	中钢天源	128,000	1,344,000.00	0.20

134	600323	瀚蓝环境	70,400	1,332,672.00	0.20
135	301328	维峰电子	23,356	1,329,890.64	0.20
136	300105	龙源技术	198,100	1,329,251.00	0.20
137	300812	易天股份	53,000	1,325,000.00	0.20
138	002737	葵花药业	54,400	1,324,096.00	0.20
139	688569	铁科轨道	31,457	1,323,395.99	0.20
140	300491	通合科技	45,300	1,300,110.00	0.20
141	603163	圣晖系统集成集团	28,175	1,291,260.25	0.20
142	001255	博菲电气	33,800	1,288,456.00	0.20
143	688486	龙迅股份	11,695	1,287,034.75	0.20
144	003011	海象新材	39,600	1,277,100.00	0.19
145	688143	长盈通光电	33,499	1,262,912.30	0.19
146	603158	腾龙股份	164,200	1,257,772.00	0.19
147	002957	科瑞技术	62,000	1,256,740.00	0.19
148	300349	金卡智能	90,500	1,256,140.00	0.19
149	605218	伟时电子	80,000	1,240,000.00	0.19
150	603266	天龙股份	89,100	1,239,381.00	0.19
151	300280	紫天科技	25,900	1,237,243.00	0.19
152	603757	大元泵业	40,900	1,220,456.00	0.19
153	605289	罗曼股份	31,800	1,218,258.00	0.18
154	301391	卡莱特	10,394	1,217,864.98	0.18
155	688085	三友医疗	46,356	1,217,308.56	0.18
156	002345	潮宏基	154,800	1,216,728.00	0.18
157	605098	行动教育	30,700	1,215,413.00	0.18
158	688636	智明达电子	21,916	1,205,380.00	0.18
159	300622	博士眼镜	51,000	1,203,600.00	0.18
160	301085	亚康股份	17,000	1,199,180.00	0.18
161	002398	垒知集团	209,600	1,194,720.00	0.18
162	002783	凯龙股份	143,200	1,194,288.00	0.18
163	688103	国力股份	19,917	1,193,227.47	0.18
164	688668	鼎通科技	12,000	1,173,600.00	0.18
165	688698	伟创电气	29,074	1,162,378.52	0.18
166	600861	北京人力	50,000	1,160,000.00	0.18
167	002833	弘亚数控	59,000	1,159,940.00	0.18
168	605598	上海港湾	22,000	1,158,520.00	0.18
169	003000	劲仔食品	91,600	1,153,244.00	0.18
170	002917	金奥博	93,200	1,151,952.00	0.17
171	688601	力芯微股份	24,340	1,146,414.00	0.17
172	688156	路德环境	39,868	1,143,015.56	0.17
173	603076	乐惠国际	23,900	1,142,659.00	0.17
174	603516	淳中科技	51,800	1,142,190.00	0.17
175	000534	万泽股份	67,900	1,138,683.00	0.17
176	603357	设计总院	108,000	1,134,000.00	0.17

177	300161	华中数控	21,100	1,129,272.00	0.17
178	301004	嘉益股份	29,100	1,129,080.00	0.17
179	300718	长盛轴承	50,500	1,123,625.00	0.17
180	301129	瑞纳智能	15,200	1,119,784.00	0.17
181	688687	北京凯因科技	37,683	1,111,648.50	0.17
182	600458	时代新材	92,500	1,109,075.00	0.17
183	002039	黔源电力	78,500	1,104,495.00	0.17
184	301162	国能日新	13,900	1,096,432.00	0.17
185	603889	新澳股份	145,180	1,090,301.80	0.17
186	301286	侨源股份	36,600	1,079,700.00	0.16
187	603676	卫信康	78,100	1,079,342.00	0.16
188	300407	凯发电气	117,300	1,070,949.00	0.16
189	605128	上海沿浦	26,400	1,069,464.00	0.16
190	603105	芯能科技	63,100	1,065,759.00	0.16
191	603778	乾景园林	196,600	1,061,640.00	0.16
192	300389	艾比森	52,100	1,061,277.00	0.16
193	600490	鹏欣资源	286,600	1,054,688.00	0.16
194	300951	博硕科技	19,300	1,054,359.00	0.16
195	603237	五芳斋实业	34,720	1,053,057.60	0.16
196	688378	奥来德光电	21,278	1,051,133.20	0.16
197	605377	华旺科技	57,900	1,045,095.00	0.16
198	688466	金科环境	51,845	1,034,826.20	0.16
199	600686	金龙汽车	126,500	1,029,710.00	0.16
200	601089	福元医药	62,900	1,025,270.00	0.16
201	605060	联德股份	37,200	1,021,512.00	0.16
202	300634	彩讯股份	37,600	992,640.00	0.15
203	600509	天富能源	125,500	980,155.00	0.15
204	688507	索辰科技	7,475	976,459.25	0.15
205	002829	星网宇达	22,200	975,246.00	0.15
206	301169	零点有数	19,600	970,004.00	0.15
207	600961	株冶集团	118,600	959,474.00	0.15
208	301232	飞沃科技	15,600	946,764.00	0.14
209	300510	金冠股份	135,200	943,696.00	0.14
210	002518	科士达	23,100	924,231.00	0.14
211	688676	海南金盘智能科技	30,384	920,331.36	0.14
212	300490	华自科技	53,500	918,060.00	0.14
213	001283	豪鹏科技	19,000	917,510.00	0.14
214	301333	诺思格	18,240	917,472.00	0.14
215	002338	奥普光电	21,700	914,655.00	0.14
216	603129	春风动力	5,400	874,260.00	0.13
217	002646	天佑德酒	63,800	860,662.00	0.13
218	300757	罗博特科	9,700	853,697.00	0.13
219	000404	长虹华意	122,400	847,008.00	0.13

