

中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF） 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 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.....	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	中欧创新未来混合（LOF）
场内简称	中欧创新
基金主代码	501208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 10 月 9 日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,423,099,599.71 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过投向创新未来主题相关股票，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	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	朱萍
	联系电话	021-68609600	021-31888888
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95528
传真		021-33830351	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	上海市博成路 1388 号浦银中心

	家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	窦玉明	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	-81,009,490.44
本期利润	185,240,370.80
加权平均基金份额本期利润	0.0321
本期加权平均净值利润率	3.47%
本期基金份额净值增长率	2.59%
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	-751,274,021.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1385
期末基金资产净值	4,924,809,867.44
期末基金份额净值	0.9081
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	-9.19%

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、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

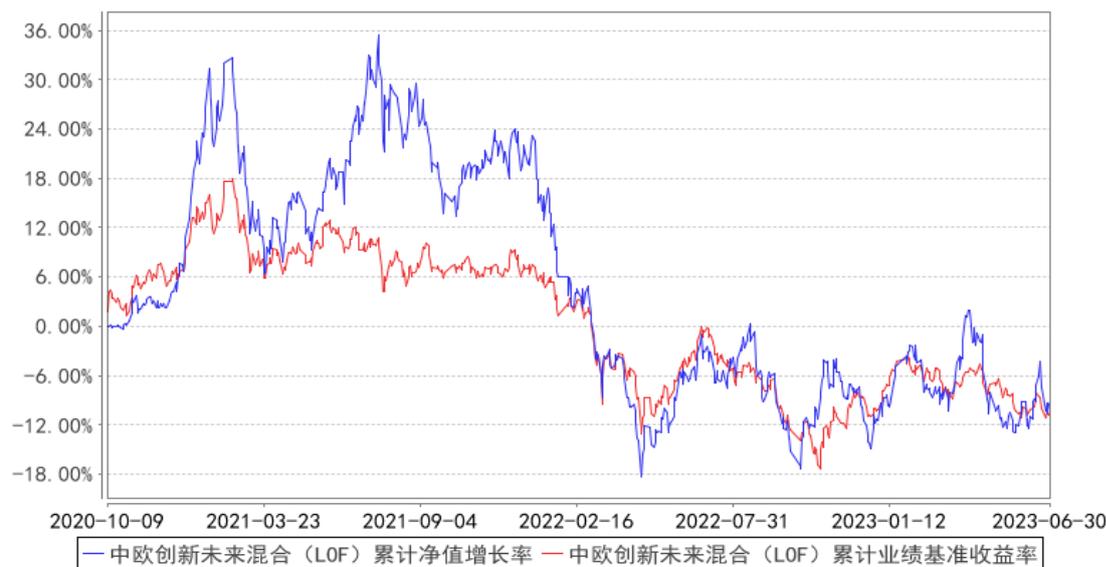
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.68%	1.79%	0.84%	0.72%	0.84%	1.07%
过去三个月	-7.69%	1.62%	-4.34%	0.65%	-3.35%	0.97%
过去六个月	2.59%	1.45%	-0.28%	0.66%	2.87%	0.79%
过去一年	-6.44%	1.38%	-9.92%	0.79%	3.48%	0.59%
自基金合同生效起至今	-9.19%	1.45%	-10.33%	0.89%	1.14%	0.56%

