

中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	63

8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	76
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧丰泓沪港深灵活配置混合	
基金主代码	002685	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 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	4,361,916,476.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002685	002686
报告期末下属分级基金的份额总额	3,565,786,765.76 份	796,129,710.79 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 35% + 中证港股通综合指数收益率 \times 55% + 中证短债指数收益率 \times 10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95588
传真	021-33830351	(010) 66105798

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期间 数据 和 指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	中欧丰泓沪港 深灵活配置混 合 A	中欧丰泓沪 港深灵活配 置混合 C	中欧丰泓沪港 深灵活配置混 合 A	中欧丰泓沪 港深灵活配 置混合 C	中欧丰泓沪 港深灵活配 置混合 A	中欧丰泓沪 港深灵活配 置混合 C
本期已实现收益	-857,090,126 .04	-194,653,7 44.95	-845,202,861 .68	-138,150,88 1.53	-104,317,73 9.48	-15,461,08 8.70
本期利润	-1,114,367,3 20.77	-207,686,1 59.07	-1,611,819,3 35.98	-282,852,63 5.32	-184,774,01 6.75	-28,926,19 1.59

加权平均基金份额本期利润	-0.2612	-0.2135	-0.4093	-0.3990	-0.0804	-0.1073
本期加权平均净值利润率	-22.10%	-18.38%	-30.87%	-30.76%	-4.61%	-6.22%
本期基金份额净值增长率	-19.83%	-20.48%	-22.22%	-22.81%	10.54%	9.65%
3.1 .2 期末 数据 和 指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末	-1,413,643,685.11	-333,505,33.09	-788,067,830.59	-271,884,698.84	107,211,565.91	8,101,134.10

可供分配利润						
期末可供分配基金份额利润	-0.3964	-0.4189	-0.1833	-0.2018	0.0290	0.0179
期末基金资产净值	3,648,889,726.42	792,722,719.99	5,486,209,978.16	1,686,810,560.91	6,072,002,740.85	732,882,674.01
期末基金份额净值	1.0233	0.9957	1.2764	1.2521	1.6410	1.6220
3.1 .3 累计 期末 指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额	36.50%	29.45%	70.27%	62.79%	118.90%	110.88%

额 累 计 净 值 增 长 率						
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--

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

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.66%	1.37%	-5.02%	0.84%	-3.64%	0.53%
过去六个月	-8.65%	1.35%	-10.01%	0.87%	1.36%	0.48%
过去一年	-19.83%	1.43%	-10.68%	0.86%	-9.15%	0.57%
过去三年	-31.07%	1.74%	-29.53%	1.10%	-1.54%	0.64%
过去五年	34.42%	1.61%	-1.83%	1.06%	36.25%	0.55%
自基金合同生效起至今	36.50%	1.45%	-7.83%	0.95%	44.33%	0.50%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*35%+中证港股通综合指数收益率*55%+中证短债指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C

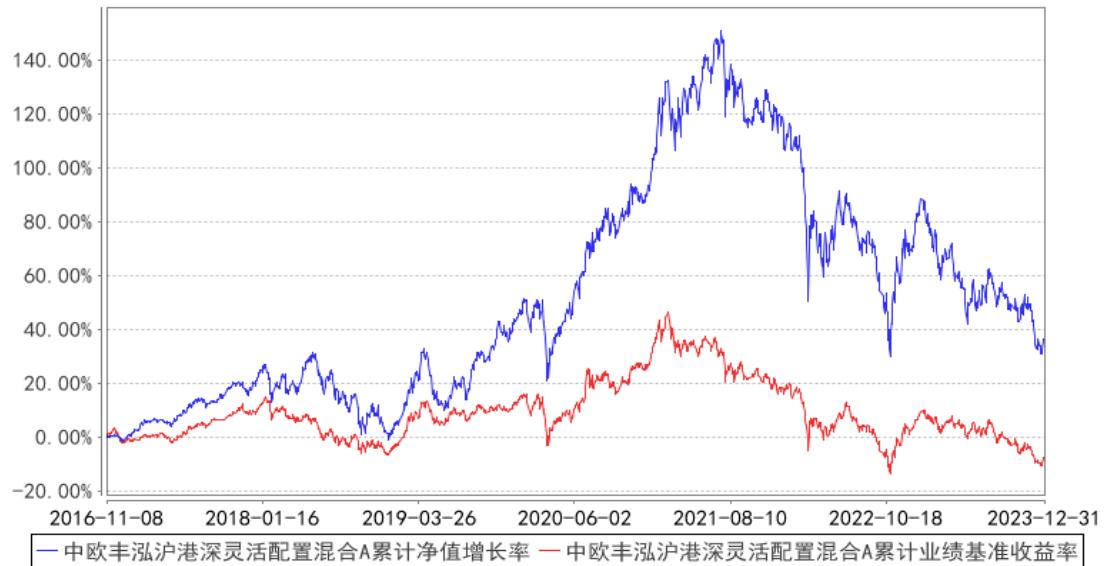
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②	率③	准差④		
过去三个月	-8.85%	1.38%	-5.02%	0.84%	-3.83%	0.54%
过去六个月	-9.04%	1.35%	-10.01%	0.87%	0.97%	0.48%
过去一年	-20.48%	1.43%	-10.68%	0.86%	-9.80%	0.57%
过去三年	-32.69%	1.74%	-29.53%	1.10%	-3.16%	0.64%
过去五年	29.38%	1.62%	-1.83%	1.06%	31.21%	0.56%
自基金合同生效起至今	29.45%	1.45%	-7.83%	0.95%	37.28%	0.50%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*35%+中证港股通综合指数收益率*55%+中证短债指数收益率*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。

