

中欧明睿新起点混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

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	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧明睿新起点混合型证券投资基金
基金简称	中欧明睿新起点混合
基金主代码	001000
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015年01月29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	1,524,409,058.54份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国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333号五层	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街5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	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	538,521,876.79
本期利润	554,831,309.16
加权平均基金份额本期利润	0.3246

本期加权平均净值利润率	15.56%
本期基金份额净值增长率	19.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	983,353,304.10
期末可供分配基金份额利润	0.6451
期末基金资产净值	3,798,424,411.88
期末基金份额净值	2.492
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	149.20%

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

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

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.66%	1.92%	-1.62%	0.64%	12.28%	1.28%
过去三个月	36.40%	1.85%	2.91%	0.78%	33.49%	1.07%
过去六个月	19.81%	2.36%	0.49%	1.05%	19.32%	1.31%
过去一年	61.29%	2.14%	20.27%	1.06%	41.02%	1.08%
过去三年	154.55%	2.00%	40.23%	1.09%	114.3 2%	0.91%
自基金合同	149.20%	2.16%	42.29%	1.19%	106.9	0.97%

生效起至今					1%	
-------	--	--	--	--	----	--

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		
葛兰	投资总监/基金经理/投资 经理	2018- 07-12	-	10 年	历任国金证券研究所研究 员，民生加银基金管理有 限公司研究员。2014/10/0 8加入中欧基金管理有限 公司，历任研究员。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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
葛兰	公募基金	5	84,854,436,38 3.94	2015-01-29
	私募资产管理计划	2	1,113,811,91 1.09	2021-05-19
	其他组合	-	-	-
	合计	7	85,968,248,29 5.03	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一年，新冠疫情对全球造成了巨大影响，但在此过程中，中国表现出了优秀的防疫、抗疫能力，这其中不仅有医疗人员的付出，也有人民自律的抗疫等。与此同时，优质企业也展现了强大的逆境生存能力，我国经济领先全球复苏，也是在这样的环境下，我们的组合取得了不错的收益。

组合操作方面，我们自2019年底就提出中长线看好这轮科技创新周期、看好中国制造业的崛起，围绕此主线配置，保持了仓位和结构整体稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为19.81%，同期业绩比较基准收益率为0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

产品长期定位于聚焦有竞争壁垒的优质公司，主要三方向：1）必选消费品，免疫宏观经济和外围冲击扰动，比如医药与部分食品饮料；2）选择消费品和服务业中，行业格局好，有定价能力的龙头公司；3）科技创新领域，寻找具有国际竞争力，能够实现进口替代甚至在全球产业链中占有一席之地。

我们依然中长线看好这轮科技创新周期，我国相应各个领域产业中长期将发生深刻变化。我们把风险分为永久性损失和暂时性调整两大类，我们认为风控的核心是要尽量避免永久性损失，这要求我们仔细甄选企业，坚守最优质的公司。回溯股票市场长牛个股以及回顾我们在过去几年投资中所面临的市场大幅调整的考验，通过深度基本面研

究，聚焦核心优质成长个股，避免永久性损失，是做好长期业绩的有效策略。我们认为当前布局的赛道、持有的个股未来仍然具备巨大成长空间，业绩持续向上动能强劲。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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明睿新起点混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关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，中欧明睿新起点混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧明睿新起点混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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明睿新起点混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中欧明睿新起点混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	226,617,591.80	162,233,931.51
结算备付金		3,386,142.46	7,203,869.14
存出保证金		617,952.04	560,532.87
交易性金融资产	6.4.7.2	3,729,401,377.93	3,792,589,459.74
其中：股票投资		3,605,440,432.96	3,735,169,403.04
基金投资		—	—
债券投资		123,960,944.97	57,420,056.70
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	5,840,131.38
应收利息	6.4.7.5	2,156,602.41	1,095,163.81

应收股利		-	-
应收申购款		26,551,014.62	10,795,511.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,988,730,681.26	3,980,318,600.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		145,990,828.87	-
应付赎回款		36,200,936.16	35,395,767.99
应付管理人报酬		4,270,621.83	4,571,870.96
应付托管费		711,770.30	761,978.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,948,240.29	3,886,748.51
应交税费		-	3.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	183,871.93	190,645.95
负债合计		190,306,269.38	44,807,015.59
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,524,409,058.54	1,891,624,730.03
未分配利润	6.4.7.10	2,274,015,353.34	2,043,886,854.69
所有者权益合计		3,798,424,411.88	3,935,511,584.72
负债和所有者权益总计		3,988,730,681.26	3,980,318,600.31