注：本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*70%+银行活期存款利率(税后)*20%+恒生指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧创新未来混合（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘金辉	基金经理	2020-10-09	-	8 年	历任兴业全球基金管理有限公司金融工程与专题部研究员。2015-03-30 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。
邵洁	基金经理	2020-10-09	-	11 年	历任国金证券电子行业分析师，安信证券电子行业高级分析师。2016-04-15 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。
周蔚文	权益投决会主席 / 投资总监 / 基金经理	2021-12-17	-	23 年	历任光大证券研究所研究员，富国基金研究员、高级研究员、基金经理。2011-01-10 加入中欧基金管理有限公司，历任研究部总监、副总经理、权益投决会委员。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 69 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 1 季度，市场从疫情后的悲观预期迅速修复，春节前海内外都对经济复苏抱有较高期待，港股市场和稳增长板块表现良好。而实际上全球经济增长放缓，国内复苏还需要一定时间，因此在流动性宽松且高增长行业趋势不明朗的时候，创新和政策更吸引市场关注。TMT 行业在 22 年 Q4 下跌，年初先估值修复，春节后 Chatgpt 引发市场关注，海内外公司 AI 模型、应用迅速推出，3 月份迎来一波猛烈的主题行情。4-5 月，整体科技经历了较为猛烈的回调。进入 5 月之后，部分海外公司在财报会议上公布 AI 业务进展，传媒和通信作为代表 AI 应用和算力的板块，指数在剧烈波动后分别收涨 6.86% 和 12.83%。由于新技术布局需要较长时间的积累和较高资金的投入，行业预期高成长和产业减持股票的背景下，科技板块内部波动更为剧烈。

2023 年上半年，指数经历较多震荡，沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，上证指数上涨 3.65%，科创 50 指数上涨 4.71%。市场从疫情后经济恢复的乐观到预期国内平稳复苏、美国持续加息、人民币持续贬值。我们布局了成长行业创新方向，增加了科技行业的配置，包括 TMT，新能源的新终端、新技术和新设备。我们还是坚守有价值、业绩未来几个季度有正向反应、或者未来业务成长空间大的个股，科技经过一年的下跌，行业估值偏低，部分细分行业受益经济复苏弹性大，我们依然会寻找更好的个股机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金份额净值增长率为 2.59%，同期业绩比较基准收益率为 -0.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年年初大家都对经济复苏链平稳恢复预期较高；海外欧美在疫情补贴刺激之后，通胀持续高企，迅速加息后外需逆风，5 月份的出口数据印证下行趋势。与年初预计较为不同的地方是，全球经济并没有呈现“中强美弱”的格局，海外在弱预期强现实的情况下，权益市场表现较为亮眼。由于中国复苏的速度和欧美衰退的速度幅度都比预期更为缓慢，导致行业表现呈现结构化、主题投资和非机构重仓特征明显。我们相信，经济最终一定会恢复增长趋势，在计入足够多的预期之后，股价的潜在增长空间已经足够可观。

复苏后的正常经济活动让市场也从追求短期业绩增速到憧憬未来美好生活，受益于经济复苏和长期创新的行业再次成为市场的关注点。科技行业创新的帷幕已经在渐渐拉开，我们非常期待未来三年世界会因为软硬件创新而产生的巨大改变，生产力和消费娱乐将迎来新一轮革新。回望过去每一轮科技创新周期的到来，人们总是高估短期的影响却又低估长期的力量，如何在这一轮智能的环境中不要被旧式思维束缚是每一个投资管理人需要思考的问题。通过对于行业深度的分析和思考，我们将持仓全面转向受益新科技产业方向并且管理层较为优秀的成长股。

展望下半年，随着国内呵护经济的情绪渐浓，且本轮制造业库存周期逐渐从去库存进入到补库存，平稳情况下，Q4 或将进入补库存拐点，企业投资周期和消费需求都有望会在三季度企稳，服务类消费下半年具备较大改善潜力，叠加传统周期修复动能趋稳，预计下半年新老周期将共同促进经济增长。我们认为引领下一轮内生增长提升的新技术（AI、MR、智能汽车、机器人）将会是经济企稳后的投资重点，同时半导体行业将受益经济需求回暖，兼具创新和复苏双重成长动力，具有较好的投资价值。医药和消费在过去两年的泡沫挤压过程中也来到了合理估值区间，具备长期投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）

