

# 中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 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:2021 年 03 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2021年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2020年01月01日起至2020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	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62
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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	63
§9 基金份额持有人信息 .....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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.....	65
§10 开放式基金份额变动 .....	65
§11 重大事件揭示 .....	65
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
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.....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
§13 备查文件目录 .....	71
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	中欧达安混合
基金主代码	004283
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年03月03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	609,136,364.81份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，“自上而下”在各类债券资产类别之间进行类属配置，“自下而上”进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11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333号五层

## § 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	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	38,668,235.39	3,643,865.28	12,883,315.55
本期利润	44,126,992.86	4,144,345.33	12,125,486.77
加权平均基金份额本期利润	0.0864	0.0636	0.0645
本期加权平均净值利润率	7.18%	5.64%	6.04%
本期基金份额净值增长率	8.23%	5.13%	4.74%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	132,276,605.58	9,096,275.08	7,958,716.95
期末可供分配基金份额利润	0.2172	0.1486	0.0909
期末基金资产净值	760,926,368.58	70,658,871.45	96,115,328.38
期末基金份额净值	1.2492	1.1542	1.0979
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	24.92%	15.42%	9.79%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.15%	0.15%	1.89%	0.11%	1.26%	0.04%
过去六个月	5.24%	0.20%	1.59%	0.13%	3.65%	0.07%
过去一年	8.23%	0.18%	2.62%	0.14%	5.61%	0.04%
过去三年	19.18%	0.14%	8.88%	0.13%	10.30%	0.01%

自基金合同生效起至今	24.92%	0.14%	8.26%	0.12%	16.66%	0.02%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深300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

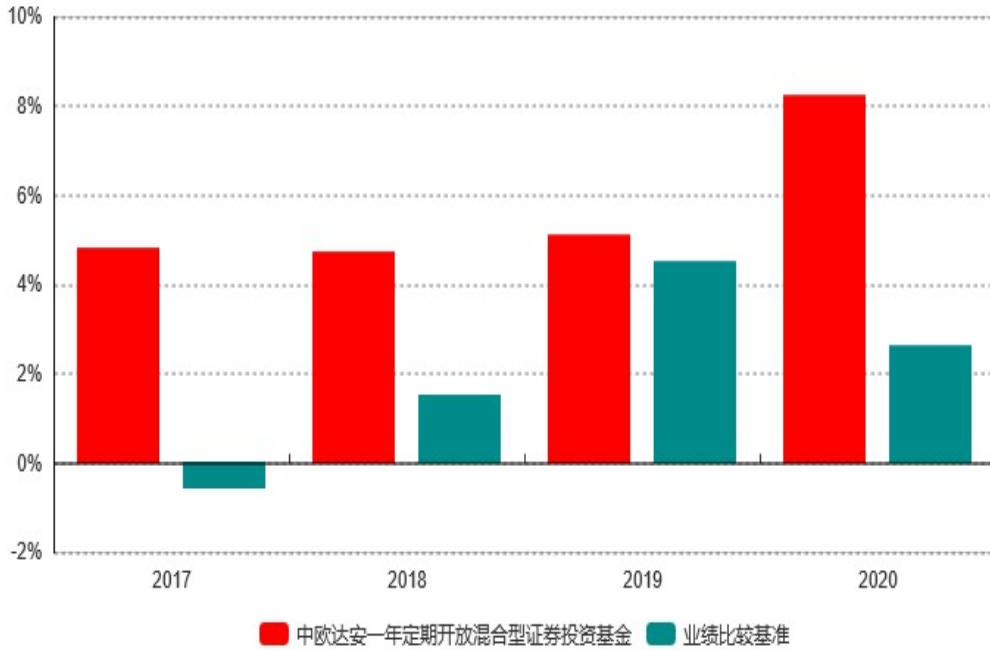
中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年03月03日-2020年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来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





注：本基金合同生效日为2017年3月3日，2017年度数据为2017年3月3日至2017年12月31日数据

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2018年1月1日至2020年12月31日未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2020年12月31日，本基金管理人共管理88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	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理（助理） 期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
蒋雯 文	基金经理	2018- 09-21	-	9	历任新际香港有限公司销售交易员（2009.06-2011.07），平安资产管理有限责任公司债券交易员2013.09-2016.05），前海开源基金投资经理助理（2016.09-2016.10）2016/11/17加入中欧基金管理有限公司, 历任交易员、基金经理助理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，基金经理共享研究报告，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，尽可能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，严控反向交易和同向交易；在事后监控环节，本基金管理人设置日常异常交易分析机制，发现异常问题对基金经理进行提示，留存解释说明，并定期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。