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值2.492元，基金份额总额1,524,409,058.54份。

6.2 利润表

会计主体：中欧明睿新起点混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		597,132,373.79	697,357,866.07
1. 利息收入		1,384,825.96	683,398.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	246,192.55	542,133.58
债券利息收入		1,138,633.41	141,264.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		571,459,418.06	97,873,240.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	566,609,656.10	91,427,213.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,164,486.00	-623.64
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,685,275.96	6,446,650.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	16,309,432.37	593,793,487.32

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,978,697.40	5,007,740.32
减：二、费用		42,301,064.63	32,500,215.42
1. 管理人报酬		26,738,524.81	19,588,915.42
2. 托管费		4,456,420.81	3,264,819.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,976,809.67	9,517,191.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.70	0.31
7. 其他费用	6.4.7.19	129,308.64	129,288.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		554,831,309.16	664,857,650.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		554,831,309.16	664,857,650.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧明睿新起点混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,891,624,730.03	2,043,886,854.69	3,935,511,584.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	554,831,309.16	554,831,309.16

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-367,215,671.49	-324,702,810.51	-691,918,482.00
其中:1.基金申购款	1,132,847,969.71	1,323,328,251.14	2,456,176,220.85
2.基金赎回款	-1,500,063,641.20	-1,648,031,061.65	-3,148,094,702.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,524,409,058.54	2,274,015,353.34	3,798,424,411.88
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,364,382,023.15	191,607,033.30	1,555,989,056.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	664,857,650.65	664,857,650.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	654,552,137.64	244,214,049.85	898,766,187.49
其中:1.基金申购款	1,804,731,742.29	615,546,836.81	2,420,278,579.10
2.基金赎回款	-1,150,179,604.65	-371,332,786.96	-1,521,512,391.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,018,934,160.79	1,100,678,733.80	3,119,612,894.59

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

中欧明睿新起点混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]5号文《关于准予中欧明睿新起点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《中欧明睿新起点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,《中欧明睿新起点混合型证券投资基金基金合同》于2015年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,976,750,390.34份基金份额,其中认购资金利息折合494,384.78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。

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2021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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《中欧明睿新起点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2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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[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]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。

(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。

(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 2021年06月30日
活期存款	226,617,591.80
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	226,617,591.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,138,578,084.31	3,605,440,432.96	1,466,862,348.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	124,220,756.63	123,960,944.97	-259,811.66
	银行间市场	-	-	-
	合计	124,220,756.63	123,960,944.97	-259,811.66
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,262,798,840.94	3,729,401,377.93	1,466,602,536.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	7,532.90
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,522.90
应收债券利息	2,147,268.51
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	278.10
合计	2,156,602.41

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,948,240.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,948,240.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	74,616.56
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	49,588.57
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付转出费	159.43

合计	183,871.93
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,891,624,730.03	1,891,624,730.03
本期申购	1,132,847,969.71	1,132,847,969.71
本期赎回（以“-”号填列）	-1,500,063,641.20	-1,500,063,641.20
本期末	1,524,409,058.54	1,524,409,058.54

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	626,334,793.35	1,417,552,061.34	2,043,886,854.69
本期利润	538,521,876.79	16,309,432.37	554,831,309.16
本期基金份额交易产生的变动数	-181,503,366.04	-143,199,444.47	-324,702,810.51
其中：基金申购款	545,126,640.68	778,201,610.46	1,323,328,251.14
基金赎回款	-726,630,006.72	-921,401,054.93	-1,648,031,061.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	983,353,304.10	1,290,662,049.24	2,274,015,353.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	202,823.23
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	38,256.67
其他	5,112.65
合计	246,192.55

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,855,243,881.29
减：卖出股票成本总额	3,288,634,225.19
买卖股票差价收入	566,609,656.10

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,164,486.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,164,486.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	57,833,402.63
减：卖出债券（、	55,541,092.54

债转股及债券到期 兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	1, 127, 824. 09
买卖债券差价收入	1, 164, 486. 00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	3, 685, 275. 96
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	3, 685, 275. 96

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	16, 309, 432. 37
——股票投资	16, 602, 559. 03
——债券投资	-293, 126. 66
——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	16,309,432.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	7,495,105.97
转换费收入	483,591.43
合计	7,978,697.40

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	10,976,809.67
银行间市场交易费用	—
合计	10,976,809.67

