

# 中欧价值发现混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧价值发现混合型证券投资基金		
基金简称	中欧价值发现混合		
基金主代码	166005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 7 月 24 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,575,331,318.87 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧价值发现混合 A	中欧价值发现混合 C	中欧价值发现混合 E
下属分级基金的场内简称	中欧价值	-	-
下属分级基金的交易代码	166005	004232	001882
报告期末下属分级基金的份额总额	1,261,479,627.57 份	291,415,922.89 份	22,435,768.41 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过适当的资产配置策略和积极的股票选择策略，以合理价格买入并持有具备估值优势、较强盈利能力和较好业绩持续成长性的价值型优秀企业，在注重风险控制的原则下，力争实现超越业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金投资策略的核心在于通过积极的股票选择，关注具备估值优势，并具备较强盈利能力和业绩可持续成长的价值型优秀企业，采取以合理价格买入并持有的投资方式，实现基金资产的长期稳定资本增值。作为一种典型的价值股投资策略，本基金投资策略的特点在于吸收和借鉴国内外较为成熟的价值股投资经验，根据中国股票市场的特点引入相对价值的概念，并以此为依据通过各种主客观标准进行股票选择和投资组合构建，从而在降低风险的同时，提高本基金投资组合的长期超额回报。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于较高风险、较高收益，追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	王小飞
	联系电话	021-68609600	021-60637103

电子邮箱	liyihai@zofund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	021-60637228
传真	021-33830351	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	窦玉明	田国立

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类：中国证券登记结算有限责任公司 C 类、E 类：中欧基金管理有限公司	A 类：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类、E 类：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	中欧价值发现混合 A	中欧价值发现混合 C	中欧价值发现混合 E
本期已实现收益	24,469,052.65	5,021,582.00	593,687.98
本期利润	165,933,512.18	36,073,488.51	3,245,639.19
加权平均基金份额本期利润	0.1386	0.1168	0.1445
本期加权平均净值利润率	6.09%	5.34%	5.70%

本期基金份额净值增长率	6.08%	5.66%	6.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
期末可供分配利润	1,599,538,489.61	341,970,330.52	27,360,124.79
期末可供分配基金份额利润	1.2680	1.1735	1.2195
期末基金资产净值	2,861,018,117.18	633,386,253.41	56,605,613.12
期末基金份额净值	2.2680	2.1735	2.5230
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	301.72%	71.70%	122.60%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧价值发现混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.25%	1.00%	1.02%	0.70%	4.23%	0.30%
过去三个月	-2.42%	0.88%	-3.84%	0.66%	1.42%	0.22%
过去六个月	6.08%	0.84%	-0.11%	0.67%	6.19%	0.17%
过去一年	1.13%	1.02%	-10.81%	0.79%	11.94%	0.23%

过去三年	42.07%	1.15%	-3.41%	0.96%	45.48%	0.19%
自基金合同生效起至今	301.72%	1.34%	22.24%	1.15%	279.48%	0.19%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数\*80%+上证国债指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧价值发现混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.18%	1.00%	1.02%	0.70%	4.16%	0.30%
过去三个月	-2.62%	0.88%	-3.84%	0.66%	1.22%	0.22%
过去六个月	5.66%	0.84%	-0.11%	0.67%	5.77%	0.17%
过去一年	0.32%	1.02%	-10.81%	0.79%	11.13%	0.23%
过去三年	38.70%	1.15%	-3.41%	0.96%	42.11%	0.19%
自基金份额运作日至今	71.70%	1.18%	20.13%	0.95%	51.57%	0.23%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数\*80%+上证国债指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧价值发现混合 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.25%	1.00%	1.02%	0.70%	4.23%	0.30%
过去三个月	-2.42%	0.88%	-3.84%	0.66%	1.42%	0.22%
过去六个月	6.08%	0.84%	-0.11%	0.67%	6.19%	0.17%
过去一年	1.13%	1.02%	-10.81%	0.79%	11.94%	0.23%
过去三年	42.07%	1.15%	-3.41%	0.96%	45.48%	0.19%
自基金份额运作日至今	122.60%	1.22%	21.33%	0.99%	101.27%	0.23%

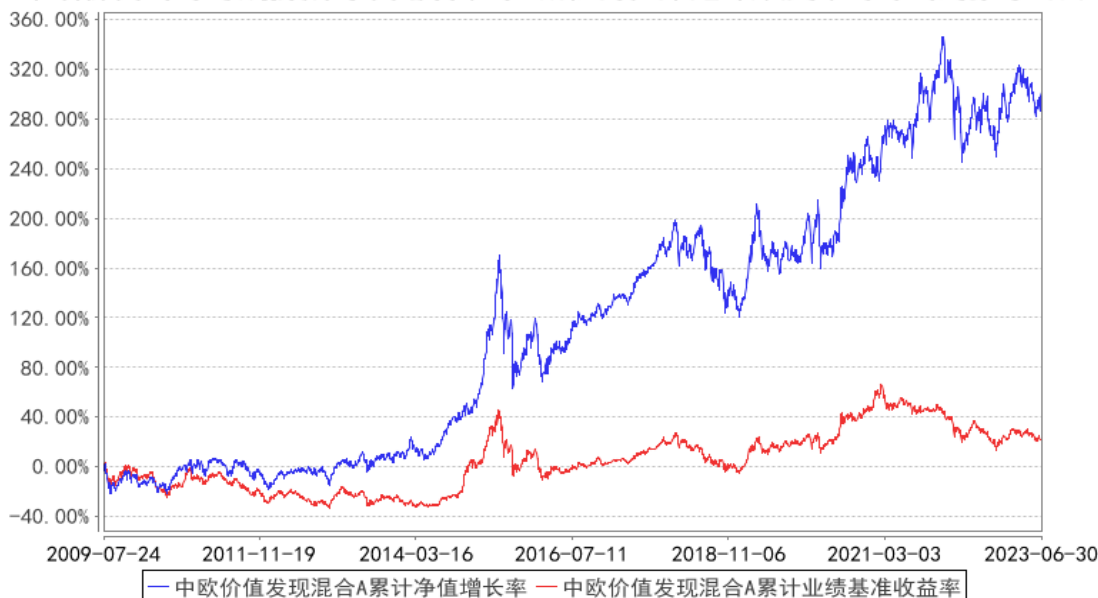
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数\*80%+上证国债指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。