#### 4.3.3 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2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2020年，货币政策目标经历了从“稳增长”向“防风险”的转变，全年利率走出V型走势。年初新冠疫情自爆发以来不断恶化，各经济体央行均加大宽松力度。我国央行上半年为对冲疫情影响，实现“六稳”，陆续开展了三次再贷款再贴现，两次定向降准，整体金融环境为“宽货币、宽信用”，推动债市在上半年大幅走强。随着5月份以来，国内疫情得到有效控制，经济生产活动陆续恢复，货币政策目标逐步向“金融稳定”转变。在货币政策逐渐回归常态化的背景下，叠加利率债供给压力维持高位、银行负债压力加大等因素，收益率持续上行。至年末11月，随着信用事件爆发，10年国债收益率不断上行并逼近3.30%。央行通过MLF和OMO操作大量持续释放流动性，稳定金融市场情绪，控制不发生系统性风险，交易情绪逐渐回暖，年底收益率有所修复。

基于上述判断，债券方面，我们认为高等级信用债更具性价比，基金保持中性久期配置高等级债券的持仓结构，获取确定性票息。权益方面，我们始终保持均衡的配置思

路，积极寻找具备经济结构性机会的高景气行业龙头，较好地把握了新能源、新消费为代表的全年主线，同时参与打新，增厚受益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为8.23%，同期业绩比较基准增长率为2.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年底，中央经济工作会议要求，要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，保持对经济恢复的必要支持力度，政策操作上要更加精准有效，不急转弯，把握好政策时效。金融市场近期对基本面和政策面解读为再通胀交易+货币政策边际收缩，顺周期低估值板块和高景气高估值板块进行了收敛。

我们预计偏积极的财政政策将成为支撑经济主要措施，货币政策继续注重精准有效。同时，中央经济工作会议同时判断明年形势仍存一些不确定性，因此货币政策也难以大幅收紧。明年上半年经济可能仍持续向好，流动性预计呈现适中状态。下半年开始，出口可能出现边际弱化，地产的持续严控可能令地产投资有较明显下行压力，进而给经济带来一定下行压力，需要持续关注。在此背景下，资金价格将围绕政策利率上下波动，债券市场趋势性下行的拐点尚未出现。为兼顾稳增长需求，货币政策将相机抉择，收益率大幅上行的概率也较低。经济增速和社融增速预计在一季度达到高点，预计在此之前收益率处于“磨顶”状态。信用方面，由于2021年信用债回售规模巨大，中低等级资质发行人的融资渠道偏紧，我们以防风险为首要考量，对信用风险保持高度谨慎，组合持仓将会继续以利率债+高等级信用债为主。权益方面，我们将会更加关注估值与盈利的匹配度。

下一阶段我们将继续保持审慎不失积极的态度，紧密跟踪宏观经济走势和政策方向，适时调整组合的债券久期，不断优化权益持仓结构，力争为投资者获取长期稳健的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020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

2020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第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。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；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、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，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

2020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、风险管理和效率的前提下，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：公司全年共制订或修订制度流程22项，内容涵盖投资研究、合规管理、产品运作、基金销售及宣传推介、信息技术、反洗钱等各项内容。

## （三）加强内部审计，强化风险管理

2020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。

### 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、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验。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，本基金托管人在对中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020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(2021)第21691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	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“中欧

	<p>达安混合基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 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,公允反映了中欧达安混合基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中欧达安混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中欧达安混合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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中欧达安混合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达安混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负</p>

	<p>责监督中欧达安混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。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：（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。（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。（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。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中欧达安混合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达安混合基金不能持续经营。（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。我们与基金管理</p>



	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。
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	单峰、潘晓怡
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2021-03-30

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,485,600.38	3,347,335.09
结算备付金		7,689,050.72	248,768.29
存出保证金		55,808.82	1,482.11
交易性金融资产	7.4.7.2	1,083,650,619.01	76,073,719.70
其中：股票投资		106,912,745.63	5,008,782.00
基金投资		-	-
债券投资		889,526,314.20	71,064,937.70
资产支持证券投资		87,211,559.18	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		515,646.01	-
应收利息	7.4.7.5	18,743,077.51	1,539,137.67
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,122,139,802.45	81,210,442.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		359,999,545.00	8,000,000.00
应付证券清算款		-	2,333,657.28
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		381,893.56	35,861.60
应付托管费		95,473.37	8,965.40
应付销售服务费		381,893.56	35,861.60
应付交易费用	7.4.7.7	53,172.52	735.68
应交税费		80,393.74	7,311.74
应付利息		161,062.12	-821.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	60,000.00	130,000.00
负债合计		361,213,433.87	10,551,571.41
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	609,136,364.81	61,219,504.51
未分配利润	7.4.7.10	151,790,003.77	9,439,366.94
所有者权益合计		760,926,368.58	70,658,871.45
负债和所有者权益总计		1,122,139,802.45	81,210,442.86