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	1,612.70
账户维护费	18,000.00
其他	600.00

合计	129,308.64
----	------------

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，未发生重大关联方关系变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	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	2,348,250.00	0.03%	132,310,177.48	2.04%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	2,221.23	0.03%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	123,221.53	2.04%	-	-

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 2021年01月01日至202	上年度可比期间 2020年01月01日至202
----	-----------------------	----------------------------

	1年06月30日	0年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,738,524.81	19,588,915.42
其中：支付销售机构的客户维护费	8,506,275.66	6,278,444.18

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 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,456,420.81	3,264,819.20

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.3 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

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	1,119,937.08	0.07%	904,181.99	0.05%

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	226,617,591.80	202,823.23	125,014,168.84	489,544.91

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，本报告报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300782	卓胜微	2021-02-05	2021-08-09	非公开发行限售	314.36	521.04	66,802	20,999,825.20	34,806,514.08	-
603799	华友钴业	2021-02-18	2021-08-09	非公开发行限售	84.00	108.54	238,095	19,999,980.00	25,842,831.30	-
002821	凯莱英	2021-01-20	2021-07-20	大宗交易流通受限	280.44	363.06	46,300	12,984,372.00	16,809,678.00	-
688169	石头科技	2021-03-26	2021-09-27	大宗交易流通受限	939.30	1,161.59	2,500	2,348,250.00	2,903,975.00	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股流通受限	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688606	奥泰生物	2021-03-17	2021-09-27	新股流通受限	133.67	139.31	2,703	361,310.01	376,554.93	-
688383	新益昌	2021-04-21	2021-10-28	新股流通受限	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
300957	贝泰妮	2021-03-	2021-09-	新股流通	47.33	251.96	853	40,372.4	214,921.	-

		18	27	受限				9	88	
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股流通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-	2021-10-	新股流通	28.28	115.71	360	10,180.8	41,655.6	-

		08	15	受限				0	0	
688517	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-	2021-08-	新股流通	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.6	-

		27	03	受限					6	
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.4	11,014.4	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-	2021-09-	新股流通	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-

		03	13	受限						
3010 16	雷尔 伟	2021 -06- 23	2021 -12- 30	新股 流通 受限	13.7 5	32.9 8	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	新股 流通 受限	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021 -02- 18	2021 -08- 25	新股 流通 受限	8.67	27.4 2	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-
3009 31	通用 电梯	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 流通 受限	4.31	13.1 1	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-
3009 61	深水 海纳	2021 -03- 23	2021 -09- 30	新股 流通 受限	8.48	22.0 7	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	新股 流通 受限	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	新股 流通 受限	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	新股 流通 受限	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- -	2021 -11- -	新股 流通	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-

		28	11	受限						
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-	2021-10-	新股流通	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

		30	11	受限						
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	新股 流通 受限	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3009 43	春晖 智控	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	9.79	23.0 1	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
3009 67	晓鸣 股份	2021 -04- 02	2021 -10- 13	新股 流通 受限	4.54	11.5 4	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	新股 流通 受限	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 29	华骐 环保	2021 -01- 12	2021 -07- 21	新股 流通 受限	13.8 7	29.5 5	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	新股 流通 受限	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,91 7.30	4,91 7.30	-
3009 95	奇德 新材	2021 -05- 17	2021 -11- 26	新股 流通 受限	14.7 2	23.3 2	191	2,81 1.52	4,45 4.12	-
3010 07	德迈 仕	2021 -06- 04	2021 -12- 16	新股 流通 受限	5.29	14.4 4	303	1,60 2.87	4,37 5.32	-
3009 98	宁波 方正	2021 -05- 25	2021 -12- 02	新股 流通 受限	6.02	21.3 2	201	1,21 0.02	4,28 5.32	-
3010 12	扬电 科技	2021 -06- -	2021 -12- -	新股 流通	8.05	24.2 6	170	1,36 8.50	4,12 4.20	-

		15	22	受限						
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风

风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管

理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 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	226,617,591.80	-	-	-	226,617,591.80
结算备付金	3,386,142.46	-	-	-	3,386,142.46