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	333,055,464.52	622,117,544.64
结算备付金		19,970,403.77	15,260,862.06
存出保证金		1,381,892.16	3,073,217.69
交易性金融资产	6.4.7.2	4,562,691,497.78	4,818,809,259.81
其中：股票投资		4,411,236,292.86	4,667,443,232.41
基金投资		-	-
债券投资		151,455,204.92	151,366,027.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		27,666,108.74	34,469,439.66
应收股利		-	-
应收申购款		1,091,375.64	620,407.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,945,856,742.61	5,494,350,731.04
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,860,276.08	18.04
应付赎回款		2,341,064.76	3,667,258.14
应付管理人报酬		6,119,908.09	7,138,116.88
应付托管费		815,987.72	951,748.94
应付销售服务费		1,631,975.51	1,903,497.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,277,663.01	5,152,028.91
负债合计		21,046,875.17	18,812,668.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,423,099,599.71	6,185,383,445.40
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-498,289,732.27	-709,845,383.13
净资产合计		4,924,809,867.44	5,475,538,062.27
负债和净资产总计		4,945,856,742.61	5,494,350,731.04

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 5,423,099,599.71 份，基金份额净值为人民币 0.9081 元。

6.2 利润表

会计主体：中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		241,201,032.27	-2,444,638,291.03
1. 利息收入		945,647.25	8,490,062.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	857,974.52	8,281,572.56
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		87,672.73	208,489.70
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,426,456.31	-1,747,108,982.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-42,247,650.77	-1,771,321,466.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,455,981.72	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	14,365,212.74	24,212,484.41
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	266,249,861.24	-706,923,765.38
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	431,980.09	904,394.42
减：二、营业总支出		55,960,661.47	87,057,597.44
1. 管理人报酬		39,872,070.02	62,069,181.59
2. 托管费		5,316,275.98	8,275,890.90
3. 销售服务费		10,632,552.01	16,551,781.72
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	139,763.46	160,743.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		185,240,370.80	-2,531,695,888.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		185,240,370.80	-2,531,695,888.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		185,240,370.80	-2,531,695,888.47

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）

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）	6,185,383,445.40	-	-709,845,383.13	5,475,538,062.27
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）	6,185,383,445.40	-	-709,845,383.13	5,475,538,062.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-762,283,845.69	-	211,555,650.86	-550,728,194.83
（一）、综合收益总额	-	-	185,240,370.80	185,240,370.80
（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）	-762,283,845.69	-	26,315,280.06	-735,968,565.63

其中：1. 基金申购款	193,480,225.16	-	-15,829,032.02	177,651,193.14
2. 基金赎回款	-955,764,070.85	-	42,144,312.08	-913,619,758.77
（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）	5,423,099,599.71	-	-498,289,732.27	4,924,809,867.44
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	9,133,806,132.06	-	2,112,157,542.86	11,245,963,674.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	9,133,806,132.06	-	2,112,157,542.86	11,245,963,674.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,989,960,731.11	-	-2,321,972,597.16	-4,311,933,328.27
（一）、综合收益总额	-	-	-2,531,695,888.47	-2,531,695,888.47
（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）	-1,989,960,731.11	-	209,723,291.31	-1,780,237,439.80
其中：1. 基金申购款	123,826,166.13	-	-12,265,280.85	111,560,885.28

2. 基金赎回款	-2,113,786,897.24	-	221,988,572.16	-1,891,798,325.08
(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）	7,143,845,400.95	-	-209,815,054.30	6,934,030,346.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）（原名为中欧创新未来 18 个月封闭运作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[2020]2281 号《关于准予中欧创新未来 18 个月封闭运作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《中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，存续期限不定，基金合同生效后的前 18 个月为封闭运作期，即本基金的封闭运作期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）至 18 个月后的月度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期届满开放后，基金名称调整为中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 12,000,000,412.25 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 61336106_B28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 12,001,816,363.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,815,951.00 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，注册登记机构为中国