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.2492元，基金份额总额609,136,364.81份。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		61,516,905.62	5,931,910.99
1. 利息收入		31,398,393.37	3,850,061.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	152,647.42	30,574.62
债券利息收入		28,897,960.04	3,792,100.62
资产支持证券利息收入		2,309,103.75	-
买入返售金融资产收入		38,682.16	27,386.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,641,735.17	1,581,369.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,438,389.37	400,253.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-888,834.25	1,130,000.66
资产支持证券投资	7.4.7.13.	-	-
收益	3		
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,092,180.05	51,115.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,458,757.47	500,480.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	18,019.61	-
<b>减：二、费用</b>		17,389,912.76	1,787,565.66
1. 管理人报酬		3,635,146.66	443,244.76
2. 托管费		908,786.74	110,811.14
3. 销售服务费		3,635,146.66	443,244.76
4. 交易费用	7.4.7.18	729,324.85	29,680.32
5. 利息支出		8,194,709.33	578,617.65
其中：卖出回购金融资产支出		8,194,709.33	578,617.65
6. 税金及附加		100,270.66	11,450.53
7. 其他费用	7.4.7.19	186,527.86	170,516.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44,126,992.86	4,144,345.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44,126,992.86	4,144,345.33

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	61,219,504.51	9,439,366.94	70,658,871.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,126,992.86	44,126,992.86
三、本期基金份额交易产生的基金	547,916,860.30	98,223,643.97	646,140,504.27

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	592,048,522.60	106,141,388.86	698,189,911.46
2. 基金赎回款	-44,131,662.30	-7,917,744.89	-52,049,407.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	609,136,364.81	151,790,003.77	760,926,368.58
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	87,548,160.62	8,567,167.76	96,115,328.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,144,345.33	4,144,345.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-26,328,656.11	-3,272,146.15	-29,600,802.26
其中：1. 基金申购款	36,769,032.94	4,656,397.59	41,425,430.53
2. 基金赎回款	-63,097,689.05	-7,928,543.74	-71,026,232.79
四、本期向基金份额持有人分配利	-	-	-

润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	61,219,504.51	9,439,366.94	70,658,871.45

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

中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”证监许可[2017]25号文《关于准予中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧达安一年定期开放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,《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为679,993,845.47份基金份额,其中认购资金利息折合372,333.13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《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放方式运作。本基金每年开放一次,每次开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过10个工作日,每个开放期的首日为基金合同生效日的每年年度对日,若该日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2021年3月30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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会

颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧达安一年定期开放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。

根据《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人中欧基金管理有限公司于2021年3月18日发布的《中欧基金管理有限公司关于中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2021年3月17日进入财产清算期，详情参见附注7.4.8.2资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于2020年12月31日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020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2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值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

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

### 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

于本报告期内及上年度可比期间，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。于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

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、债券投资和资产支持证券投资 and 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。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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逐日确认。

其他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

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所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外)，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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规 and 实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	11,485,600.38	3,347,335.09
定期存款	-	-

其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	11,485,600.38	3,347,335.09

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		87,371,361.45	106,912,745.63	19,541,384.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	619,479,591.58	608,507,414.20	-10,972,177.38
	银行间市场	283,253,125.77	281,018,900.00	-2,234,225.77
	合计	902,732,717.35	889,526,314.20	-13,206,403.15
资产支持证券		87,211,559.18	87,211,559.18	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,077,315,637.98	1,083,650,619.01	6,334,981.03
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,996,980.64	5,008,782.00	1,011,801.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	71,200,515.50	71,064,937.70	-135,577.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	71,200,515.50	71,064,937.70	-135,577.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计	75,197,496.14	76,073,719.70	876,223.56
----	---------------	---------------	------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	3,460.51	658.83
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,805.89	125.71
应收债券利息	17,055,481.03	1,538,352.47
应收资产支持证券利息	1,680,302.47	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	27.61	0.66
合计	18,743,077.51	1,539,137.67

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	45,627.78	575.68
银行间市场应付交易费用	7,544.74	160.00
合计	53,172.52	735.68

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	60,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	-	80,000.00
合计	60,000.00	130,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,219,504.51	61,219,504.51
本期申购	592,048,522.60	592,048,522.60
本期赎回（以“-”号填列）	-44,131,662.30	-44,131,662.30
本期末	609,136,364.81	609,136,364.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,096,275.08	343,091.86	9,439,366.94