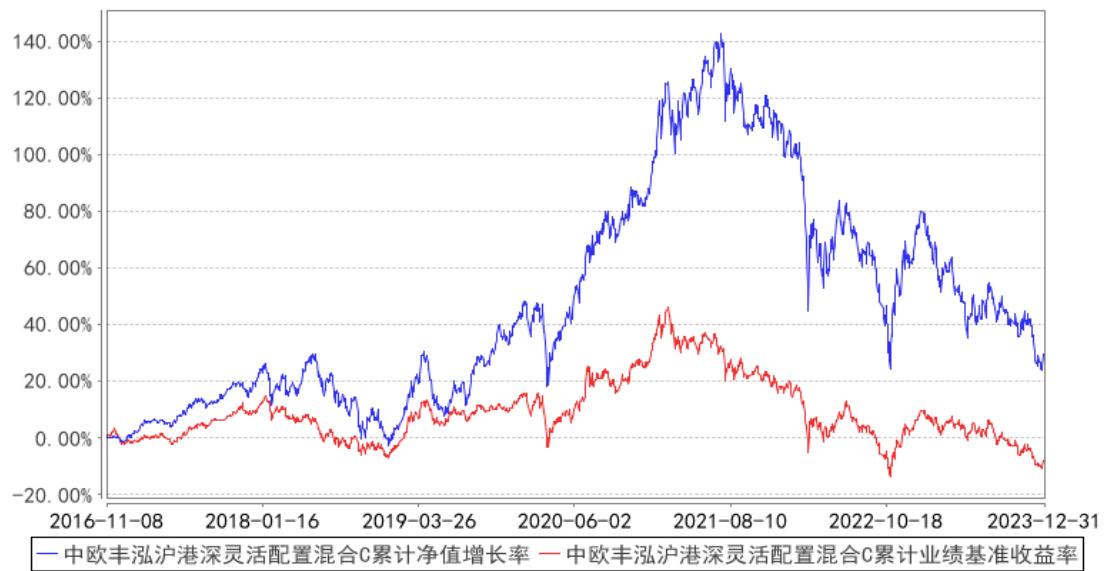
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧丰泓沪港深灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2020 年 2 月 22 日起组合业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”变更为“沪深 300 指数收益率*35%+中证港股通综合指数收益率*55%+中证短债指数收益率*10%”。

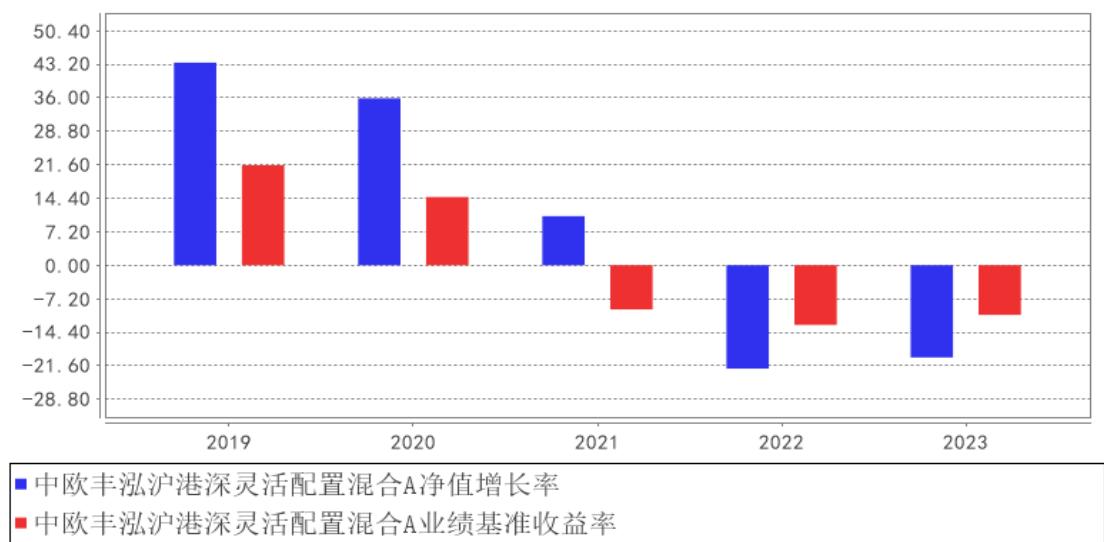
中欧丰泓沪港深灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



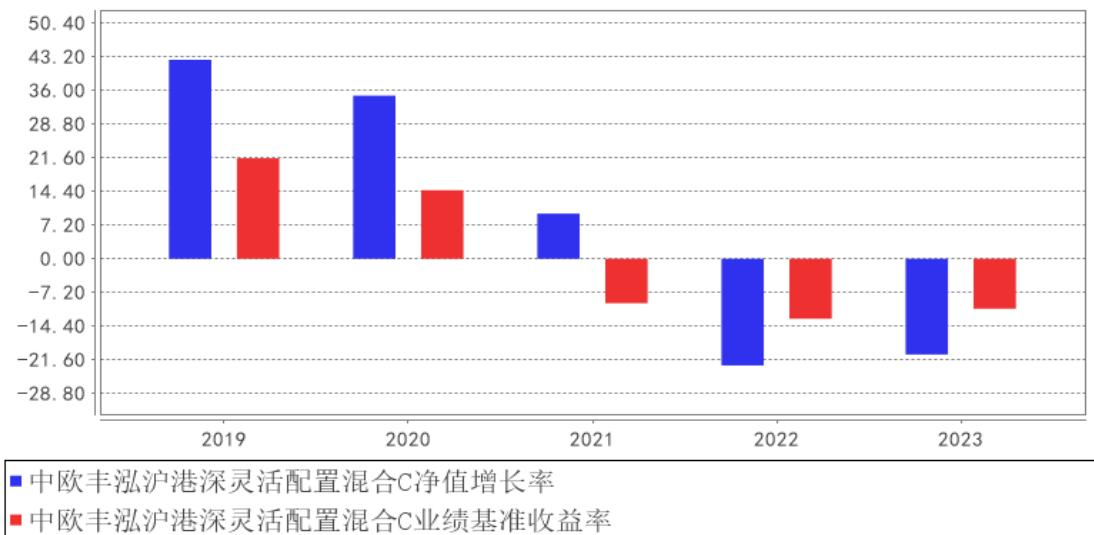
注：2020 年 2 月 22 日起组合业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率 \times 60%+中债综合指数收益率 \times 40%”变更为“沪深 300 指数收益率 \times 35%+中证港股通综合指数收益率 \times 55%+中证短债指数收益率 \times 10%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧丰泓沪港深灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