证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金合同生效后的前 18 个月为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 4 月 10 日届满后，本基金自 2022 年 4 月 11 日起进入开放期，基金名称变更为“中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）”。基金管理人对基金合同、托管协议进行了修订，修订的基金合同和托管协议自 2022 年 4 月 11 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、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、分离交易可转债等）、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、股票期权等）、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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：封闭运作期内，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-100%，投资于创新未来主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；在封闭运作期结束前 2 个月的期间内，本基金投资不受上述比例限制。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×20%。

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、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6. 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	333,055,464.52
等于：本金	333,030,800.07
加：应计利息	24,664.45
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	333,055,464.52

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	4,209,924,964.09	-	4,411,236,292.86	201,311,328.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	150,145,050.00	1,185,204.92	151,455,204.92
	合计	150,145,050.00	1,185,204.92	151,455,204.92
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,360,070,014.09	1,185,204.92	4,562,691,497.78	201,436,278.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,211.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,162,396.28

其中：交易所市场	4,161,196.28
银行间市场	1,200.00
应付利息	-
预提费用-审计费	54,547.97
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	4,277,663.01

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,185,383,445.40	6,185,383,445.40
本期申购	193,480,225.16	193,480,225.16
本期赎回（以“-”号填列）	-955,764,070.85	-955,764,070.85
本期末	5,423,099,599.71	5,423,099,599.71

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 196,558,962.00 份（截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 247,219,147.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 5,226,540,637.71 份（截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金托管在场外未上市交易的基金份额为 6,896,626,253.95 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现本基金在两个系统之间的转换。

6.4.7.8 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	-780,006,338.54	70,160,955.41	-709,845,383.13
本期利润	-81,009,490.44	266,249,861.24	185,240,370.80
本期基金份额交易产生的变动数	109,741,807.30	-83,426,527.24	26,315,280.06
其中：基金申购款	-27,420,577.79	11,591,545.77	-15,829,032.02
基金赎回款	137,162,385.09	-95,018,073.01	42,144,312.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-751,274,021.68	252,984,289.41	-498,289,732.27

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
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	138,297.25
其他	16,468.27
合计	857,974.52

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	6,533,117,614.73
减：卖出股票成本总额	6,558,025,635.94
减：交易费用	17,339,629.56
买卖股票差价收入	-42,247,650.77

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	1,451,601.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,380.00
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	1,455,981.72

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	152,529,190.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	149,986,350.00
减：应计利息总额	2,537,260.27
减：交易费用	1,200.00
买卖债券差价收入	4,380.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,365,212.74
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	14,365,212.74

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	266,249,861.24
股票投资	265,958,561.24
债券投资	291,300.00
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	266,249,861.24

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	431,977.40
基金转换费收入	2.69
合计	431,980.09

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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,043.41
账户维护费	9,000.00
其他	16.00
证券组合费	5,648.71
合计	139,763.46

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东

自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国都证券	2,100,002,121.47	16.73	1,083,732,963.69	3.06

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国都证券	1,411,958.23	15.74	125,902.27	3.03
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国都证券	656,789.93	2.59	656,789.93	6.05

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	39,872,070.02	62,069,181.59
其中：支付销售机构的客户维护费	19,255,106.80	29,611,867.11

注：1、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

2、基金管理费每日计算，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支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,316,275.98	8,275,890.90

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

2、基金托管费每日计算，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支取。若遇法定节假日、公休假等，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
	中欧创新未来混合（LOF）
中欧财富	147,425.34

中欧基金	0.00
合计	147,425.34
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	中欧创新未来混合（LOF）
中欧财富	185,668.93
中欧基金	109.19
合计	185,778.12

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为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支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

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	204,202.70	0.00%	167,328.05	0.00%

注：1、本报告期间，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

2、本报告期末自然人股东持有本基金份额实际占比为 0.0038%，上报告期末自然人股东持有本基金份额的实际占比为 0.0027%，上述展示系四舍五入的结果。

3、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适用的费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	333,055,464.52	703,209.00	774,046,029.35	2,099,108.22

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻	2023 年 5 月 15	6 个月	新股流	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

	造	日		通受限						
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
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	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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	-

