

中欧招益稳健一年持有期混合型证券投资  
基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中欧招益稳健一年持有混合
基金主代码	013912
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 5 日
报告期末基金份额总额	279,406,657.26 份
投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。</p> <p>战略资产配置策略（SAA）是决定基金长期收益率和波动率的关键，也是基金力争实现将基金投资组合长期波动率控制在合适水平这一投资目标的核心。本基金的战略资产配置策略（SAA）将从国内股票和债券市场的风险收益特征出发，通过综合分析宏观政策、经济周期、行业发展趋势、市场流动性水平，投资人风险收益偏好等因素，以分散投资的方式，锚定长期目标波动率，进行有效的长期资产配置。</p> <p>本基金的战术资产配置策略（TAA）是指会更多着眼于在充分研究分析诸如细分经济周期、各项经济指标、货币政策变化、利率水平、信用利差变化、突发事件性因素等中短期市场变化的基础上，根据具体不同市场形势的具体转变而对基金各类资产组合既定长期投资比例所进行的动态调整，力争使基金投资组合的长期波动率与目标值不发生重大偏离。通过战术资产配置，本基金将在</p>

	战略资产配置层面实现对长期资产配置的优化，力争获取超额回报。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率*3%+中债综合财富（总值）指数收益率×87%	
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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧招益稳健一年持有混合 A	中欧招益稳健一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	013912	013913
报告期末下属分级基金的份额总额	226,368,165.03 份	53,038,492.23 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	中欧招益稳健一年持有混合 A	中欧招益稳健一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	-1,668,998.10	-456,290.20
2. 本期利润	3,616,699.89	763,333.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0145	0.0130
4. 期末基金资产净值	237,544,402.40	55,049,930.97
5. 期末基金份额净值	1.0494	1.0379

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. 上述基金业绩指标不包括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

中欧招益稳健一年持有混合 A

阶段	净值增长率①	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

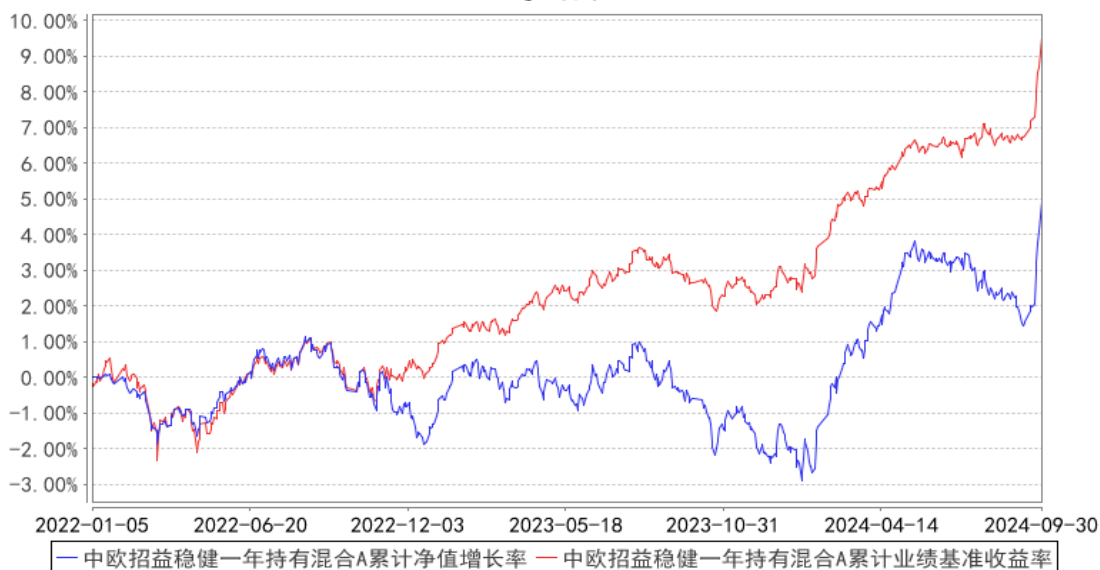
过去三个月	1.67%	0.24%	2.78%	0.16%	-1.11%	0.08%
过去六个月	3.87%	0.21%	4.26%	0.14%	-0.39%	0.07%
过去一年	5.54%	0.21%	6.69%	0.13%	-1.15%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.94%	0.18%	9.54%	0.14%	-4.60%	0.04%