220	301256	华融化学	94,300	835,498.00	0.13
221	603711	香飘飘	40,500	831,465.00	0.13
222	003006	百亚股份	47,900	827,712.00	0.13
223	603093	南华期货	75,000	816,750.00	0.12
224	300855	图南股份	23,010	812,713.20	0.12
225	603102	百合股份	18,700	807,653.00	0.12
226	300443	金雷股份	22,400	794,080.00	0.12
227	300723	一品红	26,350	772,055.00	0.12
228	603217	元利科技	29,700	764,775.00	0.12
229	002997	瑞鹄模具	25,500	758,115.00	0.12
230	300918	南山智尚	54,400	746,912.00	0.11
231	688121	卓然技术	19,957	746,391.80	0.11
232	603083	剑桥科技	11,700	735,813.00	0.11
233	300900	广联航空	25,400	731,774.00	0.11
234	300796	贝斯美	59,500	715,785.00	0.11
235	002658	雪迪龙	88,000	715,440.00	0.11
236	688722	同益中新材料	38,427	712,436.58	0.11
237	300845	捷安高科	32,000	695,360.00	0.11
238	600433	冠豪高新	203,600	694,276.00	0.11
239	300403	汉宇集团	62,800	690,172.00	0.10
240	301198	喜悦智行	45,374	688,777.32	0.10
241	603227	雪峰科技	82,000	678,960.00	0.10
242	688588	凌志软件	43,600	677,980.00	0.10
243	002647	仁东控股	116,600	656,458.00	0.10
244	688393	安必平医药	19,500	653,250.00	0.10
245	301257	普蕊斯	11,600	651,920.00	0.10
246	300532	今天国际	31,700	651,752.00	0.10
247	002870	香山股份	19,200	636,864.00	0.10
248	603165	荣晟环保	39,500	633,580.00	0.10
249	003029	吉大正元	19,200	623,040.00	0.09
250	603121	华培动力	69,200	616,572.00	0.09
251	600419	天润乳业	38,000	616,360.00	0.09
252	300729	乐歌股份	34,500	615,480.00	0.09
253	300700	岱勒新材	32,268	614,705.40	0.09
254	688310	迈得医疗	18,700	612,799.00	0.09
255	002560	通达股份	64,100	610,232.00	0.09
256	301168	通灵股份	9,700	604,310.00	0.09
257	002885	京泉华	27,580	602,347.20	0.09
258	688015	交控科技	34,254	598,417.38	0.09
259	300384	三联虹普	35,000	594,650.00	0.09
260	603867	新化股份	14,540	588,870.00	0.09
261	688127	蓝特光学	33,365	588,224.95	0.09
262	300275	梅安森	42,060	584,634.00	0.09