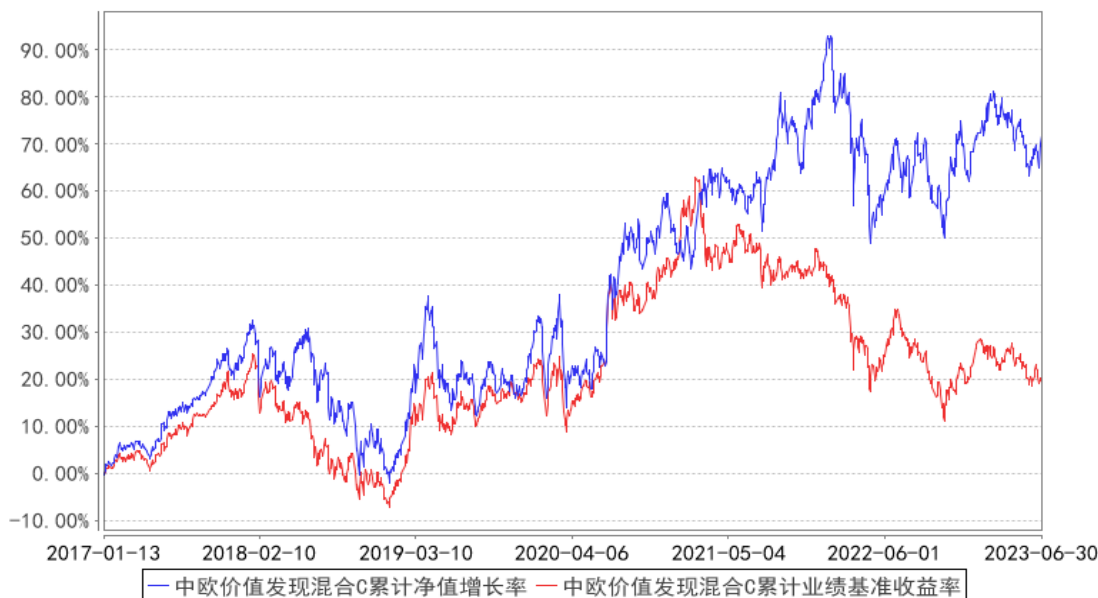
次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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

中欧价值发现混合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

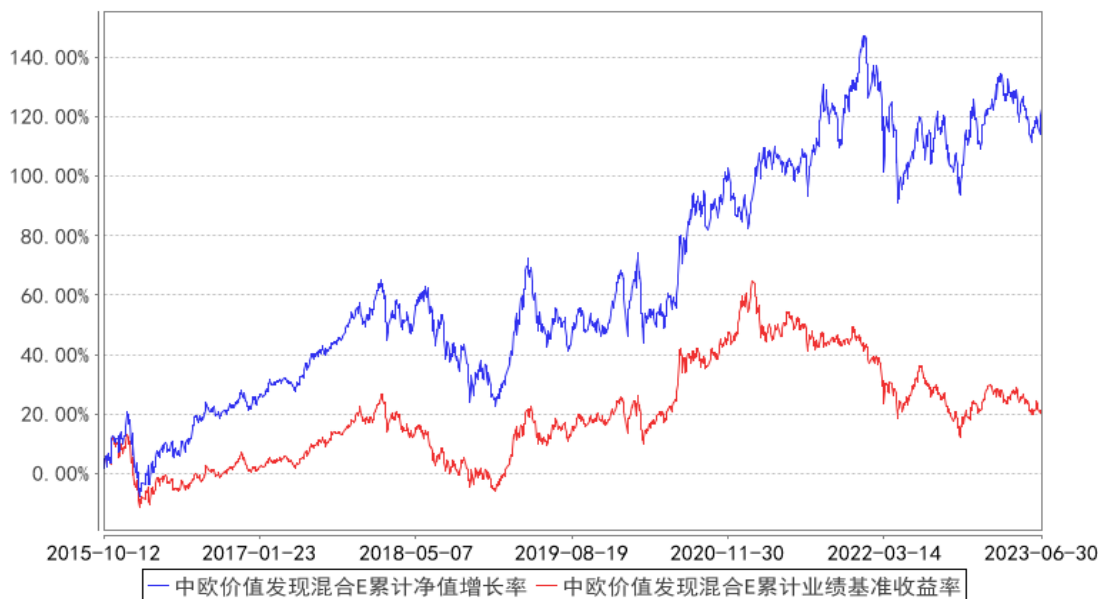


中欧价值发现混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自 2017 年 1 月 12 日起，本基金新增 C 类份额，图示日期为 2017 年 1 月 13 日至 2023 年 06 月 30 日。