中欧丰泓沪港深灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	1.2400	157,607,336.55	114,029,713.47	271,637,050.02	-
合计	1.2400	157,607,336.55	114,029,713.47	271,637,050.02	-

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	1.0800	19,754,792.21	7,955,651.14	27,710,443.35	-
合计	1.0800	19,754,792.21	7,955,651.14	27,710,443.35	-

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 165 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		
罗佳明	基金经理 / 投资经理	2019-07-02	-	12 年	历任工银国际控股有限公司研究分析员，野村国际香港有限公司研究分析员，汇丰银行研究分析员，银河国际资产管理基金经理。2018-04-16 加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理/研究员、投资经理。
沈悦	基金经理	2020-07-31	-	8 年	历任中国建设银行天津市开发分行管培生。2015-05-20 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员、投资助理。

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

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

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
罗佳明	公募基金	5	17,877,238,483.71	2019-07-02
	私募资产管理计划	1	164,383,954.63	2023-12-20
	其他组合	-	-	-
	合计	6	18,041,622,438.34	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至 10 个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 121 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，港股和 A 股市场于 1 月底创出高点后，出现持续下跌，市场情绪于 24 年年初达到极低水平。由于本基金继续维持一贯的投资风格，维持了较高的股票仓位，也出现较大回撤。其中，市场下跌的主要原因为，疫后的经济复苏较缓，以及经济结构转型带来的地产及相关行业下行，整体表现上体现出内需不足等。除上市公司业绩出现预期的下修之外，也较大程度影响了股市参与者的情绪。

相对应地，我们减持了部分房地产和消费行业相关个股。同时，基于供给侧受限，以及全球再工业化的需求，我们依然维持对上游资源品乐观的观点，从而增持了部分上游能源和原材料行业。随着医疗行业规范化逐步完成，以及老龄化相关需求逐渐体现，且行业龙头公司估值处于较低区间，我们还增持了部分医疗行业个股。整体而言，在宏观环境依然存在不确定性的背景下，我们对投资标的估值要求更为“苛刻”，尤为注重公司获取自由现金流的能力，以及切实的股东回报，分红和回购注销缩减股本等措施是加分项。

回顾全年基金投资过程中，我们年初对于经济复苏预判不足，导致春节后基金出现较大回撤，尤其是消费，房地产相关企业。另外，由于我们始终聚焦于投资高质量企业，在外资流出的过程中，该类公司股价亦承受较大压力。在上游资源类企业的配置上，取得一定收益，然而由于我们行业配置较为均衡的风格，我们在该类公司的持仓比重并不算太高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为-19.83%，同期业绩比较基准收益率为-10.68%；基金 C 类份额净值增长率为-20.48%，同期业绩比较基准收益率为-10.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美债收益率于 2023 年 10 月出现反转后持续下行，美元指数亦同步下行，人民币兑美元汇率也于 11 月重新开始升值。债市以及汇率市场走势反映美联储本轮加息周期结束，全球权益市场开始期待美联储降息进而持续上行。然而 A 股和港股市场由于外资流出以及较为保守的经济预期等因素，持续走低，并未反映美元利率转向这一重大宏观环境变化。

纵观大类资产之中，目前权益市场的估值较债券、黄金、其他新兴市场股市，以及其历史的低点，都更为低估。我们认为，在经历了 2024 年 1 月的下跌后，市场估值中隐含的悲观预期已经演绎到了比较极端的情形。然而从实物生产端，我们发现能源与资源品的生产消耗量持续向好，资源品价格坚挺，且库存处于历年同期较低水平，表明经济生产活动或许比股票市场体现的更为“乐观”，只是结构与过去的周期有所不同，从地产带动的杠杆性经济需求转变为以制造业为主的经济增长拉动模型。

展望未来，我们可能站在了中国经济逐步回升，以及迎来美元利率向下的双重拐点的时刻。因此，我们认为权益市场在 2024 年或迎来“否极泰来”的好机遇。

在宏观不确定性较高的环境之下，我们需要进一步提升对投资标的质地和估值的双重“苛刻度”，更优秀的公司匹配上更低的估值，一直是潜在好收益的朋友。具体行业而言，我们看好以下几个三方面的投资机会。第一是上游资源品，主要基于供给侧受限的确定性，以及全球工业化和中国经济转型带来实物需求结构性上行。第二方面为中国企业出海创收的投资机会，依托于国内强大的制造业效率以及完整的产业链，优秀公司开始摸索出海渠道输出生产能力和品牌寻求更大的市场，类似 90 年代日本企业积极出海。最后，科技创新依然是穿越经济周期的根本动力，我们关注生物医药，电子半导体，和互联网平台带来的机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2023 年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2023 年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年制订或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2023 年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

（四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2023 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化反洗钱和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、培训宣传、风险评估等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门完成反洗钱自查工作，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，开发和完善了反洗钱系统各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人—中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21253 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了中欧丰泓沪港深灵活配置混合型</p>

	证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人中欧基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出</p>