存出保证金	617,952.04	-	-	-	617,952.04
交易性金融资产	123,960,944.97	-	-	3,605,440,432.96	3,729,401,377.93
应收利息	-	-	-	2,156,602.41	2,156,602.41
应收申购款	-	-	-	26,551,014.62	26,551,014.62
资产总计	354,582,631.27	-	-	3,634,148,049.99	3,988,730,681.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	145,990,828.87	145,990,828.87
应付赎回款	-	-	-	36,200,936.16	36,200,936.16
应付管理人报酬	-	-	-	4,270,621.83	4,270,621.83
应付托管费	-	-	-	711,770.30	711,770.30
应付交易费用	-	-	-	2,948,240.29	2,948,240.29
其他负债	-	-	-	183,871.93	183,871.93
负债总计	-	-	-	190,306,269.38	190,306,269.38
利率敏感度缺口	354,582,631.27	-	-	3,443,841,780.61	3,798,424,411.88
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	162,233,931.51	-	-	-	162,233,931.51
结算备付金	7,203,869.14	-	-	-	7,203,869.14
存出保证金	560,532.87	-	-	-	560,532.87
交易性金融资产	55,740,056.70	-	1,680,000.00	3,735,169,403.04	3,792,589,459.74

应收证券清算款	-	-	-	5,840,131.38	5,840,131.38
应收利息	-	-	-	1,095,163.81	1,095,163.81
应收申购款	-	-	-	10,795,511.86	10,795,511.86
资产总计	225,738,390.22	-	1,680,000.00	3,752,900,210.09	3,980,318,600.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,395,767.99	35,395,767.99
应付管理人报酬	-	-	-	4,571,870.96	4,571,870.96
应付托管费	-	-	-	761,978.51	761,978.51
应付交易费用	-	-	-	3,886,748.51	3,886,748.51
应交税费	-	-	-	3.67	3.67
其他负债	-	-	-	190,645.95	190,645.95
负债总计	-	-	-	44,807,015.59	44,807,015.59
利率敏感度缺口	225,738,390.22	-	1,680,000.00	3,708,093,194.50	3,935,511,584.72

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年06月30日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为3.26% (2020年12月31日:1.46%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020年12月31日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,605,440,432.96	94.92	3,735,169,403.04	94.91
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	3,605,440,432.96	94.92	3,735,169,403.04	94.91

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	357,166,082.19	263,568,494.02
	2. 业绩比较基准下降5%	-357,166,082.19	-263,568,494.02

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为3,522,165,971.32元，属于第二层次的余额为207,235,406.61元，第三层次的余额为0.00元(2020年12月31日：第一层次3,728,887,464.08元，第二层次63,701,995.66元，无第三层次。)

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

(2) 除公允价值外，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	3,605,440,432.96	90.39
	其中：股票	3,605,440,432.96	90.39
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	123,960,944.97	3.11
	其中：债券	123,960,944.97	3.11
	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	230,003,734.26	5.77
8	其他各项资产	29,325,569.07	0.74
9	合计	3,988,730,681.26	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,920,104,662.17	76.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00

F	批发和零售业	328,753.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,620,241.70	0.10
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	280,024,364.12	7.37
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	401,233,569.60	10.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,605,440,432.96	94.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告本期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	765,115	409,183,502.00	10.77
2	601012	隆基股份	3,349,687	297,586,193.08	7.83
3	300014	亿纬锂能	1,936,585	201,269,279.05	5.30
4	603259	药明康德	1,181,575	185,022,829.25	4.87
5	300015	爱尔眼科	2,586,025	183,556,054.50	4.83
6	002812	恩捷股份	656,237	153,625,081.70	4.04
7	002709	天赐材料	1,363,648	145,337,603.84	3.83

8	600763	通策医疗	352,387	144,831,057.00	3.81
9	603501	韦尔股份	428,264	137,901,008.00	3.63
10	300782	卓胜微	239,289	127,518,276.58	3.36
11	002821	凯莱英	317,892	118,004,857.20	3.11
12	603986	兆易创新	618,244	116,168,047.60	3.06
13	300274	阳光电源	843,830	97,091,079.80	2.56
14	603659	璞泰来	704,333	96,211,887.80	2.53
15	002594	比亚迪	364,404	91,465,404.00	2.41
16	600809	山西汾酒	200,663	89,897,024.00	2.37
17	002371	北方华创	292,535	81,143,358.30	2.14
18	002459	晶澳科技	1,555,190	76,204,310.00	2.01
19	300347	泰格医药	376,857	72,846,458.10	1.92
20	300759	康龙化成	335,423	72,783,436.77	1.92
21	603799	华友钴业	608,924	68,191,503.10	1.80
22	002460	赣锋锂业	546,147	66,132,940.23	1.74
23	300896	爱美客	75,620	59,655,105.60	1.57
24	688169	石头科技	45,349	56,936,564.00	1.50
25	300037	新宙邦	460,043	46,050,304.30	1.21
26	300763	锦浪科技	205,360	37,088,016.00	0.98
27	603486	科沃斯	154,500	35,238,360.00	0.93
28	688696	极米科技	39,596	32,943,872.00	0.87
29	002475	立讯精密	639,861	29,433,606.00	0.77
30	300363	博腾股份	345,900	29,097,108.00	0.77
31	688390	固德威	84,113	28,093,742.00	0.74
32	300957	贝泰妮	99,423	26,995,405.18	0.71
33	688408	中信博	118,727	23,840,381.60	0.63
34	688202	美迪西	42,387	22,037,001.30	0.58
35	600519	贵州茅台	8,768	18,033,145.60	0.47
36	300760	迈瑞医疗	36,700	17,617,835.00	0.46
37	300595	欧普康视	167,094	17,302,583.70	0.46
38	688116	天奈科技	122,983	14,511,994.00	0.38