中欧价值发现混合E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：自 2015 年 10 月 8 日起, 本基金增加 E 类份额，图示日期为 2015 年 10 月 12 日至 2023 年 06 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈悦	基金经理	2020-05-12	-	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。
蓝小康	权益投决会委员 / 基金经理 / 投资经	2017-05-11	-	11 年	历任日信证券研究所行业研究员，新华基金管理有限公司行业研究员，毕盛资产管理有限公司投资经理，北京新华汇嘉投资管理有限公司研究总监。2016-12-12 加入

	理				中欧基金管理有限公司。
曹名长	投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2015-11-20	-	26 年	历任君安证券公司研究所研究员，闽发证券上海研发中心研究员，红塔证券资产管理总部投资经理，百瑞信托有限责任公司信托经理，新华基金管理公司总经理助理、基金经理。2015-06-18 加入中欧基金管理有限公司。

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

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

#### 4.1.3 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
曹名长	公募基金	4	6,634,810,501.68	2015 年 11 月 20 日
	私募资产管理计划	1	2,457,853,542.13	2021 年 7 月 14 日
	其他组合	-	-	-
	合计	5	9,092,664,043.81	-
蓝小康	公募基金	4	7,700,783,257.16	2017 年 5 月 11 日
	私募资产管理计划	3	9,594,802,940.18	2022 年 6 月 21 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	17,295,586,197.34	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年各宽基指数涨跌互现，市场呈小幅分化走势，上证指数、上证红利指数以及中证 500 指数等主要指数获得个位数的区间上涨，而创业板指数则产生个位数的区间下跌。

从风格来看，整体价值指数略跑赢成长指数。其中沪深 300 价值指数、申万低市净率指数、申万低市盈率指数均录得上涨；而申万高市净率指数和沪深 300 成长指数均有个位数下跌，仅申万高市盈率指数微涨。

市场调整主要体现在二季度，造成二季度调整的原因有很多，市场从去年底到今年一季度的快速上涨本身就有调整整固的内在要求，同时也有受基本面方面影响的原因。我们认为市场对今年经济恢复增长的斜率预期较高，而实际上的经济恢复则比较平缓，这种基本面的实际走势跟市场预期的不一致带来了市场调整。

从行业板块来看，上半年涨幅较大的是 TMT 板块，这主要与 chatgpt 的主题相关。从长远视角来看，我们同样认可 chatgpt 未来的应用前景和成长性，但短期较难完全体现在相关公司的业绩贡献上，因此短期的估值大幅抬升也许蕴含了一定风险。

由于去年底看好今年经济复苏，我们主要配置在顺周期板块，虽然二季度经济再次出现短期下行导致顺周期板块出现一定调整，但总体来看上半年顺周期板块的表现强于市场，这使得我们的组合表现较平稳。

### 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 6.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%；基金 C 类份额净值增长率为 5.66%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%；基金 E 类份额净值增长率为 6.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场整体估值并没有出现大的变化，从低估值个股数量来看，截至今年 6 月 30 日，全

市场 PE (TTM) 估值低于 30 倍的个股数量和低于 20 倍的个股数量比去年底都略有减少。当然，即便如此，低估值的个股数量仍均处于历史峰值附近，对于低估值投资风格来说，此时从众多低估值公司中挖掘优质的投资标的，机会或高于风险。

而统计局公布的工业企业利润总额同比增长在今年初下滑到历史的低点，最近几个月虽然仍同比下滑，但下滑程度逐月改善，6 月公布的数据当月只有个位数下滑，下半年上升到同比正增长应该是大概率事件。

我们对经济和经济整体并不悲观，因为经历了过去一段时间的调整，经济环境向改善的方向发展是不会变的，至于幅度的大小，我们认为并不特别重要，如果为了经济短期出现快速增长而牺牲了长期的平稳恢复，反而有可能得不偿失，而让经济自然的恢复，辅之以一些温和精准的政策，这样带来的增长有可能更为持久，因此也更有可能会推动市场持续地上涨。

总的来说，当前市场估值依然处于历史低位区间，而企业的业绩则将从历史低位逐步改善，这两点均将对整个市场表现形成支撑，未来一段时间市场走势大概率逐步向好。

我们组合的总体仓位一直维持相对稳定，因此配置方向主要在顺周期板块，而针对宏观经济环境的这种变化，我们对持仓做了一定的调整，增持了从长期视角看好的汽车等制造业产业链公司以及一些与消费相关的行业，减持了部分地产开发，对于地产产业链的一些相关标的，由于也是消费属性，我们则继续持有。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧价值发现混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	167,713,376.87	103,065,899.76
结算备付金		2,064,125.27	1,208,419.42
存出保证金		261,727.43	293,068.15
交易性金融资产	6.4.7.2	3,370,991,854.10	3,289,872,242.58

其中：股票投资		3,320,461,790.05	3,189,413,831.62
基金投资		-	-
债券投资		50,530,064.05	100,458,410.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		4,951,951.59	7,387,799.32
应收股利		-	-
应收申购款		22,506,525.94	2,677,820.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,568,489,561.20	3,404,505,249.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,068,248.92	-
应付赎回款		1,920,002.64	970,781.24
应付管理人报酬		4,194,359.00	4,486,972.22
应付托管费		699,059.85	747,828.70
应付销售服务费		394,576.23	483,674.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.32	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,203,330.53	1,369,694.20
负债合计		17,479,577.49	8,058,950.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,575,331,318.87	1,598,861,104.35
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,975,678,664.84	1,797,585,195.20
净资产合计		3,551,009,983.71	3,396,446,299.55
负债和净资产总计		3,568,489,561.20	3,404,505,249.96