	<p>结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	魏佳亮 仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	57,140,023.84	325,386,866.22
结算备付金		65,138.43	14,618,326.33
存出保证金		43,142.14	89,605.52
交易性金融资产	7.4.7.2	4,383,824,499.85	6,801,795,428.39
其中：股票投资		4,184,435,807.54	6,691,570,512.64
基金投资		-	-
债券投资		199,388,692.31	110,224,915.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		21,122,403.91	30,141,958.21
应收股利		1,135,680.00	-
应收申购款		648,465.31	30,884,172.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		4,463,979,353.48	7,202,916,357.55
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,899,956.02	6,943,059.91
应付赎回款		10,187,532.42	9,996,206.53
应付管理人报酬		4,657,030.24	8,855,429.56
应付托管费		776,171.72	1,475,904.90
应付销售服务费		548,911.34	1,000,081.90
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	7.4.7.6	1,297,305.33	1,625,135.68
负债合计		22,366,907.07	29,895,818.48
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	4,361,916,476.55	5,645,420,291.36
未分配利润	7.4.7.8	79,695,969.86	1,527,600,247.71
净资产合计		4,441,612,446.41	7,173,020,539.07
负债和净资产总计		4,463,979,353.48	7,202,916,357.55

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,361,916,476.55 份，其中下属 A 基金份额净值为人民币 1.0233 元，基金份额总额 3,565,786,765.76 份；下属 C 基金份额净值为人民币 0.9957 元，基金份额总额 796,129,710.79 份。

7.2 利润表

会计主体：中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年
----	-----	-----------------------	----------------------------

		12 月 31 日	12 月 31 日
一、营业总收入		-1,212,572,173.97	-1,779,212,608.41
1. 利息收入		854,943.80	1,567,823.72
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 9	854,943.80	1,558,583.55
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		-	9,240.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 号填列）		-953,769,327.87	-879,810,621.32
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 10	-1,049,528,939.52	-1,017,862,695.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7. 4. 7. 11	4,735,518.82	733,479.22
资产支持证券投 资收益	7. 4. 7. 12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 13	-	-
股利收益	7. 4. 7. 14	91,024,092.83	137,318,594.74
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7. 4. 7. 15	-270,309,608.85	-911,318,228.09
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7. 4. 7. 16	10,651,818.95	10,348,417.28
减：二、营业总支出		109,481,305.87	115,459,362.89
1. 管理人报酬		85,412,737.69	92,158,119.32
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		14,235,456.29	15,359,686.49
3. 销售服务费		9,155,225.17	7,287,441.63
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	7. 4. 7. 17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7. 4. 7. 18	677,886.72	654,115.45
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,322,053,479.84	-1,894,671,971.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,322,053,479.84	-1,894,671,971.30

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,322,053,479.84	-1,894,671,971.30

7.3 净资产变动表

会计主体：中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	5,645,420,291. 36	-	1,527,600,247. 71	7,173,020,539.0 7
二、本期期初净资产	5,645,420,291. 36	-	1,527,600,247. 71	7,173,020,539.0 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,283,503,814 .81	-	-1,447,904,277 .85	-2,731,408,092. 66
(一)、综合收益总额	-	-	-1,322,053,479 .84	-1,322,053,479. 84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-1,283,503,814 .81	-	-125,850,798.0 1	-1,409,354,612. 82
其中：1. 基金申购款	2,571,964,101. 86	-	623,076,207.38	3,195,040,309.2 4
2. 基金赎回款	-3,855,467,916 .67	-	-748,927,005.3 9	-4,604,394,922. 06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,361,916,476. 55	-	79,695,969.86	4,441,612,446.4 1
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	4,152,430,425. 32	-	2,652,454,989. 54	6,804,885,414.8 6
二、本期期初净资产	4,152,430,425. 32	-	2,652,454,989. 54	6,804,885,414.8 6
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,492,989,866. 04	-	-1,124,854,741 .83	368,135,124.21
(一)、综合收益总额	-	-	-1,894,671,971 .30	-1,894,671,971. 30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	1,492,989,866. 04	-	769,817,229.47	2,262,807,095.5 1
其中：1. 基金申购款	5,375,942,246. 54	-	1,859,295,232. 28	7,235,237,478.8 2
2. 基金赎回款	-3,882,952,380 .50	-	-1,089,478,002 .81	-4,972,430,383. 31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,645,420,291. 36	-	1,527,600,247. 71	7,173,020,539.0 7

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]684 号《关于准予中欧丰泓沪港深灵活配置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《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 640,783,876.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 276,022.12 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。

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

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2024 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投

资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	57,140,023.84	325,386,866.22
等于: 本金	57,131,516.89	325,349,382.06
加: 应计利息	8,506.95	37,484.16
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	57,140,023.84	325,386,866.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,245,933,950.50	—	4,184,435,807.54	-1,061,498,142.96
贵金属投资- 金交所黄金合	—	—	—	—

约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	198,179,600.00	1,188,692.31	199,388,692.31	20,400.00
	合计	198,179,600.00	1,188,692.31	199,388,692.31	20,400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,444,113,550.50	1,188,692.31	4,383,824,499.85	-1,061,477,742.96
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,482,538,992.75	-	6,691,570,512.64	-790,968,480.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,713,524.00	84,934.79	9,766,504.79	-31,954.00
	银行间市场	99,917,700.00	708,410.96	100,458,410.96	-167,700.00
	合计	109,631,224.00	793,345.75	110,224,915.75	-199,654.00
资产支持证券		0.00	0.00	-	0.00
基金		0.00	-	0.00	0.00
其他		0.00	0.00	-	0.00
合计		7,592,170,216.75	793,345.75	6,801,795,428.39	-791,168,134.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	20,008.14	20,300.95
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,171,297.19	1,378,834.07
其中：交易所市场	1,170,972.19	1,378,834.07
银行间市场	325.00	-
应付利息	-	-
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
预提费用-审计费	106,000.00	106,000.00
应付转出费	-	0.66
合计	1,297,305.33	1,625,135.68