39	300751	迈为股份	23,506	10,688,178.20	0.28
40	688050	爱博医疗	27,790	10,498,506.20	0.28
41	688005	容百科技	72,415	8,776,698.00	0.23
42	300919	中伟股份	51,010	8,314,630.00	0.22
43	300568	星源材质	186,772	7,726,757.64	0.20
44	000858	五 粮 液	21,725	6,471,660.25	0.17
45	603290	斯达半导	13,200	4,224,000.00	0.11
46	603806	福斯特	37,220	3,912,938.60	0.10
47	601865	福莱特	90,600	3,581,418.00	0.09
48	300613	富瀚微	22,800	3,554,064.00	0.09
49	300769	德方纳米	10,100	2,087,569.00	0.05
50	300458	全志科技	21,100	1,849,626.00	0.05
51	300450	先导智能	27,006	1,624,140.84	0.04
52	300661	圣邦股份	3,211	811,516.03	0.02
53	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.02
54	688606	奥泰生物	2,703	376,554.93	0.01
55	688200	华峰测控	765	362,097.45	0.01
56	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
57	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.01
58	605099	共创草坪	6,200	262,756.00	0.01
59	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
60	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.01
61	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
62	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
63	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.00
64	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
65	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
66	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
67	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
68	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
69	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00

70	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
71	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
72	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
73	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
74	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
75	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
76	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
77	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
78	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
79	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
80	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
81	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
82	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
83	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
84	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
85	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
86	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
87	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
88	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
89	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
90	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
93	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
94	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
95	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
96	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
97	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
98	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
99	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
100	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00

101	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
102	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
103	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
104	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
105	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
106	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
107	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
108	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
109	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
110	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
111	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
112	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
113	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
114	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
115	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
116	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
117	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
118	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
119	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
120	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
121	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
122	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
123	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
124	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
125	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
126	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
127	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
128	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
129	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
130	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
131	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

132	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603986	兆易创新	154,589,286.78	3.93
2	002371	北方华创	154,060,588.91	3.91
3	688169	石头科技	120,771,903.78	3.07
4	603501	韦尔股份	103,132,518.51	2.62
5	600519	贵州茅台	100,665,602.81	2.56
6	603659	璞泰来	92,492,978.69	2.35
7	300122	智飞生物	91,645,707.50	2.33
8	300896	爱美客	90,768,218.76	2.31
9	300782	卓胜微	84,727,134.77	2.15
10	002459	晶澳科技	80,287,253.13	2.04
11	603799	华友钴业	80,066,745.59	2.03
12	300274	阳光电源	78,630,338.50	2.00
13	600763	通策医疗	77,111,891.05	1.96
14	600745	闻泰科技	73,780,274.93	1.87
15	600809	山西汾酒	65,964,544.69	1.68
16	000661	长春高新	65,772,332.46	1.67
17	002594	比亚迪	64,576,271.12	1.64
18	000568	泸州老窖	63,270,463.01	1.61
19	002475	立讯精密	56,651,306.34	1.44
20	300015	爱尔眼科	55,076,857.97	1.40