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,575,331,318.87 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 2.2680 元，基金份额总额 1,261,479,627.57 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 2.1735 元，基金份额总额 291,415,922.89 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 2.5230 元，基金份额总额 22,435,768.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		238,016,166.36	-361,049,756.59
1. 利息收入		284,541.17	515,123.06
其中：存款利息收入	6.4.7.9	284,541.17	515,123.06
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		61,929,987.67	93,779,314.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-756,779.17	14,192,133.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,192,357.40	6,674,967.61
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	61,494,409.44	72,912,214.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	175,168,317.25	-457,434,244.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以	6.4.7.16	633,320.27	2,090,049.38



“-”号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		32,763,526.48	40,988,259.08
1. 管理人报酬		25,679,442.52	31,366,943.21
2. 托管费		4,279,907.06	5,227,823.85
3. 销售服务费		2,675,165.73	4,264,422.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2.59	18.40
8. 其他费用	6.4.7.18	129,008.58	129,051.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		205,252,639.88	-402,038,015.67
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		205,252,639.88	-402,038,015.67
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		205,252,639.88	-402,038,015.67

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,598,861,104. 35	-	1,797,585,195. 20	3,396,446,299.5 5
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,598,861,104. 35	-	1,797,585,195. 20	3,396,446,299.5 5
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,529,785.48	-	178,093,469.64	154,563,684.16
（一）、综合收益	-	-	205,252,639.88	205,252,639.88

总额				
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,529,785.48	-	-27,159,170.24	-50,688,955.72
其中: 1. 基金申购款	409,477,404.08	-	512,995,389.26	922,472,793.34
2. 基金赎回款	-433,007,189.56	-	-540,154,559.50	-973,161,749.06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,575,331,318.87	-	1,975,678,664.84	3,551,009,983.71
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,603,547,754.55	-	2,283,638,634.35	3,887,186,388.90
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,603,547,754.55	-	2,283,638,634.35	3,887,186,388.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	307,507,820.22	-	61,191,177.57	368,698,997.79
(一)、综合收益总额	-	-	-402,038,015.67	-402,038,015.67

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	307,507,820.22	-	463,229,193.24	770,737,013.46
其中：1. 基金申购款	989,593,118.48	-	1,277,150,472.80	2,266,743,591.28
2. 基金赎回款	-682,085,298.26	-	-813,921,279.56	-1,496,006,577.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,911,055,574.77	-	2,344,829,811.92	4,255,885,386.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧价值发现混合型证券投资基金（原中欧价值发现股票型证券投资基金，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[2009]第 412 号《关于核准中欧价值发现股票型证券投资基金募集的批复》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《中欧价值发现股票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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 714,451,115.41 元。经向中国证监会备案，《中欧价值发现股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 714,731,726.55 份基金份额，其

中认购资金利息折合 280,611.14 份基金份额。本基金的基金管理人与 C 类、E 类份额注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，本基金 A 类份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定，为满足投资者的理财需求，经征托管人中国建设银行股份有限公司同意并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2017 年 1 月 12 日起增加本基金的场外 C 类基金份额类别并相应修改基金合同、托管协议。本基金根据注册登记机构或申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧价值发现混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中基金持有权证的市值比例合计不超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

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

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

#### 2. 增值税

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

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

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4. 企业所得税

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

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

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

### 5. 个人所得税

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

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	167,713,376.87
等于：本金	167,697,627.11
加：应计利息	15,749.76
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	167,713,376.87

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,537,271,552.61	-	3,320,461,790.05	-216,809,762.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,500.00	1,776.38	275.85
	银行间市场	49,780,500.00	558,287.67	189,500.00
	合计	49,782,000.00	558,288.20	189,775.85
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,587,053,552.61	558,288.20	3,370,991,854.10	-216,619,986.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.5 其他资产

无。

##### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,445.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	809,665.15
其中：交易所市场	809,665.15
银行间市场	-
应付利息	-



其他	287,081.26
预提费用-审计费	44,630.98
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	1,203,330.53

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧价值发现混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,236,793,730.44	1,236,793,730.44
本期申购	292,513,213.68	292,513,213.68
本期赎回（以“-”号填列）	-267,827,316.55	-267,827,316.55
本期末	1,261,479,627.57	1,261,479,627.57

##### 中欧价值发现混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	339,440,385.99	339,440,385.99
本期申购	114,784,925.06	114,784,925.06
本期赎回（以“-”号填列）	-162,809,388.16	-162,809,388.16
本期末	291,415,922.89	291,415,922.89

##### 中欧价值发现混合 E

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,626,987.92	22,626,987.92
本期申购	2,179,265.34	2,179,265.34
本期赎回（以“-”号填列）	-2,370,484.85	-2,370,484.85
本期末	22,435,768.41	22,435,768.41

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 中欧价值发现混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,534,258,326.92	-1,126,697,225.30	1,407,561,101.62
本期利润	24,469,052.65	141,464,459.53	165,933,512.18
本期基金份额交易产生的变动数	55,710,620.88	-29,666,745.07	26,043,875.81
其中：基金申购款	610,158,265.22	-241,463,258.25	368,695,006.97
基金赎回款	-554,447,644.34	211,796,513.18	-342,651,131.16
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,614,438,000.45	-1,014,899,510.84	1,599,538,489.61
-----	------------------	-------------------	------------------

## 中欧价值发现混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	667,029,734.63	-308,196,693.45	358,833,041.18
本期利润	5,021,582.00	31,051,906.51	36,073,488.51
本期基金份额交易产生的变动数	-95,338,907.94	42,402,708.77	-52,936,199.17
其中：基金申购款	227,222,352.48	-86,322,476.56	140,899,875.92
基金赎回款	-322,561,260.42	128,725,185.33	-193,836,075.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	576,712,408.69	-234,742,078.17	341,970,330.52