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,298,253,778.74	4,298,253,778.74
本期申购	1,994,925,471.97	1,994,925,471.97
本期赎回（以“-”号填列）	-2,727,392,484.95	-2,727,392,484.95
本期末	3,565,786,765.76	3,565,786,765.76

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,347,166,512.62	1,347,166,512.62
本期申购	577,038,629.89	577,038,629.89
本期赎回（以“-”号填列）	-1,128,075,431.72	-1,128,075,431.72
本期末	796,129,710.79	796,129,710.79

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-788,067,830.59	1,976,024,030.01	1,187,956,199.42
本期期初	-788,067,830.59	1,976,024,030.01	1,187,956,199.42
本期利润	-857,090,126.04	-257,277,194.73	-1,114,367,320.77
本期基金份额交易产生的变动数	231,514,271.52	-222,000,189.51	9,514,082.01
其中：基金申购款	-414,859,153.64	912,843,966.41	497,984,812.77

基金赎回款	646,373,425.16	-1,134,844,155.92	-488,470,730.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,413,643,685.11	1,496,746,645.77	83,102,960.66

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-271,884,698.84	611,528,747.13	339,644,048.29
本期期初	-271,884,698.84	611,528,747.13	339,644,048.29
本期利润	-194,653,744.95	-13,032,414.12	-207,686,159.07
本期基金份额交易产生的变动数	133,033,110.70	-268,397,990.72	-135,364,880.02
其中：基金申购款	-131,161,347.67	256,252,742.28	125,091,394.61
基金赎回款	264,194,458.37	-524,650,733.00	-260,456,274.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-333,505,333.09	330,098,342.29	-3,406,990.80

7.4.7.9 存款利息收入

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	648,334.44	1,334,371.65
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	201,439.26	196,822.11
其他	5,170.10	27,389.79
合计	854,943.80	1,558,583.55

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,099,836,110.20	5,263,927,927.25
减：卖出股票成本总额	7,129,133,318.56	6,258,181,425.86
减：交易费用	20,231,731.16	23,609,196.67
买卖股票差价收入	-1,049,528,939.52	-1,017,862,695.28

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	4,536,997.82	727,634.32
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	198,521.00	5,844.90
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	4,735,518.82	733,479.22

7.4.7.11.2 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成交总额	484,165,192.98	32,250.40
减：卖出债券（债转股 及债券到期兑付）成本 总额	479,030,084.00	26,000.00
减：应计利息总额	4,932,637.98	5.47
减：交易费用	3,950.00	400.03
买卖债券差价收入	198,521.00	5,844.90

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	91,024,092.83	137,318,594.74
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	91,024,092.83	137,318,594.74

7.4.7.15 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-270,309,608.85	-911,318,228.09
股票投资	-270,529,662.85	-911,118,574.09
债券投资	220,054.00	-199,654.00
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	-270,309,608.85	-911,318,228.09

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	9,459,859.79	9,886,915.46
基金转换费收入	1,191,959.16	461,501.82
合计	10,651,818.95	10,348,417.28

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	106,000.00	106,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,046.97	3,866.99
账户维护费	18,000.00	18,000.00
证券组合费	429,839.75	406,248.46
合计	677,886.72	654,115.45

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	基金管理人的股东(自 2023 年 6 月 1 日起)
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东(截止至 2023 年 5 月 31 日)
上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东(自 2023 年 5 月 11 日起)
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东(截止至 2023 年 5 月 10 日)
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海睦亿合伙”）	基金管理人股东
自然人股东	基金管理人股东
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
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司

注：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、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,495,790,252.89	13.72	2,374,432,669.50	18.71

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
国都证券	-	-	29,000,000.00	18.24

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	761,358.77	13.37	195,342.72	16.68
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	1,194,536.22	17.26	607,416.18	44.05

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	85,412,737.69	92,158,119.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,800,687.91	12,255,449.06
应支付基金管理人的净管理费	72,612,049.78	79,902,670.26

注：1. 自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金管理人中欧基金的管理人报酬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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值× 1.50% / 当年天数。

2. 根据《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人中欧基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值× 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,235,456.29	15,359,686.49

注：1. 自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2. 根据《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C	合计
工商银行	0.00	26,949.19	26,949.19
国都证券	0.00	24,499.06	24,499.06
中欧财富	0.00	106,266.85	106,266.85
中欧基金	0.00	2,897,956.11	2,897,956.11
合计	0.00	3,055,671.21	3,055,671.21
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
工商银行	0.00	27,442.43	27,442.43
国都证券	0.00	54,452.63	54,452.63
中欧财富	0.00	37,109.97	37,109.97
中欧基金	0.00	1,641,103.72	1,641,103.72
合计	0.00	1,760,108.75	1,760,108.75

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

证券出借业务。

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2023年12月31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
中欧财富	0.00	0.00%	27,787.38	0.00%
自然人股东	181,757.91	0.01%	241,793.87	0.01%

份额单位：份

中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C

关联方名称	本期末 2023年12月31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	653,594.77	0.08%	653,594.77	0.05%

注：1、截止上年度末，中欧财富持有本基金 A 类份额占该类份额的比例为 0.0006%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

2、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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股 份有限公司	57,140,023.84	648,334.44	325,386,866.22	1,334,371.65

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
300904	威	2023	6 个	新	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-

	力传动	年8月2日	月	股流通受限					
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08 -
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80 -
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88 -
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39 -
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30 -
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74 -
301292	海科新	2023年6月29	6个月	新股流	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05 -