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	002475	立讯精密	243,080,148.34	6.18
2	000858	五 粮 液	160,219,800.25	4.07
3	603501	韦尔股份	144,821,722.90	3.68
4	600519	贵州茅台	144,176,217.03	3.66
5	300750	宁德时代	122,152,320.36	3.10
6	300122	智飞生物	114,506,262.75	2.91
7	000661	长春高新	111,114,835.19	2.82
8	000568	泸州老窖	103,380,468.82	2.63
9	002594	比亚迪	91,468,924.71	2.32
10	600276	恒瑞医药	88,727,845.92	2.25
11	000333	美的集团	88,567,317.83	2.25
12	600809	山西汾酒	87,915,439.53	2.23
13	300677	英科医疗	86,017,149.04	2.19
14	300782	卓胜微	84,023,355.59	2.14
15	300037	新宙邦	83,473,778.43	2.12
16	601012	隆基股份	83,440,430.85	2.12
17	601633	长城汽车	77,581,927.04	1.97
18	300661	圣邦股份	73,455,295.23	1.87
19	600745	闻泰科技	70,987,563.37	1.80
20	002459	晶澳科技	69,943,416.41	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	3,142,302,696.08
卖出股票收入（成交）总额	3,855,243,881.29

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	104,802,255.80	2.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,158,689.17	0.50
	其中：政策性金融债	19,158,689.17	0.50
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	123,960,944.97	3.26

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019649	21国债01	337,300	33,753,611.00	0.89
2	019645	20国债15	238,400	23,913,904.00	0.63
3	010107	21国债(7)	238,150	23,862,630.00	0.63
4	108604	国开1805	191,071	19,158,689.17	0.50
5	019640	20国债10	162,340	16,234,000.00	0.43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 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	617,952.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,156,602.41
5	应收申购款	26,551,014.62

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,325,569.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300782	卓胜微	34,806,514.08	0.92	非公开发行限售

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

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
384,594	3,963.68	349,009,386.61	22.89%	1,175,399,671.93	77.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	4,531,639.46	0.30%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年01月29日)基金份额总额	4,976,750,390.34
本报告期期初基金份额总额	1,891,624,730.03
本报告期基金总申购份额	1,132,847,969.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,500,063,641.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,524,409,058.54

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	105,414,350.87	1.52%	98,172.37	1.52%	—
财通证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
川财证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	515,523,208.67	7.42%	480,106.91	7.42%	—
东方	1	221,860,044.11	3.19%	206,618.29	3.19%	—

财富						
东方 证券	1	156,237,763.94	2.25%	145,523.12	2.25%	-
东吴 证券	1	583,214,423.44	8.40%	543,147.28	8.40%	-
东兴 证券	1	-	-	-	-	-
光大 证券	1	239,926,915.08	3.45%	223,445.01	3.45%	-
广发 证券	1	713,702,831.30	10.28%	664,671.13	10.28%	-
国金 证券	1	644,283,686.99	9.28%	600,022.22	9.28%	-
国泰 君安	1	347,889,545.43	5.01%	323,989.84	5.01%	-
国信 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	721,218,683.28	10.39%	671,671.28	10.38%	-
华泰 证券	1	195,957,602.69	2.82%	182,495.83	2.82%	-
平安 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	65,782,570.47	0.95%	61,453.14	0.95%	-
天风 证券	1	64,167,127.98	0.92%	59,757.03	0.92%	-
西部 证券	1	111,892,827.79	1.61%	104,205.23	1.61%	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	927,327,381.14	13.35%	863,618.43	13.35%	-

浙商证券	1	749,150,949.11	10.79%	697,693.44	10.79%	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	407,105,328.51	5.86%	379,232.79	5.86%	—
中信证券(华南)	1	—	—	—	—	—
国都证券	2	2,348,250.00	0.03%	2,221.23	0.03%	—
中泰证券	2	171,773,717.12	2.47%	159,972.96	2.47%	—

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

2. 本报告期内，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	8,891,522.75	6.81%	—	—	—	—	—	—
财通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—	—	—
川财证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方财富	—	—	—	—	—	—	—	—

东方证券	12,205,458.27	9.35%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	15,407,547.52	11.81%	-	-	-	-	-	-
国金证券	11,826,561.22	9.06%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	3,180,190.05	2.44%	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	24,142,067.56	18.50%	-	-	-	-	-	-
浙商证券	43,216,694.98	33.11%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	11,638,374.12	8.92%	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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

2. 本报告期内，本基金新增东方财富深圳和中金公司上海交易单元的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧明睿新起点混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
2	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-09
3	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-20
4	中欧明睿新起点混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
5	中欧明睿新起点混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额不存在达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧明睿新起点混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧明睿新起点混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧明睿新起点混合型证券投资基金托管协议》

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

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话: 021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日