## 中欧价值发现混合 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,002,819.73	4,188,232.67	31,191,052.40
本期利润	593,687.98	2,651,951.21	3,245,639.19
本期基金份额交易产生的变动数	-236,382.92	-30,463.96	-266,846.88
其中：基金申购款	2,653,873.00	746,633.37	3,400,506.37
基金赎回款	-2,890,255.92	-777,097.33	-3,667,353.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,360,124.79	6,809,719.92	34,169,844.71

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	268,402.51
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	10,221.76
其他	5,916.90
合计	284,541.17

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,206,498,093.79
减：卖出股票成本总额	1,204,138,157.74
减：交易费用	3,116,715.22
买卖股票差价收入	-756,779.17

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	517,129.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	675,227.49
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,192,357.40

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	104,881,159.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	103,259,800.00
减：应计利息总额	945,287.98
减：交易费用	843.53
买卖债券差价收入	675,227.49

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	61,494,409.44
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	61,494,409.44
----	---------------

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	175,168,317.25
股票投资	174,810,841.40
债券投资	357,475.85
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	175,168,317.25

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	611,545.53
基金转换费收入	21,774.74
合计	633,320.27

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,270.23
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	129,008.58

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：

WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国都证券	220,621,862.41	9.36	-	-

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期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	205,148.64	4.87	-	-

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国都证券	161,344.07	9.36	1,731.06	0.21
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国都证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,679,442.52	31,366,943.21
其中：支付销售机构的客户维护费	6,791,619.20	7,454,870.07

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,279,907.06	5,227,823.85

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧价值发现混合	中欧价值发现混合	中欧价值发现混合	合计
	A	C	E	
国都证券	-	35.16	-	35.16
中欧财富	-	26,215.53	-	26,215.53
中欧基金	-	1,257,711.90	-	1,257,711.90
合计	-	1,283,962.59	-	1,283,962.59
获得销售服务费的各	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧价值发现混合 A	中欧价值发现混合 C	中欧价值发现混合 E	合计
中欧基金	-	2,209,272.94	-	2,209,272.94
合计	-	2,209,272.94	-	2,209,272.94

注：本基金 A 类、E 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%，销售服务费按照前一日 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基金销售服务费

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 3 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧价值发现混合 A



关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	55,282.10	0.00%	55,282.10	0.00%

份额单位：份

中欧价值发现混合 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	410.21	0.00%	410.21	0.00%

份额单位：份

中欧价值发现混合 E

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	730,972.37	3.26%	730,972.37	3.23%

注：1、本报告期末，自然人股东持有本基金 A 类份额实际占比为 0.0044%，持有本基金 C 类份额实际占比为 0.0001%，上述展示系四舍五入的结果。

2、上年度末，自然人股东持有本基金 A 类份额实际占比为 0.0045%，持有本基金 C 类份额实际占比为 0.0001%，上述展示系四舍五入的结果。

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	167,713,376.87	268,402.51	258,559,719.46	468,786.05

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

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

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康	2023	6个月	新股	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

	口腔	年 3 月 29 日		流 通 受 限						
00136 0	南 矿 集 团	202 3 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
00136 7	海 森 药 业	202 3 年 3 月 30 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
00138 0	华 纬 科 技	202 3 年 5 月 9 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
30117 0	锡 南 科 技	202 3 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
30120 2	朗 威 股 份	202 3 年 6 月 28 日	1 个月 内（含 ）	新 股 未 上 市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
30120 2	朗 威 股 份	202 3 年 6 月	6 个月	新 股 流 通 受	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

		28日		限						
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-

301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月6日	6个月	新股流通	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

		月 2 日		受 限							
30135 7	北方 长龙	202 3 年 4 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-	
30139 5	仁信 新材	202 3 年 6 月 21 日	1 个月 内(含 )	新 股 未 上 市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-	
30139 5	仁信 新材	202 3 年 6 月 21 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-	
30139 9	英特 科技	202 3 年 5 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
30142 8	世纪 恒通	202 3 年 5 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
30143 9	泓淋 电力	202 3 年 3 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-	

301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601133	柏诚系统股份公司	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
60310	润	2023	6个月	大	14.15	17.30	2,450,000	34,667,500.0	42,385,000.0	-

8	达医疗	3年3月16日		宗交易流通受限			0	0	0	
603125	江苏常青树科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	浙江万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船派瑞特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合	2023	6个月	新股	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-



	集成	年 4 月 24 日		流 通 受 限						
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯阳光电力	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688523	航天环宇科	2023年5月	6个月	新股流通受	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

	技	26 日		限							
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-	
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-	
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-	
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-	
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-	
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-	

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票

的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金, 其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金, 但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过适当的资产配置策略和积极的股票选择策略, 以合理价格买入并持有具备估值优势、较强盈利能力和较好业绩持续成长性的价值型优秀企业, 在注重风险控制的原则下, 力争实现超越业绩比较基准的长期稳定资本增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心, 督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略, 并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作, 负责监察公司的风险管理措施的执行, 对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型, 日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估, 并通过相