	源	日		通受限						
301329	信音电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-

				限						
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个 月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	6 个 月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	6 个 月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个 月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个 月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	6 个 月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个 月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟	2023	6 个	新	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

	固利	年8月1日	月	股流通受限					
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35
301508	中机认	2023年11月23日	6个月	新股流	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92

	检	日		通受限						
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-

				限						
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯	2023	6个	新	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-

	菱股份	年9月6日	月	股流通受限					
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76
600975	新五丰	2023年7月11日	6个月	非公开	8.39	10.29	4,767,580	39,999,996.20	49,058,398.20

		日		发 行 限 售						
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

				受限						
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	新股流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688693	锴威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的

与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，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 7.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	57,140,023.84	-	-	-	57,140,023.84
结算备付金	65,138.43	-	-	-	65,138.43
存出保证金	43,142.14	-	-	-	43,142.14
交易性金融资产	199,388,692.31	-	-4,184,435,807.54	4,383,824,499.85	
应收股利	-	-	-	1,135,680.00	1,135,680.00
应收申购款	-	-	-	648,465.31	648,465.31
应收清算款	-	-	-	21,122,403.91	21,122,403.91
资产总计	256,636,996.72	-	-4,207,342,356.76	4,463,979,353.48	
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,187,532.42	10,187,532.42
应付管理人报酬	-	-	-	4,657,030.24	4,657,030.24
应付托管费	-	-	-	776,171.72	776,171.72
应付清算款	-	-	-	4,899,956.02	4,899,956.02
应付销售服务费	-	-	-	548,911.34	548,911.34
其他负债	-	-	-	1,297,305.33	1,297,305.33
负债总计	-	-	-	22,366,907.07	22,366,907.07
利率敏感度缺口	256,636,996.72	-	-4,184,975,449.69	4,441,612,446.41	
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	325,386,866.22	-	-	-	325,386,866.22
结算备付金	14,618,326.33	-	-	-	14,618,326.33
存出保证金	89,605.52	-	-	-	89,605.52
交易性金融资产	110,224,915.75	-	-6,691,570,512.64	6,801,795,428.39	
应收清算款	-	-	-	30,141,958.21	30,141,958.21
应收申购款	-	-	-	30,884,172.88	30,884,172.88
资产总计	450,319,713.82	-	-6,752,596,643.73	7,202,916,357.55	
负债					
应付清算款	-	-	-	6,943,059.91	6,943,059.91
应付赎回款	-	-	-	9,996,206.53	9,996,206.53
应付管理人报酬	-	-	-	8,855,429.56	8,855,429.56
应付托管费	-	-	-	1,475,904.90	1,475,904.90
应付销售服务费	-	-	-	1,000,081.90	1,000,081.90
其他负债	-	-	-	1,625,135.68	1,625,135.68
负债总计	-	-	-	29,895,818.48	29,895,818.48
利率敏感度缺口	450,319,713.82	-	-6,722,700,825.25	7,173,020,539.07	

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 4.49%（2022 年 12 月 31 日：1.54%），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	- 30	3,917,860,061. 30	-	3,917,860,061.30
应收股利	-	1,135,680.00	-	1,135,680.00
资产合计	- 30	3,918,995,741. 30	-	3,918,995,741.30
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	- 30	3,918,995,741. 30	-	3,918,995,741.30
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	-	6,246,544,222. 26	-	6,246,544,222.26

		26		
资产合计	-	6,246,544,222. 26	-	6,246,544,222.26
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	-	6,246,544,222. 26	-	6,246,544,222.26

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日)		上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	港币相对人民币贬 值 5%	-195,949,787.07	-312,327,211.11
	港币相对人民币升 值 5%	195,949,787.07	312,327,211.11

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	4,184,435,807.54	94.21	6,691,570,512.64	93.29

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,184,435,807.54	94.21	6,691,570,512.64	93.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变, 表格中本期与上期的数据均披露		
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 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	314,090,899.06	568,521,135.14
	业绩比较基准下降 5%	-314,090,899.06	-568,521,135.14

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,134,423,321.45	6,684,190,120.48
第二层次	199,388,692.31	110,224,915.75

第三层次	50,012,486.09	7,380,392.16
合计	4,383,824,499.85	6,801,795,428.39

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当期期初为确认各层次之间的转换时点。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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年1月1日至2023年12月31日		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	7,380,392.16	7,380,392.16
当期购买	0.00	40,853,869.60	40,853,869.60
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	7,380,392.16	7,380,392.16
当期利得或损失总额	0.00	9,158,616.49	9,158,616.49
其中：计入损益的利得或损失	0.00	9,158,616.49	9,158,616.49
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	50,012,486.09	50,012,486.09
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	9,158,616.49	9,158,616.49
项目	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	债券投资	股票投资	合计
期初余额	-	63,221,248.90	63,221,248.90

当期购买	-	14,986,798.78	14,986,798.78
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	63,221,248.90	63,221,248.90
当期利得或损失总额	-	-7,606,406.62	-7,606,406.62
其中：计入损益的利得或损失	-	-7,606,406.62	-7,606,406.62
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	7,380,392.16	7,380,392.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-7,606,406.62	-7,606,406.62

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	50,012,486.09	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	7,380,392.16	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,184,435,807.54	93.74
	其中：股票	4,184,435,807.54	93.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	199,388,692.31	4.47
	其中：债券	199,388,692.31	4.47
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,205,162.27	1.28
8	其他各项资产	22,949,691.36	0.51
9	合计	4,463,979,353.48	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 3,917,860,061.30 元，占基金资产净值比例 88.21%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	49,058,398.20	1.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	217,408,707.67	4.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	39,389.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,714.08	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	266,575,746.24	6.00