				限						
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301246	宏源	2023年3	6个月	新股	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-

	药业	月 10 日		流通受限						
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 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	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
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	687	22,217.58	21,887.82	-
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	2023年6	6个月	新股	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-

	智能	月1日		流通受限						
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	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月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	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-

				受限						
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
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	378	11,336.22	8,992.62	-
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	2023	6个月	新	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-

	信新材	年6月21日		股流通受限						
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	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
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	949	18,970.51	16,038.10	-
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	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-

				受限						
301488	豪恩 汽车	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 汽车	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	-
601061	中信 金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青 科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重 科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚 节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万	2023	6 个月	新	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

	丰股份	年 4 月 28 日		股流通受限						
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
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	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
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	-
688433	华曙高	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

	科	日		通受限						
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	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	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-

688512	慧智微	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	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	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	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	2023	6个月	新	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-

	玛智控	年 5 月 29 日		股流通受限						
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	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	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

	技	日		通 受 限						
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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要通过投向创新未来主题相关股票，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的检查和反馈。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之内。

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于约定开放日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于开放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发行的证券不得超过该证券的 10%。在开放期，本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	333,055,464.52	-	-	-	333,055,464.52
结算备付金	19,970,403.77	-	-	-	19,970,403.77
存出保证金	1,381,892.16	-	-	-	1,381,892.16
交易性金融资产	151,455,204.92	-	-	4,411,236,292.86	4,562,691,497.78
应收申购款	-	-	-	1,091,375.64	1,091,375.64
应收清算款	-	-	-	27,666,108.74	27,666,108.74
资产总计	505,862,965.37	-	-	4,439,993,777.24	4,945,856,742.61
负债					

应付赎回款	-	-	-	2,341,064.76	2,341,064.76
应付管理人报酬	-	-	-	6,119,908.09	6,119,908.09
应付托管费	-	-	-	815,987.72	815,987.72
应付清算款	-	-	-	5,860,276.08	5,860,276.08
应付销售服务费	-	-	-	1,631,975.51	1,631,975.51
其他负债	-	-	-	4,277,663.01	4,277,663.01
负债总计	-	-	-	21,046,875.17	21,046,875.17
利率敏感度缺口	505,862,965.37	-	-	-4,418,946,902.07	4,924,809,867.44
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	622,117,544.64	-	-	-	622,117,544.64
结算备付金	15,260,862.06	-	-	-	15,260,862.06
存出保证金	3,073,217.69	-	-	-	3,073,217.69
交易性金融资产	151,366,027.40	-	-	-4,667,443,232.41	4,818,809,259.81
应收清算款	-	-	-	34,469,439.66	34,469,439.66
应收申购款	-	-	-	620,407.18	620,407.18
资产总计	791,817,651.79	-	-	-4,702,533,079.25	5,494,350,731.04
负债					
应付清算款	-	-	-	18.04	18.04
应付赎回款	-	-	-	3,667,258.14	3,667,258.14
应付管理人报酬	-	-	-	7,138,116.88	7,138,116.88
应付托管费	-	-	-	951,748.94	951,748.94
应付销售服务费	-	-	-	1,903,497.86	1,903,497.86
其他负债	-	-	-	5,152,028.91	5,152,028.91
负债总计	-	-	-	18,812,668.77	18,812,668.77
利率敏感度缺口	791,817,651.79	-	-	-4,683,720,410.48	5,475,538,062.27

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 3.08%（2022 年 12 月 31 日：2.76%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	235,050,294.82	-	235,050,294.82
资产合计	-	235,050,294.82	-	235,050,294.82
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	235,050,294.82	-	235,050,294.82
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	89,101,605.65	-	89,101,605.65
资产合计	-	89,101,605.65	-	89,101,605.65
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	89,101,605.65	-	89,101,605.65

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬	-11,752,514.74	-4,455,080.28

	值 5%		
	港币相对人民币升值 5%	11,752,514.74	4,455,080.28

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	4,411,236,292.86	89.57	4,667,443,232.41	85.24
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	4,411,236,292.86	89.57	4,667,443,232.41	85.24