应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	167,713,376.87	-	-	-	167,713,376.87
结算备付金	2,064,125.27	-	-	-	2,064,125.27
存出保证金	261,727.43	-	-	-	261,727.43
交易性金融资产	50,528,287.67	-	1,776.38	3,320,461,790.05	3,370,991,854.10
应收申购款	-	-	-	22,506,525.94	22,506,525.94
应收清算款	-	-	-	4,951,951.59	4,951,951.59
资产总计	220,567,517.24	-	1,776.38	3,347,920,267.58	3,568,489,561.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,920,002.64	1,920,002.64
应付管理人报酬	-	-	-	4,194,359.00	4,194,359.00
应付托管费	-	-	-	699,059.85	699,059.85
应付清算款	-	-	-	9,068,248.92	9,068,248.92
应付销售服务费	-	-	-	394,576.23	394,576.23
应交税费	-	-	-	0.32	0.32
其他负债	-	-	-	1,203,330.53	1,203,330.53
负债总计	-	-	-	17,479,577.49	17,479,577.49
利率敏感度缺口	220,567,517.24	-	1,776.38	3,330,440,690.09	3,551,009,983.71

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
<b>资产</b>					
银行存款	103,065,899.76	-	-	-	103,065,899.76
结算备付金	1,208,419.42	-	-	-	1,208,419.42
存出保证金	293,068.15	-	-	-	293,068.15
交易性金融资产	100,458,410.96	-	-	-3,189,413,831.62	3,289,872,242.58
应收清算款	-	-	-	7,387,799.32	7,387,799.32
应收申购款	-	-	-	2,677,820.73	2,677,820.73
<b>资产总计</b>	<b>205,025,798.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-3,199,479,451.67</b>	<b>3,404,505,249.96</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	970,781.24	970,781.24
应付管理人报酬	-	-	-	4,486,972.22	4,486,972.22
应付托管费	-	-	-	747,828.70	747,828.70
应付销售服务费	-	-	-	483,674.05	483,674.05
其他负债	-	-	-	1,369,694.20	1,369,694.20
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,058,950.41</b>	<b>8,058,950.41</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>205,025,798.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-3,191,420,501.26</b>	<b>3,396,446,299.55</b>

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 1.42%（2022 年 12 月 31 日：2.96%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,320,461,790.05	93.51	3,189,413,831.62	93.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,320,461,790.05	93.51	3,189,413,831.62	93.90

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	160,706,589.31	181,047,789.30
	业绩比较基准下降 5%	-160,706,589.31	-181,047,789.30

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,276,545,361.97	3,188,724,041.72
第二层次	51,127,991.39	100,458,410.96
第三层次	43,318,500.74	689,789.90
合计	3,370,991,854.10	3,289,872,242.58

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,320,461,790.05	93.05
	其中：股票	3,320,461,790.05	93.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,530,064.05	1.42
	其中：债券	50,530,064.05	1.42
	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	169,777,502.14	4.76
8	其他各项资产	27,720,204.96	0.78
9	合计	3,568,489,561.20	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	116,551,136.00	3.28
C	制造业	2,312,930,566.20	65.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,758,721.07	0.08
E	建筑业	111,009,365.95	3.13
F	批发和零售业	248,136,828.98	6.99
G	交通运输、仓储和邮政业	68,206,369.04	1.92
H	住宿和餐饮业	1,503.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,248,930.15	0.04
J	金融业	8,956,865.86	0.25
K	房地产业	255,233,169.20	7.19
L	租赁和商务服务业	89,487,984.67	2.52
M	科学研究和技术服务业	103,829,328.93	2.92
N	水利、环境和公共设施管理业	1,773,566.57	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	313,671.57	0.01
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,320,461,790.05	93.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002048	宁波华翔	22,268,761	298,401,397.40	8.40
2	603108	润达医疗	13,330,073	244,536,756.34	6.89

3	002398	垒知集团	32,196,398	183,519,468.60	5.17
4	600612	老凤祥	2,038,400	142,443,392.00	4.01
5	600383	金地集团	18,384,191	132,550,017.11	3.73
6	002327	富安娜	14,087,736	118,618,737.12	3.34
7	601311	骆驼股份	12,459,944	115,628,280.32	3.26
8	600985	淮北矿业	10,001,800	115,220,736.00	3.24
9	600219	南山铝业	36,345,900	109,764,618.00	3.09
10	002154	报喜鸟	19,399,808	107,086,940.16	3.02
11	002790	瑞尔特	10,429,882	100,126,867.20	2.82
12	603808	歌力思	7,026,325	92,255,647.25	2.60
13	603208	江山欧派	2,463,724	89,728,828.08	2.53
14	603300	华铁应急	16,339,787	89,051,839.15	2.51
15	001914	招商积余	5,799,911	87,288,660.55	2.46
16	002043	兔宝宝	7,938,130	86,604,998.30	2.44
17	000910	大亚圣象	10,573,479	82,578,870.99	2.33
18	002572	索菲亚	4,300,000	74,906,000.00	2.11
19	603699	纽威股份	4,912,830	73,102,910.40	2.06
20	002831	裕同科技	2,910,000	70,974,900.00	2.00
21	601668	中国建筑	10,669,920	61,245,340.80	1.72
22	002206	海利得	11,319,817	60,674,219.12	1.71
23	002120	韵达股份	6,299,934	60,227,369.04	1.70
24	603018	华设集团	6,798,204	59,484,285.00	1.68
25	300196	长海股份	4,149,538	57,471,101.30	1.62
26	300132	青松股份	9,387,000	53,224,290.00	1.50
27	600970	中材国际	3,902,236	49,753,509.00	1.40
28	600873	梅花生物	5,456,000	48,722,080.00	1.37
29	300630	普利制药	2,174,822	42,517,770.10	1.20
30	002949	华阳国际	2,842,000	40,413,240.00	1.14
31	300642	透景生命	1,739,827	35,092,310.59	0.99
32	601233	桐昆股份	2,511,500	33,277,375.00	0.94
33	603848	好太太	1,640,000	26,240,000.00	0.74
34	002841	视源股份	389,811	26,054,967.24	0.73
35	002968	新大正	1,719,860	25,987,084.60	0.73
36	603968	醋化股份	1,150,000	20,424,000.00	0.58
37	300910	瑞丰新材	399,920	20,115,976.00	0.57
38	002384	东山精密	754,500	19,541,550.00	0.55
39	300258	精锻科技	1,300,000	18,837,000.00	0.53
40	300837	浙矿股份	459,962	17,662,540.80	0.50
41	002853	皮阿诺	650,000	11,245,000.00	0.32
42	603801	志邦家居	308,000	10,170,160.00	0.29
43	300750	宁德时代	40,000	9,151,600.00	0.26
44	605117	德业股份	59,940	8,964,027.00	0.25
45	300796	贝斯美	610,000	7,338,300.00	0.21