8.2.2 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	551,555,397.26	12.42
消费者非必需品	664,706,216.78	14.97
消费者常用品	409,158.33	0.01
能源	449,027,478.90	10.11
金融	198,085,192.48	4.46
医疗保健	696,669,001.07	15.69
工业	249,317,188.37	5.61
信息技术	277,026,922.90	6.24
电信服务	507,503,997.75	11.43
公用事业	-	-
地产业	323,559,507.46	7.28
合计	3,917,860,061.30	88.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	1,650,000	439,009,216.80	9.88
2	02899	紫金矿业	28,300,000	326,217,450.72	7.34
3	02669	中海物业	53,800,000	285,702,166.96	6.43
4	00883	中国海洋石油	19,000,000	223,836,340.00	5.04
5	02313	申洲国际	3,000,000	218,580,264.00	4.92
6	01171	兖矿能源	16,000,000	215,172,876.80	4.84
7	01093	石药集团	31,000,000	203,953,873.20	4.59
8	02359	药明康德	2,600,024	187,199,593.38	4.21

9	01268	美东汽车	40,000,000	172,181,800.00	3.88
10	00631	三一国际	24,376,000	166,779,641.34	3.75
11	03993	洛阳钼业	42,600,000	164,843,230.44	3.71
12	688198	佰仁医疗	1,239,685	154,377,973.05	3.48
13	02382	舜宇光学科技	2,200,000	141,252,511.40	3.18
14	01415	高伟电子	6,500,000	135,774,411.50	3.06
15	01585	雅迪控股	9,700,000	120,603,382.48	2.72
16	03690	美团-W	1,600,000	118,751,068.80	2.67
17	06881	中国银河	26,000,000	97,309,903.60	2.19
18	01548	金斯瑞生物科技	5,300,000	95,386,904.76	2.15
19	02328	中国财险	11,000,000	92,506,937.60	2.08
20	00772	阅文集团	2,600,000	68,446,796.60	1.54
21	002475	立讯精密	1,800,078	62,012,687.10	1.40
22	09995	荣昌生物	1,500,000	50,906,908.50	1.15
23	600975	新五丰	4,767,580	49,058,398.20	1.10
24	00317	中船防务	5,000,000	47,214,062.00	1.06
25	00867	康哲药业	3,600,000	45,151,505.28	1.02
26	09966	康宁杰瑞制药-B	7,500,000	45,129,756.00	1.02
27	02162	康诺亚-B	922,500	41,047,008.35	0.92
28	02600	中国铝业	11,000,000	38,876,838.00	0.88
29	01209	华润万象生活	1,500,000	37,857,340.50	0.85
30	01882	海天国际	2,000,000	35,016,340.80	0.79
31	09658	特海国际	3,000,000	28,274,064.00	0.64
32	03320	华润医药	6,000,000	27,893,451.60	0.63
33	01258	中国有色矿业	4,000,000	18,595,634.40	0.42
34	01138	中远海能	1,500,000	10,018,262.10	0.23
35	01691	JS 环球生活	4,000,000	5,618,564.00	0.13
36	03968	招商银行	200,000	4,929,836.80	0.11
37	03360	远东宏信	600,000	3,338,514.48	0.08
38	02099	中国黄金国际	100,000	3,022,243.70	0.07
39	09633	农夫山泉	10,000	409,158.33	0.01
40	03606	福耀玻璃	10,000	344,363.60	0.01
41	01797	东方甄选	10,000	251,929.16	0.01
42	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.00
43	02338	潍柴动力	10,000	118,171.09	0.00
44	09930	宏信建发	22,222	92,433.52	0.00
45	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
46	00669	创科实业	1,000	84,323.77	0.00
47	02020	安踏体育	1,000	68,646.17	0.00
48	01024	快手-W	1,000	47,984.35	0.00
49	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
50	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00

51	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
52	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
53	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
54	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
55	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
56	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
57	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
58	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
59	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
60	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
61	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
62	09992	泡泡玛特	1,000	18,350.96	0.00
63	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
64	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
65	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
66	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
67	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
68	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
69	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
70	02333	长城汽车	1,500	13,783.61	0.00
71	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
72	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
73	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
74	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
75	01308	海丰国际	1,000	12,215.85	0.00
76	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
77	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
78	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
79	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
80	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
81	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
82	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
83	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
84	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
85	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
86	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
87	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
88	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
89	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
90	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
91	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
92	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
93	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00

94	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
95	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
96	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
97	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
98	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
99	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
100	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
101	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
102	688693	锴威特	178	7,726.98	0.00
103	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
104	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
105	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
106	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
107	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
108	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
109	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
110	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
111	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
112	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
113	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
114	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
115	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
116	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
117	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
118	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
119	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
120	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
121	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
122	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01171	兖矿能源	267,955,651.56	3.74
2	01093	石药集团	263,429,831.31	3.67
3	00631	三一国际	248,013,923.40	3.46
4	00388	香港交易所	213,391,860.99	2.97
5	02899	紫金矿业	204,047,318.20	2.84
6	02382	舜宇光学科技	155,385,382.72	2.17
7	02313	申洲国际	151,758,429.05	2.12
8	09966	康宁杰瑞制药-B	141,588,875.68	1.97

9	03993	洛阳钼业	140, 250, 615. 96	1. 96
10	01585	雅迪控股	138, 683, 916. 44	1. 93
11	00772	阅文集团	124, 107, 833. 56	1. 73
12	01548	金斯瑞生物科技	120, 488, 121. 07	1. 68
13	09995	荣昌生物	120, 413, 395. 84	1. 68
14	06881	中国银河	117, 723, 057. 89	1. 64
15	02269	药明生物	117, 476, 972. 25	1. 64
16	02328	中国财险	114, 913, 836. 57	1. 60
17	00700	腾讯控股	102, 470, 538. 96	1. 43
18	01268	美东汽车	100, 930, 948. 80	1. 41
19	002475	立讯精密	95, 204, 368. 15	1. 33
20	01415	高伟电子	93, 538, 100. 45	1. 30