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%	302,132,513.91	226,229,057.61
	业绩比较基准下降	-302,132,513.91	-226,229,057.61

	5%		
--	----	--	--

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	4,408,700,567.72	4,622,536,493.83
第二层次	152,244,134.10	151,366,027.40
第三层次	1,746,795.96	44,906,738.58
合计	4,562,691,497.78	4,818,809,259.81

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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	4,411,236,292.86	89.19
	其中：股票	4,411,236,292.86	89.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	151,455,204.92	3.06
	其中：债券	151,455,204.92	3.06
	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	353,025,868.29	7.14
8	其他各项资产	30,139,376.54	0.61
9	合计	4,945,856,742.61	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 235,050,294.82 元，占基金资产净值比例 4.77%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,475,037.00	0.44
C	制造业	2,331,556,087.46	47.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	58,842,510.25	1.19
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	1,647,282,385.80	33.45
J	金融业	112,614,604.00	2.29
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	4,308,666.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,176,185,998.04	84.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	29,779,598.12	0.60
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	35,158,942.06	0.71
电信服务	170,111,754.64	3.45
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	235,050,294.82	4.77

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	10,633,359	470,951,470.11	9.56
2	688111	金山办公	990,976	467,958,686.72	9.50
3	002475	立讯精密	12,734,108	413,221,804.60	8.39
4	688630	芯碁微装	4,201,298	352,993,057.96	7.17
5	688608	恒玄科技	1,859,510	225,056,495.30	4.57
6	002987	京北方	9,977,654	218,710,175.68	4.44
7	600584	长电科技	5,095,542	158,828,044.14	3.23
8	688201	信安世纪	3,561,001	152,197,182.74	3.09
9	00700	腾讯控股	456,000	139,412,227.01	2.83
10	688981	中芯国际	2,537,808	128,210,060.16	2.60
11	688556	高测股份	2,366,184	125,739,017.76	2.55
12	603893	瑞芯微	1,716,558	125,051,250.30	2.54
13	002006	精功科技	4,152,545	89,570,395.65	1.82

14	300033	同花顺	465,400	81,575,312.00	1.66
15	002063	远光软件	9,115,748	79,124,692.64	1.61
16	603383	顶点软件	1,387,320	76,885,274.40	1.56
17	600745	闻泰科技	1,456,900	71,242,410.00	1.45
18	300223	北京君正	723,378	63,881,511.18	1.30
19	000034	神州数码	2,209,800	58,758,582.00	1.19
20	002049	紫光国微	581,572	54,231,589.00	1.10
21	301327	华宝新能	625,556	49,487,735.16	1.00
22	300751	迈为股份	291,960	49,452,184.80	1.00
23	688200	华峰测控	297,707	45,549,171.00	0.92
24	601138	工业富联	1,457,800	36,736,560.00	0.75
25	603986	兆易创新	307,460	32,667,625.00	0.66
26	688083	中望软件	217,209	31,471,412.01	0.64
27	300803	指南针	638,800	31,039,292.00	0.63
28	01024	快手-W	621,800	30,699,527.63	0.62
29	688798	艾为电子	516,219	30,534,353.85	0.62
30	688107	安路科技	548,858	30,401,244.62	0.62
31	603039	泛微网络	345,900	28,235,817.00	0.57
32	00268	金蝶国际	2,845,000	27,489,386.89	0.56
33	03690	美团-W	225,900	25,472,066.99	0.52
34	002368	太极股份	580,100	23,882,717.00	0.48
35	600489	中金黄金	2,078,900	21,475,037.00	0.44
36	300725	药石科技	442,840	21,446,741.20	0.44
37	000066	中国长城	1,537,224	21,259,807.92	0.43
38	688609	九联科技	1,697,337	20,198,310.30	0.41
39	601208	东材科技	1,565,180	19,877,786.00	0.40
40	002271	东方雨虹	725,050	19,764,863.00	0.40
41	000786	北新建材	792,600	19,426,626.00	0.39
42	600276	恒瑞医药	397,700	19,049,830.00	0.39
43	300750	宁德时代	80,540	18,426,746.60	0.37
44	300226	上海钢联	556,756	18,038,894.40	0.37
45	688029	南微医学	210,673	17,182,489.88	0.35
46	301162	国能日新	193,060	15,228,572.80	0.31
47	300130	新国都	524,800	14,867,584.00	0.30
48	002410	广联达	439,194	14,269,413.06	0.29
49	300661	圣邦股份	154,732	12,708,139.16	0.26
50	603019	中科曙光	224,300	11,416,870.00	0.23
51	301299	卓创资讯	188,776	10,771,558.56	0.22
52	300845	捷安高科	478,700	10,402,151.00	0.21
53	000999	华润三九	169,500	10,281,870.00	0.21
54	003021	兆威机电	93,600	8,211,528.00	0.17
55	600588	用友网络	385,200	7,896,600.00	0.16
56	002912	中新赛克	174,800	7,692,948.00	0.16