46	603306	华懋科技	230,000	6,674,600.00	0.19
47	001979	招商蛇口	474,500	6,182,735.00	0.17
48	300643	万通智控	350,000	4,676,000.00	0.13
49	002352	顺丰控股	100,000	4,509,000.00	0.13
50	300384	三联虹普	200,000	3,398,000.00	0.10
51	002020	京新药业	240,000	3,076,800.00	0.09
52	000651	格力电器	80,034	2,922,041.34	0.08
53	600233	圆通速递	200,000	2,912,000.00	0.08
54	601877	正泰电器	100,000	2,765,000.00	0.08
55	600116	三峡水利	299,920	2,723,273.60	0.08
56	600036	招商银行	80,000	2,620,800.00	0.07
57	000028	国药一致	59,124	2,578,397.64	0.07
58	601717	郑煤机	200,000	2,490,000.00	0.07
59	000001	平安银行	210,082	2,359,220.86	0.07
60	000002	万科 A	155,000	2,173,100.00	0.06
61	002832	比音勒芬	60,000	2,124,600.00	0.06
62	603916	苏博特	159,966	2,117,949.84	0.06
63	601318	中国平安	45,000	2,088,000.00	0.06
64	002947	恒铭达	100,000	2,084,000.00	0.06
65	603568	伟明环保	100,000	1,751,000.00	0.05
66	603787	新日股份	100,000	1,681,000.00	0.05
67	603886	元祖股份	90,000	1,650,600.00	0.05
68	600690	海尔智家	60,000	1,408,800.00	0.04
69	600048	保利发展	79,598	1,037,161.94	0.03
70	601688	华泰证券	70,000	963,900.00	0.03
71	002867	周大生	50,000	889,000.00	0.03
72	601601	中国太保	30,000	779,400.00	0.02
73	603444	吉比特	1,387	681,169.57	0.02
74	600179	安通控股	200,000	558,000.00	0.02
75	002332	仙琚制药	40,000	530,000.00	0.01
76	002727	一心堂	20,000	528,000.00	0.01
77	601238	广汽集团	50,000	521,000.00	0.01
78	601965	中国汽研	25,153	519,409.45	0.01
79	601899	紫金矿业	45,000	511,650.00	0.01
80	600893	航发动力	12,000	507,120.00	0.01
81	603008	喜临门	20,000	503,600.00	0.01
82	603383	顶点软件	8,794	487,363.48	0.01
83	601225	陕西煤业	25,000	454,750.00	0.01
84	600309	万华化学	5,000	439,200.00	0.01
85	600546	山煤国际	30,000	434,100.00	0.01
86	600426	华鲁恒升	14,000	428,820.00	0.01
87	688526	武汉科前生物	18,000	428,220.00	0.01
88	603601	再升科技	99,960	426,829.20	0.01

89	600138	中青旅	30,000	375,300.00	0.01
90	000983	山西焦煤	40,000	364,000.00	0.01
91	605098	行动教育	7,923	313,671.57	0.01
92	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
93	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
94	000933	神火股份	15,600	202,800.00	0.01
95	600987	航民股份	22,059	181,545.57	0.01
96	601166	兴业银行	9,300	145,545.00	0.00
97	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
98	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
99	688472	阿特斯阳光电力	6,261	106,687.44	0.00
100	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
101	600346	恒力石化	6,619	94,850.27	0.00
102	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
103	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
104	605168	三人行	708	60,845.52	0.00
105	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
106	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
107	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
108	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
109	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
110	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
111	600166	福田汽车	7,100	24,140.00	0.00
112	002833	弘亚数控	1,211	23,808.26	0.00
113	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
114	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
115	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
116	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
117	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
118	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
119	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
120	688728	格科微有限公司	1,000	15,820.00	0.00
121	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
122	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
123	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
124	601155	新城控股	1,000	14,410.00	0.00
125	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
126	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
127	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
128	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
129	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
130	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00

131	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
132	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
133	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
134	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
135	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
136	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
137	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
138	603818	曲美家居	1,556	8,402.40	0.00
139	601133	柏诚系统股份 公司	664	8,140.64	0.00
140	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
141	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
142	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
143	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
144	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
145	603125	江苏常青树科 技	160	3,924.80	0.00
146	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
147	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
148	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
149	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
150	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
151	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
152	603172	浙江万丰股份	122	1,967.86	0.00
153	605108	同庆楼	45	1,503.00	0.00
154	002035	华帝股份	64	454.40	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601311	骆驼股份	113,958,830.44	3.36
2	002790	瑞尔特	90,942,336.68	2.68
3	603208	江山欧派	89,942,371.80	2.65
4	002572	索菲亚	78,844,875.74	2.32
5	002120	韵达股份	77,976,093.70	2.30
6	300630	普利制药	50,333,777.97	1.48
7	603108	润达医疗	46,960,794.00	1.38
8	600116	三峡水利	44,539,341.63	1.31
9	300642	透景生命	40,844,099.64	1.20
10	002831	裕同科技	36,411,513.98	1.07
11	002968	新大正	35,861,900.00	1.06
12	601668	中国建筑	30,916,336.00	0.91