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01171	兖矿能源	428, 616, 105. 43	5. 98
2	03900	绿城中国	345, 137, 029. 88	4. 81
3	00881	中升控股	316, 991, 465. 25	4. 42
4	03690	美团-W	309, 059, 815. 07	4. 31
5	00700	腾讯控股	308, 882, 067. 08	4. 31
6	00883	中国海洋石油	274, 828, 111. 82	3. 83
7	00388	香港交易所	270, 229, 153. 00	3. 77
8	03968	招商银行	258, 550, 362. 25	3. 60
9	02382	舜宇光学科技	240, 500, 013. 59	3. 35
10	00291	华润啤酒	216, 843, 392. 09	3. 02
11	02269	药明生物	198, 882, 674. 71	2. 77
12	01801	信达生物	189, 667, 894. 46	2. 64
13	02669	中海物业	166, 361, 964. 05	2. 32
14	03898	时代电气	151, 460, 716. 18	2. 11
15	01548	金斯瑞生物科技	139, 286, 115. 72	1. 94
16	01093	石药集团	132, 769, 477. 89	1. 85
17	01908	建发国际集团	132, 228, 913. 95	1. 84
18	300750	宁德时代	130, 792, 098. 00	1. 82
19	02313	申洲国际	115, 298, 781. 87	1. 61
20	02359	药明康德	102, 735, 273. 52	1. 43

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,892,528,276.31
卖出股票收入（成交）总额	6,099,836,110.20

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	199,388,692.31	4.49
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	199,388,692.31	4.49

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	239953	23 贴现国债 53	2,000,000	199,388,692.31	4.49

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兖矿能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局山东局的处罚。

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,142.14
2	应收清算款	21,122,403.91
3	应收股利	1,135,680.00
4	应收利息	—
5	应收申购款	648,465.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	22,949,691.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	583,890	6,106.95	2,615,596,967.94	73.35%	950,189,797.82	26.65%
中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C	33,989	23,423.16	608,764,157.81	76.47%	187,365,552.98	23.53%
合计	617,879	7,059.50	3,224,361,125.75	73.92%	1,137,555,350.80	26.08%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	8,849,811.44	0.25%
	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C	892,462.46	0.11%
	合计	9,742,273.90	0.22%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	>100
	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	>100
	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C	0
	合计	>100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万份)
罗佳明	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 A	中欧丰泓沪港深灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016 年 11 月 8 日)	522,650,701.08	118,133,175.84
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	4,298,253,778.74	1,347,166,512.62
本报告期基金总申购份额	1,994,925,471.97	577,038,629.89
减：本报告期基金总赎回份额	2,727,392,484.95	1,128,075,431.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,565,786,765.76	796,129,710.79

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 106,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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员不存在受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国都证券	3	1,495,790.25 2.89	13.72	761,358.77	13.37	-
东北证券	2	1,359,827.81 9.01	12.47	710,434.71	12.48	-
德邦证券	2	1,293,562.22 3.21	11.86	652,723.06	11.46	-
浙商证券	1	1,112,618.22 2.04	10.20	571,270.80	10.03	-
中信建投	2	1,022,727.92 0.54	9.38	535,515.81	9.41	-
国海证券	1	1,019,735.45 1.32	9.35	513,533.40	9.02	本报 告期 新增 1个
民生证券	2	1,012,522.59 3.74	9.29	533,773.78	9.38	-
中信证券	2	780,757,182. 78	7.16	390,378.58	6.86	本报 告期 新增 1个

华泰证券	2	482,357,435.92	4.42	241,178.68	4.24	-
中金公司	1	390,994,907.43	3.59	195,497.47	3.43	-
长江证券	2	330,438,966.04	3.03	165,219.45	2.90	本报 告期 新增 1个
中泰证券	2	287,721,403.50	2.64	191,425.63	3.36	-
财通证券	1	158,975,435.51	1.46	116,262.62	2.04	-
国泰君安	1	50,485,465.32	0.46	36,921.02	0.65	-
华创证券	1	47,932,818.57	0.44	35,056.51	0.62	-
西南证券	1	32,088,168.75	0.29	23,466.11	0.41	-
兴业证券	1	10,503,646.64	0.10	7,680.68	0.13	-
申万宏源 证券	1	8,483,499.90	0.08	6,204.01	0.11	-
东方财富	1	6,594,042.73	0.06	4,918.54	0.09	-
国投证券	1	636,406.80	0.01	465.44	0.01	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 1个
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1个
华福证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增 1个

平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

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。2、本报告期内，安信证券变更为国投证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
国都证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	9,870,130.77	100.00	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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。2、本报告期内，安信证券变更为国投证券。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会指定媒介	2023-01-12

	基金投资恒立液压(601100)非公开发行股票的公告		
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	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
4	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-03-24
6	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
7	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
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
9	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
10	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
11	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29
12	中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2023-07-08
13	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议(修订)	中国证监会指定媒介	2023-07-08
14	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同(修订)	中国证监会指定媒介	2023-07-08
15	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2023 年 7 月)	中国证监会指定媒介	2023-07-08
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金投资新五丰(600975)非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2023-07-13
17	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-07-13
18	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年 7 月 17 日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-07-17
19	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-07-21
20	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券	中国证监会指定媒介	2023-07-21

	投资基金 2023 年第 2 季度报告		
21	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
22	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-08-31
23	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年 9 月 8 日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-09-08
24	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
25	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-10-25
26	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 (2023 年 12 月)	中国证监会指定媒介	2023-12-20
27	中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 (2023 年 12 月)	中国证监会指定媒介	2023-12-20
28	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-12-29

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20% 的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧丰泓沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

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

2024 年 3 月 29 日