263	603368	柳药集团	23,600	583,156.00	0.09
264	688800	瑞可达连接系统	9,300	577,995.00	0.09
265	600761	安徽合力	28,900	575,977.00	0.09
266	300517	海波重科	41,600	575,744.00	0.09
267	002891	中宠股份	23,800	574,532.00	0.09
268	000923	河钢资源	42,500	573,750.00	0.09
269	002937	兴瑞科技	23,100	568,260.00	0.09
270	688435	英方软件	7,461	567,334.44	0.09
271	300688	创业黑马	16,300	565,773.00	0.09
272	301266	宇邦新材	8,000	562,480.00	0.09
273	002897	意华股份	12,100	559,988.00	0.08
274	300129	泰胜风能	58,300	559,097.00	0.08
275	301188	力诺特玻	32,637	557,439.96	0.08
276	300419	浩丰科技	88,700	555,262.00	0.08
277	300286	安科瑞	14,600	552,756.00	0.08
278	300654	世纪天鸿	42,100	552,352.00	0.08
279	300662	科锐国际	15,600	551,772.00	0.08
280	688158	优刻得科技	29,218	551,635.84	0.08
281	688255	凯尔达机器人	16,137	546,398.82	0.08
282	001215	千味央厨	8,200	545,218.00	0.08
283	301058	中粮科工	38,400	535,680.00	0.08
284	688337	普源精电	8,878	534,988.28	0.08
285	300586	美联新材	41,300	533,183.00	0.08
286	002533	金杯电工	65,100	531,216.00	0.08
287	300539	横河精密	35,800	530,198.00	0.08
288	300926	博俊科技	23,100	527,604.00	0.08
289	002790	瑞尔特	54,900	527,040.00	0.08
290	300103	达刚控股	85,268	523,545.52	0.08
291	603639	海利尔	29,000	519,680.00	0.08
292	301307	美利信	15,290	515,999.40	0.08
293	000715	中兴商业	69,800	515,822.00	0.08
294	688186	张家港广大特材	15,851	515,633.03	0.08
295	600572	康恩贝	75,100	514,435.00	0.08
296	688590	新致软件	22,600	513,698.00	0.08
297	300294	博雅生物	14,100	511,548.00	0.08
298	300777	中简科技	10,700	505,682.00	0.08
299	603027	千禾味业	23,900	504,768.00	0.08
300	000922	佳电股份	38,200	502,712.00	0.08
301	000928	中钢国际	51,900	500,835.00	0.08
302	601339	百隆东方	89,100	498,960.00	0.08
303	688376	美埃科技	12,561	496,033.89	0.08
304	300235	方直科技	39,700	494,265.00	0.08

305	000913	钱江摩托	26,900	490,387.00	0.07
306	688639	华恒生物	5,410	489,496.80	0.07
307	688533	上声电子股份	10,465	489,029.45	0.07
308	002959	小熊电器	5,800	484,300.00	0.07
309	002728	特一药业	31,680	483,120.00	0.07
310	300417	南华仪器	44,800	481,152.00	0.07
311	600098	广州发展	77,800	480,804.00	0.07
312	002072	凯瑞德	76,800	480,768.00	0.07
313	002536	飞龙股份	32,000	480,000.00	0.07
314	002918	蒙娜丽莎	30,700	474,008.00	0.07
315	605168	三人行	5,510	473,529.40	0.07
316	300521	爱司凯	37,000	472,490.00	0.07
317	300693	盛弘股份	12,791	472,243.72	0.07
318	002611	东方精工	82,000	470,680.00	0.07
319	688019	安集科技	2,831	466,633.73	0.07
320	600353	旭光电子	54,760	449,032.00	0.07
321	002733	雄韬股份	25,900	447,811.00	0.07
322	000409	云鼎科技	44,400	443,556.00	0.07
323	002270	华明装备	40,200	440,190.00	0.07
324	603090	宏盛股份	19,700	438,325.00	0.07
325	600971	恒源煤电	55,700	433,903.00	0.07
326	300819	聚杰微纤	30,100	412,671.00	0.06
327	300717	华信新材	23,200	395,560.00	0.06
328	300838	浙江力诺	21,300	389,151.00	0.06
329	603059	倍加洁	17,000	386,580.00	0.06
330	688217	上海睿昂基因	9,600	385,440.00	0.06
331	002767	先锋电子	27,000	377,190.00	0.06
332	300462	华铭智能	32,100	376,854.00	0.06
333	600272	开开实业	41,700	376,551.00	0.06
334	600287	江苏舜天	73,200	374,052.00	0.06
335	688335	复洁环保科技	15,080	370,063.20	0.06
336	600128	弘业股份	45,000	369,900.00	0.06
337	603214	爱婴室	22,600	367,702.00	0.06
338	600857	宁波中百	36,800	364,320.00	0.06
339	003017	大洋生物	10,800	363,420.00	0.06
340	300387	富邦股份	49,600	361,088.00	0.05
341	002370	亚太药业	88,200	359,856.00	0.05
342	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.05
343	600530	*ST 交昂	113,200	281,868.00	0.04
344	300126	锐奇股份	42,700	277,123.00	0.04
345	300281	金明精机	49,700	266,392.00	0.04
346	603177	德创环保	21,000	262,080.00	0.04
347	688026	洁特生物股份	14,093	257,479.11	0.04