本期利润	38,668,235.39	5,458,757.47	44,126,992.86
本期基金份额交易产生的变动数	84,512,095.11	13,711,548.86	98,223,643.97
其中：基金申购款	91,307,686.34	14,833,702.52	106,141,388.86
基金赎回款	-6,795,591.23	-1,122,153.66	-7,917,744.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,276,605.58	19,513,398.19	151,790,003.77

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	62,337.08	22,241.35
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	89,546.12	8,217.20
其他	764.22	116.07
合计	152,647.42	30,574.62

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	204,996,693.97	8,454,473.71
减：卖出股票成本总额	180,558,304.60	8,054,220.10
买卖股票差价收入	24,438,389.37	400,253.61

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2020年01月01日至2020年 12月31日	2019年01月01日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-888,834.25	1,130,000.66
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	-888,834.25	1,130,000.66

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年12月 31日	2019年01月01日至2019年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑付) 成交总额	619,982,077.30	195,422,108.76
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	610,962,294.33	189,221,434.53
减：应收利息总额	9,908,617.22	5,070,673.57
买卖债券差价收入	-888,834.25	1,130,000.66

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,092,180.05	51,115.00
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	1,092,180.05	51,115.00

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	5,458,757.47	500,480.05
——股票投资	18,529,582.82	1,385,886.31
——债券投资	-13,070,825.35	-885,406.26
——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	5,458,757.47	500,480.05

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日

基金赎回费收入	18,019.61	-
合计	18,019.61	-

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	719,222.35	26,732.82
银行间市场交易费用	10,102.50	2,947.50
合计	729,324.85	29,680.32

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	9,327.86	3,316.50
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	186,527.86	170,516.50

#### 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

根据《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人中欧基金管理有限公司于2021年3月18日发布的《关于中欧达安一年定期开放混合型证券投

资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2021年3月17日进入财产清算程序。

#### 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	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
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司（“北京百骏”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利银联银行”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
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
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
中欧基金国际有限公司（“中欧国际”）	基金管理人的全资子公司

注 1、中欧基金管理有限公司旗下子公司中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司，自2020年4月24日起，将公司名称变更为“上海中欧财富基金销售有限公司”。

2、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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额	成交金额	占当期 股票成 交总额

		的比例		的比例
国都证券	331,912,627.74	72.35%	8,452,804.30	50.71%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国都证券	590,149,759.74	80.14%	82,816,917.54	61.91%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	13,747,500,000.00	99.77%	1,125,300,000.00	98.43%

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 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比例		额的比例
国都证券	309,106.42	72.35%	39,924.84	87.50%
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	7,872.15	50.71%	299.22	51.98%

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 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,635,146.66	443,244.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,440,054.53	243,876.12

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	908,786.74	110,811.14

注：1、支付基金托管人 中国工商银行股份有限公司 的托管费按前一日基金资产净值0.15%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 × 0.15% / 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方名称	本期
	2020年01月01日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行股份有限公司	188,255.70
国都证券	146,526.79
中欧基金	19,067.99
合计	353,850.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行股份有限公司	435,513.24
国都证券	-
中欧基金	7,731.52
合计	443,244.76

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

H为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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初2个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 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

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	170.00	0.00%	180.00	0.00%

注：1、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、截止上年度末，本基金自然人股东持有本基金实际比例为0.0003%；截止本报告期末，本基金自然人股东持有本基金实际比例为0.000028%，上表展示的比例均系四舍五入后的结果。

**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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	11,485,600.38	62,337.08	3,347,335.09	22,241.35

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—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：7.4.8.2)

#### 7.4.12 期末（2020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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688063	派能科技	2020-12-22	2021-06-30	新股流通受限	56.00	189.24	5,413	303,128.00	1,024,356.12	-
688289	圣湘生物	2020-08-20	2021-03-01	新股流通受限	50.48	109.84	6,806	343,566.88	747,571.04	-
688408	中信博	2020-08-	2021-03-	新股流通	42.19	160.54	4,450	187,745.	714,403.	-

		20	01	受限				50	00	
688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	新股流通受限	14.56	30.97	5,924	86,253.44	183,466.28	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688678	福立旺	2020-12-15	2021-06-23	新股流通受限	18.05	19.25	4,198	75,773.90	80,811.50	-
688590	新致软件	2020-11-27	2021-06-07	新股流通受限	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688056	莱伯泰科	2020-08-25	2021-03-02	新股流通受限	24.80	30.56	2,010	49,848.00	61,425.60	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020-12-16	2021-01-15	新债未上市	100.00	100.00	6,220	622,000.00	622,000.00	-
1136	韦尔	2020	2021	新债	100.	100.	270	27,0	27,0	-