57	600519	贵州茅台	3,400	5,749,400.00	0.12
58	03888	金山软件	192,200	5,466,760.55	0.11
59	688318	财富趋势	51,981	5,196,540.57	0.11
60	688182	灿勤科技	189,224	4,774,121.52	0.10
61	688052	纳芯微	28,415	4,500,083.55	0.09
62	002707	众信旅游	572,200	4,308,666.00	0.09
63	09992	泡泡玛特	268,200	4,307,531.13	0.09
64	600446	金证股份	257,800	3,748,412.00	0.08
65	01415	高伟电子	165,000	2,202,794.62	0.04
66	603662	柯力传感	31,800	1,170,240.00	0.02
67	688141	杰华特	9,946	388,888.60	0.01
68	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
69	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
70	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
71	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
72	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
73	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
74	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
75	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
76	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
77	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
78	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
79	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
80	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
81	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
82	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
83	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
84	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
85	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
86	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
87	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
88	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
89	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
90	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
91	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
92	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00
93	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
94	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
95	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
96	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
97	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
98	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
99	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00

100	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
101	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
102	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
103	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
104	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
105	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
106	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
107	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
108	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
109	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
110	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
111	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
112	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
113	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
114	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
115	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
116	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
117	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
118	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
119	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
120	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
121	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
122	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
123	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
124	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
125	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
126	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
127	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
128	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
129	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
130	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
131	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
132	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
133	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
134	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
135	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
136	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
137	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
138	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
139	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
140	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
141	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
142	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00

143	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
144	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
145	603125	常青科技	196	4,949.00	0.00
146	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
147	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
148	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
149	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
150	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
151	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
152	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
153	300014	亿纬锂能	6	363.00	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	600584	长电科技	262,297,521.13	4.79
2	03690	美团-W	213,102,342.32	3.89
3	688981	中芯国际	208,940,883.99	3.82
4	00700	腾讯控股	203,704,906.36	3.72
5	600570	恒生电子	193,241,351.81	3.53
6	002049	紫光国微	152,046,825.60	2.78
7	002410	广联达	151,119,012.24	2.76
8	603986	兆易创新	140,367,320.02	2.56
9	603893	瑞芯微	134,151,241.70	2.45
10	301269	华大九天	120,863,941.97	2.21
11	300033	同花顺	106,375,070.50	1.94
12	300725	药石科技	103,868,965.20	1.90
13	603383	顶点软件	102,406,419.78	1.87
14	688099	晶晨股份	98,086,714.00	1.79
15	300118	东方日升	97,364,265.36	1.78
16	002063	远光软件	92,719,003.76	1.69
17	300223	北京君正	87,257,109.05	1.59
18	002371	北方华创	87,013,586.71	1.59
19	300498	温氏股份	85,243,782.82	1.56
20	300433	蓝思科技	82,212,641.67	1.50