348	000820	神雾节能	68,500	255,505.00	0.04
349	603810	丰山集团	18,400	253,368.00	0.04
350	688069	德林海环保	11,905	252,862.20	0.04
351	603421	鼎信通讯	24,100	251,845.00	0.04
352	300405	科隆股份	45,750	250,252.50	0.04
353	300385	雪浪环境	40,600	248,472.00	0.04
354	300333	兆日科技	36,700	243,321.00	0.04
355	301486	致尚科技	4,207	242,575.62	0.04
356	603023	威帝股份	58,900	240,312.00	0.04
357	600847	万里股份	18,400	224,664.00	0.03
358	002136	安纳达	19,200	218,496.00	0.03
359	600232	金鹰股份	39,700	216,762.00	0.03
360	002282	博深股份	28,400	215,556.00	0.03
361	002682	龙洲股份	52,800	215,424.00	0.03
362	002278	神开股份	40,400	215,332.00	0.03
363	002633	申科股份	20,500	214,840.00	0.03
364	603021	山东华鹏	40,900	208,999.00	0.03
365	002105	信隆健康	35,100	208,845.00	0.03
366	003008	开普检测	7,100	203,983.00	0.03
367	002629	仁智股份	55,100	201,115.00	0.03
368	002495	佳隆股份	82,400	201,056.00	0.03
369	688350	富淼科技	11,199	190,271.01	0.03
370	300807	天迈科技	6,400	187,200.00	0.03
371	600250	南纺股份	30,100	186,921.00	0.03
372	600356	恒丰纸业	23,300	182,439.00	0.03
373	300157	恒泰艾普	55,500	178,710.00	0.03
374	300117	嘉寓股份	57,600	178,560.00	0.03
375	301106	骏成科技	5,000	178,100.00	0.03
376	300270	中威电子	22,200	169,830.00	0.03
377	688472	阿特斯阳光电力	8,767	157,794.12	0.02
378	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
379	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
380	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
381	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
382	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
383	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
384	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
385	688249	晶合集成	3,369	60,844.14	0.01
386	688361	中科飞测	641	41,453.47	0.01
387	688480	赛恩斯环保	1,302	40,309.92	0.01
388	301325	曼恩斯特	300	32,385.00	0.00
389	688469	中芯集成	5,948	32,178.68	0.00
390	301301	川宁生物	3,472	31,109.12	0.00

391	688443	智翔金泰	1,032	30,433.68	0.00
392	688576	西山科技	223	26,851.43	0.00
393	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
394	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
395	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
396	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
397	301358	湖南裕能	470	20,158.30	0.00
398	688552	航天南湖	809	19,011.50	0.00
399	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
400	688581	安杰思医学	153	18,058.59	0.00
401	301260	格力博	757	17,887.91	0.00
402	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
403	688531	日联科技股份有限公司	122	16,588.34	0.00
404	688570	天玛智控	642	16,261.86	0.00
405	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
406	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
407	688484	南芯科技	417	15,308.07	0.00
408	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
409	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
410	301408	华人健康	860	14,577.00	0.00
411	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
412	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
413	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
414	688512	慧智微电子	721	13,814.36	0.00
415	688623	双元科技	158	13,712.82	0.00
416	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
417	301246	宏源药业	435	13,358.85	0.00
418	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
419	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
420	301277	新天地	658	12,837.58	0.00
421	688620	安凯微电子	1,016	12,537.44	0.00
422	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
423	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
424	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
425	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
426	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
427	688479	用友汽车信息科技	332	9,790.68	0.00
428	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
429	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
430	301386	未来电器	371	8,826.09	0.00
431	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
432	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
433	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00