16	转债	-12- 29	-01- 22	未上 市	00	00		00.0 0	00.0 0	
----	----	------------	------------	---------	----	----	--	-----------	-----------	--

注：

1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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2020年12月31日止，本基金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89,999,545.00元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101901061	19外高桥MTN003	2021-01-04	100.46	40,000	4,018,400.00
102000205	20苏国信MTN004	2021-01-04	98.92	300,000	29,676,000.00
102000277	20招商蛇口MTN001A	2021-01-04	99.40	200,000	19,880,000.00
132000005	20三峡GN001	2021-01-05	99.65	431,000	42,949,150.00
合计				971,000	96,523,550.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币270,000,000.00元，分别于2021年1月4日、5日和6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

#### 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	-	-
未评级	8,044,800.00	0.00
合计	8,044,800.00	0.00

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以内未有三方评级的超短期融资债券。3. 债券投资以净价列示。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	70,000,000.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	70,000,000.00	0.00

注1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级2. 债券投资以净价列示3. A-1为AAAA-1以下为AAA以下。”

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的同业存单。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	879,634,609.90	70,872,127.80
AAA以下	1,846,904.30	192,809.90
未评级	0.00	0.00
合计	881,481,514.20	71,064,937.70

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 债券投资以净价列示。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	17,211,559.18	0.00
AAA以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	17,211,559.18	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

#### 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2020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。

#### 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。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,485,600.38	-	-	-	11,485,600.38
结算备付金	7,689,050.72	-	-	-	7,689,050.72
存出保证金	55,808.82	-	-	-	55,808.82
交易性金融资产	287,495,986.60	688,333,909.58	907,977.20	106,912,745.63	1,083,650,619.01
应收证券清算款	-	-	-	515,646.01	515,646.01
应收利息	-	-	-	18,743,077.51	18,743,077.51
资产总计	306,726,446.52	688,333,909.58	907,977.20	126,171,469.15	1,122,139,802.45
负债					
卖出回购金融资产款	359,999,545.00	-	-	-	359,999,545.00
应付管理人报	-	-	-	381,893.56	381,893.56



酬					
应付托管费	-	-	-	95,473.37	95,473.37
应付销售服务费	-	-	-	381,893.56	381,893.56
应付交易费用	-	-	-	53,172.52	53,172.52
应交税费	-	-	-	80,393.74	80,393.74
应付利息	-	-	-	161,062.12	161,062.12
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	359,999,545.00	-	-	1,213,888.87	361,213,433.87
利率敏感度缺口	-53,273,098.48	688,333,909.58	907,977.20	124,957,580.28	760,926,368.58
上年度末2019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	3,347,335.09	-	-	-	3,347,335.09
结算备付金	248,768.29	-	-	-	248,768.29
存出保证金	1,482.11	-	-	-	1,482.11
交易性金融资产	30,412,500.00	40,398,500.00	253,937.70	5,008,782.00	76,073,719.70
应收利息	-	-	-	1,539,137.67	1,539,137.67
资产总计	34,010,085.49	40,398,500.00	253,937.70	6,547,919.67	81,210,442.86
负债					
卖出回购金融资产款	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,333,657.28	2,333,657.28
应付管	-	-	-	35,861.60	35,861.60

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	8,965.40	8,965.40
应付销售服务费	-	-	-	35,861.60	35,861.60
应付交易费用	-	-	-	735.68	735.68
应交税费	-	-	-	7,311.74	7,311.74
应付利息	-	-	-	-821.89	-821.89
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	8,000,000.00	-	-	2,551,571.41	10,551,571.41
利率敏感度缺口	26,010,085.49	40,398,500.00	253,937.70	3,996,348.26	70,658,871.45

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	利率下降25BP	4,909,659.10	364,945.66
	利率上升25BP	-4,853,845.15	-360,746.36

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

#### 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 2020年12月31日		上年度末 2019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	106,912,745.63	14.05	5,008,782.00	7.09
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	106,912,745.63	14.05	5,008,782.00	7.09

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为14.05%（2019年12月31日：7.09%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019年12月31日：同）。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为106,172,125.08元，属于第二层次的余额为890,266,934.75元，第三层次的余额为87,211,559.18元(2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币5,238,719.70元，属于第二层次的余额为人民币70,835,000.00元，属于第三层次的余额为0.00元。)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资
2020年1月1日	-
购买	87,211,559.18
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
2020年12月31日	87,211,559.18
2020年12月31日仍持有的资产计入2019年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-