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	688111	金山办公	355,154,507.20	6.49

2	600732	爱旭股份	281,876,029.36	5.15
3	600570	恒生电子	229,999,087.01	4.20
4	002028	思源电气	200,849,205.73	3.67
5	03690	美团-W	175,546,749.39	3.21
6	688556	高测股份	157,960,160.22	2.88
7	300751	迈为股份	153,777,864.33	2.81
8	301269	华大九天	122,893,903.34	2.24
9	688608	恒玄科技	120,283,285.14	2.20
10	002410	广联达	118,867,172.75	2.17
11	000519	中兵红箭	117,114,426.00	2.14
12	600584	长电科技	111,720,643.11	2.04
13	601208	东材科技	107,132,940.00	1.96
14	002371	北方华创	101,784,016.73	1.86
15	300769	德方纳米	101,546,846.84	1.85
16	603228	景旺电子	100,138,884.85	1.83
17	688099	晶晨股份	98,767,114.75	1.80
18	02382	舜宇光学科 技	92,491,762.08	1.69
19	002049	紫光国微	91,216,930.82	1.67
20	603986	兆易创新	90,610,467.65	1.65

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,035,860,135.15
卖出股票收入（成交）总额	6,533,117,614.73

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	151,455,204.92	3.08
	其中：政策性金融债	151,455,204.92	3.08
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	151,455,204.92	3.08

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	230201	23 国开 01	1,500,000	151,455,204.92	3.08

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

本基金将以套期保值为主要目的，参与股指期货的投资。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。

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，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	1,381,892.16
2	应收清算款	27,666,108.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,091,375.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,139,376.54

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

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
1,254,237	4,323.82	7,122,628.81	0.13%	5,415,976,970.90	99.87%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	徐国良	3,719,075.00	1.89%
2	中泰证券资管—农业银行—中泰星河 21 号集合资产管理计划	3,536,551.00	1.80%
3	中信证券股份有限公司	2,037,232.00	1.04%
4	何宝岁	1,310,800.00	0.67%
5	张大庆	1,192,175.00	0.61%
6	王立新	1,056,228.00	0.54%
7	邹路忆	1,036,000.00	0.53%
8	胡浚川	1,000,299.00	0.51%

9	劳荣欢	1,000,180.00	0.51%
10	曹群	1,000,119.00	0.51%

注：上表所列持有人均为场内持有人。

8.3 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	2,089,133.87	0.04%

8.4 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年10月9日） 基金份额总额	12,001,816,363.25
本报告期期初基金份额总额	6,185,383,445.40
本报告期基金总申购份额	193,480,225.16
减：本报告期基金总赎回份额	955,764,070.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,423,099,599.71

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
长江证券	1	2,603,454,608.90	20.74	1,903,915.73	21.23	-
国都证券	2	2,100,002,121.47	16.73	1,411,958.23	15.74	-
国泰君安	1	1,847,556,389.75	14.72	1,351,125.48	15.06	-
申万宏源证券	1	1,765,263,483.97	14.06	1,290,934.12	14.39	-
华西证券	1	1,345,193,195.27	10.72	959,252.82	10.69	-
中金公司	1	1,277,360,861.25	10.18	917,863.58	10.23	-
中信证券	1	1,107,500,802.21	8.82	777,844.34	8.67	-
广发证券	1	361,281,786.54	2.88	263,095.73	2.93	-
国联证券	2	95,007,332.65	0.76	69,477.67	0.77	-
汇丰前海	2	48,272,597.4	0.38	24,136.30	0.27	-

		0				
中信建投	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	167,382,000.00	100.00	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	中欧创新未来混合型证券投资基金（	中国证监会指定媒介	2023-01-20

	LOF) 2022 年第四季度报告		
2	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
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	中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）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	中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
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	中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）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、中国证监会准予中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金变更注册的文件
- 2、《中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金合同（修订）》
- 3、《中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）托管协议（修订）》
- 4、《中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》
- 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