434	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
435	301439	泓淋电力	475	8,027.50	0.00
436	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
437	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
438	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
439	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
440	301345	涛涛车业	140	6,529.60	0.00
441	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
442	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
443	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
444	603172	浙江万丰股份	122	1,967.86	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	300161	华中数控	15,313,182.00	3.98
2	688305	科德数控	13,370,060.16	3.48
3	300779	惠城环保	12,451,294.00	3.24
4	688308	欧科亿数控 刀具	11,930,140.97	3.10
5	688373	盟科药业	10,514,844.22	2.73
6	688468	科美诊断	10,187,264.17	2.65
7	600975	新五丰	9,597,934.00	2.50
8	605077	华康股份	9,205,818.76	2.39
9	002993	奥海科技	8,899,807.00	2.31
10	688258	江苏卓易信 息科技	8,568,433.58	2.23
11	603187	海容冷链	8,531,174.00	2.22
12	002046	国机精工	8,528,428.00	2.22
13	601007	金陵饭店	8,475,749.00	2.20
14	688697	纽威数控装 备	8,383,933.26	2.18
15	688300	联瑞新材	8,164,393.99	2.12
16	002852	道道全	8,123,190.00	2.11
17	003000	劲仔食品	8,043,050.00	2.09
18	603255	鼎际得股份	7,630,904.50	1.98
19	300839	博汇股份	7,598,967.00	1.98
20	301227	森鹰窗业	7,557,430.16	1.96

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	300161	华中数控	17,137,473.00	4.46
2	688697	纽威数控装 备	13,756,737.74	3.58
3	688305	科德数控	9,930,141.75	2.58
4	003032	传智教育	8,773,396.00	2.28
5	603611	诺力股份	8,689,030.40	2.26
6	688308	欧科亿数控 刀具	8,663,407.38	2.25
7	300779	惠城环保	8,468,072.00	2.20
8	300607	拓斯达	8,270,382.00	2.15
9	301227	森鹰窗业	8,169,694.32	2.12
10	003000	劲仔食品	8,059,448.00	2.10
11	002338	奥普光电	7,942,219.00	2.06
12	002955	鸿合科技	7,840,097.00	2.04
13	601007	金陵饭店	7,754,626.00	2.02
14	600353	旭光电子	7,667,948.00	1.99
15	002959	小熊电器	7,424,588.26	1.93
16	605088	冠盛股份	7,268,441.00	1.89
17	688358	祥生医疗科 技	6,931,002.66	1.80
18	301067	显盈科技	6,882,645.00	1.79
19	600212	绿能慧充	6,873,332.00	1.79
20	300132	青松股份	6,827,360.00	1.78

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	1,779,715,422.38
卖出股票收入（成交）总额	1,587,510,555.05

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	8,187,482.74	1.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,155,489.47	0.78
	其中：政策性金融债	5,155,489.47	0.78

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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,342,972.21	2.02

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	019638	20 国债 09	80,000	8,187,482.74	1.24
2	018008	国开 1802	49,710	5,155,489.47	0.78

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并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。

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中，湖南新五丰股份有限公司在报告编制日前一年内曾

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,405,046.40
2	应收清算款	2,999,995.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,916,768.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,321,810.17

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
中欧小盘成长混合A	5,703	62,758.91	50,956,584.75	14.24%	306,957,461.12	85.76%

中欧小盘成长混合 C	3,714	77,058.93	77,871,687.18	27.21%	208,325,183.36	72.79%
合计	9,417	68,398.74	128,828,271.93	20.00%	515,282,644.48	80.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧小盘成长混合 A	1,314,919.14	0.37%
	中欧小盘成长混合 C	988,826.26	0.35%
	合计	2,303,745.40	0.36%

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	中欧小盘成长混合 A	0
	中欧小盘成长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧小盘成长混合 A	>100
	中欧小盘成长混合 C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧小盘成长混合 A	中欧小盘成长混合 C
基金合同生效日 (2022 年 6 月 28 日) 基金份额总额	375,681,461.40	270,409,379.14
本报告期期初基金份额总额	277,371,191.07	143,535,791.11
本报告期基金总申购份额	325,171,578.61	436,744,940.73
减：本报告期基金总赎回份额	244,628,723.81	294,083,861.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	357,914,045.87	286,196,870.54

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
广发证券	3	2,133,264,458.76	63.55	1,125,095.58	58.25	-
光大证券	3	657,793,229.62	19.60	514,283.24	26.62	本报告期新增 1 个
申万宏源证券	3	565,660,519.47	16.85	292,241.69	15.13	-

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 (%)
广发证券	-	-	290,675,000.00	100.00	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

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
2	中欧小盘成长混合型证券投资基金 2022 年第 4 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部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧小盘成长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
5	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
6	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	中国证监会指定媒介	2023-04-22

	告		
7	中欧小盘成长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关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
9	中欧小盘成长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、中欧小盘成长混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧小盘成长混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧小盘成长混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧小盘成长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