上年度可比期间第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资
2019 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
2019 年 12 月 31 日	-
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-

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。使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

日期	交易性金融资产	公允价值	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
2020/12/31	资产支持证券投资	87,211,559.18	现金流量折现法	折现率	3.67%-6.00%	负相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020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(2019年12月31日)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值，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	106,912,745.63	9.53
	其中：股票	106,912,745.63	9.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	976,737,873.38	87.04
	其中：债券	889,526,314.20	79.27
	资产支持证券	87,211,559.18	7.77
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	19,174,651.10	1.71
8	其他各项资产	19,314,532.34	1.72
9	合计	1,122,139,802.45	100.00

## 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

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	5,054,255.00	0.66
C	制造业	50,123,037.70	6.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,211,216.00	0.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,130,316.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,813,151.33	0.63
J	金融业	24,303,791.00	3.19
K	房地产业	2,293,214.00	0.30
L	租赁和商务服务业	2,739,765.00	0.36

M	科学研究和技术服务业	3,782,937.60	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,446,062.00	0.72
R	文化、体育和娱乐业	1,015,000.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	106,912,745.63	14.05

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	601012	隆基股份	74,200	6,841,240.00	0.90
2	601318	中国平安	62,900	5,471,042.00	0.72
3	600519	贵州茅台	2,000	3,996,000.00	0.53
4	603882	金域医学	30,700	3,933,284.00	0.52
5	600030	中信证券	133,100	3,913,140.00	0.51
6	601899	紫金矿业	409,500	3,804,255.00	0.50
7	603259	药明康德	28,080	3,782,937.60	0.50
8	600019	宝钢股份	615,000	3,659,250.00	0.48
9	002812	恩捷股份	22,900	3,246,762.00	0.43
10	600900	长江电力	167,600	3,211,216.00	0.42
11	300059	东方财富	99,000	3,069,000.00	0.40
12	601988	中国银行	917,400	2,917,332.00	0.38
13	600741	华域汽车	100,300	2,890,646.00	0.38

14	002311	海大集团	43,243	2,832,416.50	0.37
15	601288	农业银行	895,500	2,811,870.00	0.37
16	601888	中国中免	9,700	2,739,765.00	0.36
17	002050	三花智控	109,460	2,698,189.00	0.35
18	600036	招商银行	61,200	2,689,740.00	0.35
19	600009	上海机场	33,600	2,542,176.00	0.33
20	600570	恒生电子	22,600	2,370,740.00	0.31
21	600031	三一重工	64,100	2,242,218.00	0.29
22	603501	韦尔股份	9,500	2,195,450.00	0.29
23	600660	福耀玻璃	44,500	2,138,225.00	0.28
24	600066	宇通客车	122,917	2,079,755.64	0.27
25	600872	中炬高新	31,000	2,066,150.00	0.27
26	002475	立讯精密	33,209	1,863,689.08	0.24
27	603986	兆易创新	9,200	1,817,000.00	0.24
28	600183	生益科技	57,400	1,616,384.00	0.21
29	002352	顺丰控股	18,000	1,588,140.00	0.21
30	300015	爱尔眼科	20,200	1,512,778.00	0.20
31	603429	集友股份	49,700	1,476,587.00	0.19
32	002142	宁波银行	37,600	1,328,784.00	0.17
33	000736	中交地产	196,700	1,313,956.00	0.17
34	600406	国电南瑞	48,500	1,288,645.00	0.17
35	603993	洛阳钼业	200,000	1,250,000.00	0.16
36	600703	三安光电	44,400	1,199,244.00	0.16
37	600845	宝信软件	15,500	1,069,190.00	0.14
38	688063	派能科技	5,413	1,024,356.12	0.13
39	300413	芒果超媒	14,000	1,015,000.00	0.13
40	600048	保利地产	61,900	979,258.00	0.13
41	601336	新华保险	15,300	886,941.00	0.12
42	600837	海通证券	64,700	832,042.00	0.11
43	688289	圣湘生物	6,806	747,571.04	0.10
44	688408	中信博	4,450	714,403.00	0.09