13	603300	华铁应急	29,533,753.11	0.87
14	002043	兔宝宝	28,250,011.00	0.83
15	603848	好太太	23,566,876.34	0.69
16	300837	浙矿股份	23,348,796.62	0.69
17	603968	醋化股份	22,405,374.00	0.66
18	300910	瑞丰新材	20,140,299.60	0.59
19	002384	东山精密	18,557,080.00	0.55
20	603018	华设集团	17,845,082.00	0.53

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601965	中国汽研	124,249,373.27	3.66
2	600383	金地集团	104,839,842.53	3.09
3	603108	润达医疗	92,672,742.45	2.73
4	000977	浪潮信息	73,015,843.07	2.15
5	601601	中国太保	66,603,700.59	1.96
6	000910	大亚圣象	63,009,970.45	1.86
7	000002	万科 A	58,323,902.63	1.72
8	600970	中材国际	54,266,672.87	1.60
9	002043	兔宝宝	52,518,167.21	1.55
10	600116	三峡水利	46,334,033.00	1.36
11	002966	苏州银行	41,986,806.40	1.24
12	600426	华鲁恒升	40,361,266.00	1.19
13	600048	保利发展	40,193,100.00	1.18
14	000001	平安银行	36,070,143.00	1.06
15	603699	纽威股份	35,831,795.00	1.05
16	600612	老凤祥	26,749,659.98	0.79
17	001979	招商蛇口	25,614,054.60	0.75
18	600346	恒力石化	24,316,242.90	0.72
19	603818	曲美家居	19,146,491.00	0.56
20	605168	三人行	18,091,461.04	0.53

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,160,375,274.77
卖出股票收入（成交）总额	1,206,498,093.79

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,528,287.67	1.42
	其中：政策性金融债	50,528,287.67	1.42
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）	1,776.38	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,530,064.05	1.42

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220216	22 国开 16	500,000	50,528,287.67	1.42
2	127085	韵达转债	15	1,776.38	0.00

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，山东南山铝业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国龙口海关的处罚。报喜鸟控股股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家税务总局乌兰浩特市税务局的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	261,727.43
2	应收清算款	4,951,951.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,506,525.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,720,204.96

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603108	润达医疗	42,385,000.00	1.19	大宗交易流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧价值发现混合 A	407,667	3,094.39	465,392,760.69	36.89%	796,086,866.88	63.11%
中欧价值发现混合 C	102,423	2,845.22	170,325,304.32	58.45%	121,090,618.57	41.55%
中欧价值发现混合 E	2,073	10,822.85	9,443,609.06	42.09%	12,992,159.35	57.91%
合计	512,163	3,075.84	645,161,674.07	40.95%	930,169,644.80	59.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧价值发现混合 A	124,653.02	0.01%
	中欧价值发现混合 C	6,672.47	0.00%
	中欧价值发现混合 E	755,268.06	3.37%
	合计	886,593.55	0.06%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员持有本基金 C 类份额的实际比例为 0.0023%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧价值发现混合 A	0
	中欧价值发现混合 C	0
	中欧价值发现混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧价值发现混合 A	0
	中欧价值发现混合 C	0
	中欧价值发现混合 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧价值发现混合 A	中欧价值发现混合 C	中欧价值发现混合 E
基金合同生效日（2009 年 7 月 24 日）基金份额总额	714,731,726.55	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,236,793,730.44	339,440,385.99	22,626,987.92
本报告期基金总申购份额	292,513,213.68	114,784,925.06	2,179,265.34
减：本报告期基金总赎回份额	267,827,316.55	162,809,388.16	2,370,484.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	1,261,479,627.57	291,415,922.89	22,435,768.41

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
西部证券	1	340,137,987.30	14.43	248,737.44	14.43	-
中金公司	1	335,050,078.53	14.22	245,015.74	14.21	-
中信建投	2	275,516,773.84	11.69	201,490.36	11.69	-
信达证券	1	252,534,268.75	10.71	184,681.04	10.71	-
国都证券	1	220,621,862.41	9.36	161,344.07	9.36	-
招商证券	1	195,715,305.48	8.30	143,124.45	8.30	-
中信证券	1	172,725,918.42	7.33	126,303.95	7.33	-
国盛证券	1	157,448,113.83	6.68	115,143.04	6.68	-
申万宏源西部证券	1	152,034,041.59	6.45	111,175.84	6.45	-
国泰君安	1	91,738,438.74	3.89	67,086.08	3.89	-
安信证券	1	48,639,500.42	2.06	35,571.01	2.06	-
中泰证券	2	47,907,208.1	2.03	35,034.44	2.03	-

		0				
广发证券	1	34,667,500.00	1.47	25,858.83	1.50	-
天风证券	1	32,255,554.24	1.37	23,588.79	1.37	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	4,007,362.41	95.13	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	205,148.64	4.87	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧价值发现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
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧价值发现混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧价值发现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
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03

9	中欧价值发现混合型证券投资基金 基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29
---	-------------------------------	-----------	------------

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话: 021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日