45	603160	汇顶科技	4,000	622,200.00	0.08
46	300078	思创医惠	68,600	620,830.00	0.08
47	601003	柳钢股份	113,000	586,470.00	0.08
48	601628	中国人寿	10,000	383,900.00	0.05
49	600309	万华化学	3,400	309,536.00	0.04
50	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.02
51	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
52	000063	中兴通讯	3,600	121,140.00	0.02
53	688678	福立旺	4,198	80,811.50	0.01
54	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.01
55	688056	莱伯泰科	2,010	61,425.60	0.01
56	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
57	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
58	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
59	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
60	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
61	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
62	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	601288	农业银行	52,646,069.00	74.51
2	601988	中国银行	34,184,740.00	48.38
3	601012	隆基股份	6,085,521.00	8.61
4	601318	中国平安	4,880,726.00	6.91
5	002311	海大集团	4,786,337.00	6.77
6	603259	药明康德	4,471,566.00	6.33
7	603986	兆易创新	4,431,438.00	6.27

8	603160	汇顶科技	4,399,742.00	6.23
9	603501	韦尔股份	3,984,532.35	5.64
10	603882	金域医学	3,977,189.00	5.63
11	300015	爱尔眼科	3,490,303.00	4.94
12	300413	芒果超媒	3,486,207.00	4.93
13	601888	中国中免	3,459,934.62	4.90
14	000651	格力电器	3,387,773.00	4.79
15	000001	平安银行	3,293,191.00	4.66
16	600030	中信证券	3,273,329.00	4.63
17	603993	洛阳钼业	2,999,671.00	4.25
18	600019	宝钢股份	2,996,946.00	4.24
19	600703	三安光电	2,992,484.00	4.24
20	002475	立讯精密	2,987,287.00	4.23
21	600900	长江电力	2,983,691.00	4.22
22	600519	贵州茅台	2,916,230.00	4.13
23	002050	三花智控	2,794,455.50	3.95
24	600009	上海机场	2,783,714.13	3.94
25	600570	恒生电子	2,735,285.40	3.87
26	600309	万华化学	2,592,811.00	3.67
27	000961	中南建设	2,497,947.00	3.54
28	000063	中兴通讯	2,495,875.00	3.53
29	300059	东方财富	2,494,709.00	3.53
30	600741	华域汽车	2,491,919.99	3.53
31	603708	家家悦	2,489,065.00	3.52
32	601899	紫金矿业	1,999,655.00	2.83
33	600066	宇通客车	1,999,477.93	2.83
34	300630	普利制药	1,998,989.75	2.83
35	603429	集友股份	1,998,829.00	2.83
36	601865	福莱特	1,998,523.00	2.83
37	300498	温氏股份	1,998,452.60	2.83
38	600872	中炬高新	1,998,151.00	2.83

39	002142	宁波银行	1,997,190.00	2.83
40	600183	生益科技	1,997,041.97	2.83
41	002460	赣锋锂业	1,996,588.00	2.83
42	002007	华兰生物	1,995,288.00	2.82
43	300033	同花顺	1,994,784.00	2.82
44	600887	伊利股份	1,992,456.00	2.82
45	002812	恩捷股份	1,989,556.00	2.82
46	300750	宁德时代	1,989,330.00	2.82
47	002352	顺丰控股	1,979,194.00	2.80
48	600036	招商银行	1,794,087.84	2.54
49	300078	思创医惠	1,498,049.00	2.12
50	002262	恩华药业	1,497,358.29	2.12
51	000736	中交地产	1,497,043.44	2.12
52	000568	泸州老窖	1,488,364.00	2.11
53	000858	五粮液	1,486,456.00	2.10
54	000002	万科A	1,443,512.88	2.04

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。

#### 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	601288	农业银行	51,205,341.00	72.47
2	601988	中国银行	33,333,767.38	47.18
3	601012	隆基股份	4,490,296.00	6.35
4	603986	兆易创新	3,509,362.60	4.97
5	600309	万华化学	3,426,436.00	4.85
6	000651	格力电器	3,360,636.00	4.76
7	000001	平安银行	3,353,257.00	4.75
8	300015	爱尔眼科	3,216,402.00	4.55
9	603160	汇顶科技	3,157,637.00	4.47

10	002311	海大集团	2,786,543.16	3.94
11	603708	家家悦	2,571,199.00	3.64
12	603259	药明康德	2,488,383.00	3.52
13	300413	芒果超媒	2,480,498.00	3.51
14	000961	中南建设	2,339,151.74	3.31
15	688521	芯原股份	2,244,000.00	3.18
16	300750	宁德时代	2,232,303.00	3.16
17	002007	华兰生物	2,210,810.00	3.13
18	600887	伊利股份	2,187,140.08	3.10
19	603993	洛阳钼业	2,119,388.00	3.00
20	002475	立讯精密	2,088,559.40	2.96
21	000858	五粮液	2,067,192.24	2.93
22	000063	中兴通讯	2,041,473.74	2.89
23	601888	中国中免	1,975,804.00	2.80
24	603501	韦尔股份	1,911,808.00	2.71
25	600703	三安光电	1,903,275.00	2.69
26	601865	福莱特	1,866,161.00	2.64
27	300498	温氏股份	1,861,787.00	2.63
28	002262	恩华药业	1,845,600.00	2.61
29	002460	赣锋锂业	1,778,256.27	2.52
30	300033	同花顺	1,693,977.40	2.40
31	000568	泸州老窖	1,635,204.00	2.31
32	300630	普利制药	1,583,398.64	2.24
33	000002	万科A	1,537,608.00	2.18
34	002142	宁波银行	1,525,616.00	2.16
35	603816	顾家家居	1,484,343.00	2.10

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。

#### 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	263,932,685.41
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	204,996,693.97
--------------	----------------

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,411,000.00	2.68
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	605,574,780.00	79.58
5	企业短期融资券	8,044,800.00	1.06
6	中期票据	252,563,100.00	33.19
7	可转债(可交换债)	2,932,634.20	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	889,526,314.20	116.90

### 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	112857	19广发03	500,000	50,300,000.00	6.61
2	132000005	20三峡GN001	500,000	49,825,000.00	6.55
3	155446	19安租04	400,000	40,176,000.00	5.28
4	101901598	19汇金MTN019	400,000	40,060,000.00	5.26
5	101901449	19汇金MTN017	330,000	33,023,100.00	4.34

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	138579	鹏举05优	300,000	30,000,000.00	3.94
2	149989	平裕3优	200,000	20,000,000.00	2.63
2	138584	旭日06A	200,000	20,000,000.00	2.63
4	165907	滇中2优A	170,000	17,211,559.18	2.26

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 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	55,808.82
2	应收证券清算款	515,646.01
3	应收股利	-
4	应收利息	18,743,077.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,314,532.34

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	------	-----------

				(%)
1	113542	好客转债	1,685,339.00	0.22
2	128057	博彦转债	62,266.40	0.01
3	127013	创维转债	25,911.60	0.00
4	128064	司尔转债	19,972.80	0.00
5	110065	淮矿转债	16,393.00	0.00
6	123023	迪森转债	12,974.00	0.00
7	123022	长信转债	8,677.20	0.00
8	128095	恩捷转债	2,197.20	0.00
9	113032	桐20转债	1,406.60	0.00
10	128096	奥瑞转债	1,159.50	0.00

### 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

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
3,168	192,277.89	2,552,861.84	0.42%	606,583,502.97	99.58%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,465.00	0.00%



注：本基金管理人的从业人员持有本开放式基金的实际占比为0.0002%，上表系四舍五入的结果。

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年03月03日)基金份额总额	679,993,845.47
本报告期期初基金份额总额	61,219,504.51
本报告期基金总申购份额	592,048,522.60
减：本报告期基金总赎回份额	44,131,662.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	609,136,364.81

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

本报告期内，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

本报告期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60,000.00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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴	1	-	-	-	-	-

证券						
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	126,831,136.34	27.65%	118,117.57	27.65%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

中信 证券 (华南)	1	-	-	-	-	-
国都 证券	2	331,912,627.74	72.35%	309,106.42	72.35%	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-

- 注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。
2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。
3. 广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成交 总额的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的比例	成交 金额	占当期权 证成交总 额的比例	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 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	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	146,224,643.81	19.86%	32,000,000.00	0.23%	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券(华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	590,149,759.74	80.14%	13,747,500,000.00	99.77%	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

- 注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。
2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。
3. 广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

### 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	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）	中国证监会指定媒介	2020-01-03
2	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第1号）	中国证监会指定媒介	2020-01-03
3	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2019年第四	中国证监会指定媒介	2020-01-18

	季度报告		
4	中欧基金管理有限公司关于延长2020年春节假期对旗下基金业务影响的提示性公告	中国证监会指定媒介	2020-01-30
5	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-28
6	中欧基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
7	中欧基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
8	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-01
9	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-22
10	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2020-07-21
11	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020年资料概要更新	中国证监会指定媒介	2020-08-31
12	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会指定媒介	2020-08-31
13	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金2020年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2020-10-28
14	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2020-10-31

	(修订)		
15	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-31
16	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同(修订)	中国证监会指定媒介	2020-10-31
17	中欧达安一年定期开放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	2020-11-04
18	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书(2020年11月)	中国证监会指定媒介	2020-11-04
19	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书(2020年12月)	中国证监会指定媒介	2020-12-24

## § 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、中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧达安一年定期开放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、基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇二一年三月三十一日