中欧招益稳健一年持有混合 C

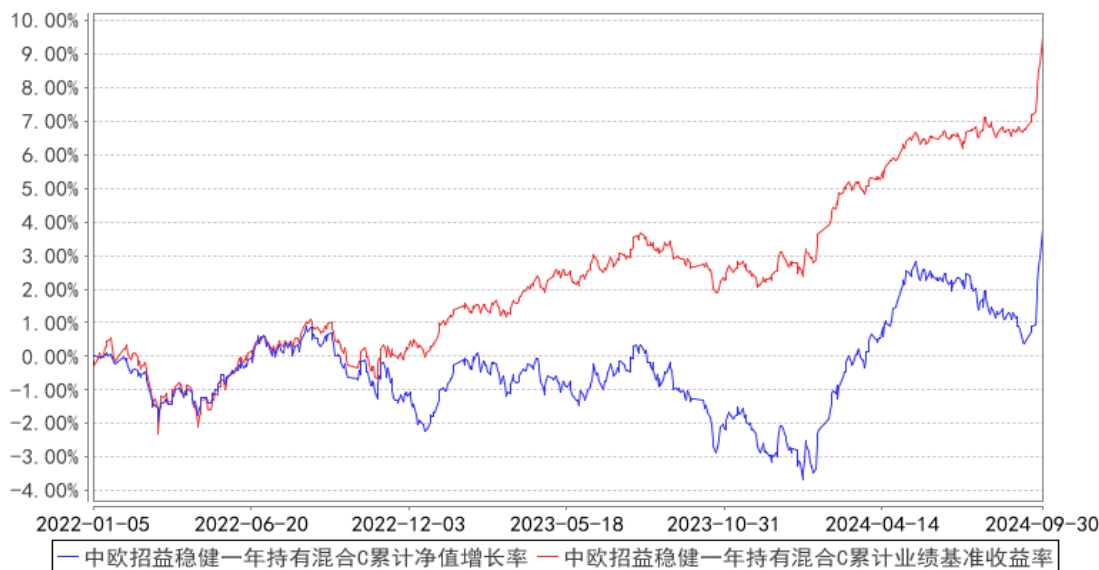
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.57%	0.24%	2.78%	0.16%	-1.21%	0.08%
过去六个月	3.66%	0.21%	4.26%	0.14%	-0.60%	0.07%
过去一年	5.11%	0.21%	6.69%	0.13%	-1.58%	0.08%
自基金合同生效起至今	3.79%	0.18%	9.54%	0.14%	-5.75%	0.04%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中欧招益稳健一年持有混合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



中欧招益稳健一年持有混合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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄华	多资产投资决策会主席 /投资总监/基金经理	2022-01-05	-	16 年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理, 中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理, 中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016-11-10 加入中欧基金管理有限公司, 历任基金经理助理。

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

#### 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 11 次，其中 10 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，1 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度以来，市场出现的最重要拐点是政策的出台。基本上，三季度的经济数据延续相对弱势的表现，例如地产投资一直维持低位，消费增速仍然继续下行。受需求较弱的影响，制造业投资放缓，基建投资小幅下滑，稳增长的紧迫性有所上升。然而 9 月末，伴随政策出现根本转向，本质上扭转了市场预期。具体而言，9 月 24 日，央行、证监会、金融监管总局发布一揽子增量政策，包括降准、降息、降低存量房贷利率、降低二套房首付、创设新的货币政策工具、研究推动中长期资金入市等。此外，9 月 26 日，政治局会议强调“要抓住重点、主动作为，有效落实存量政策，加力推出增量政策，进一步提高政策措施的针对性、有效性，努力完成全年经济社会发展目标任务”。政策明确的情况下，市场情绪迅速带动权益市场大幅强烈反弹。后续政策逐步落地、经济环境转暖或将形成共振，组合高度关注权益市场反弹的延续性。

债券方面，三季度债券市场受央行政策影响较大，波动性大幅增加，对投资者波段能力和回撤控制能力要求增高。受央行意外降息影响，机构抢筹情绪高涨，10 年国债收益率在 8 月初一度下破 2.10%。随后央行逐步公布丰富货币政策工具箱的具体内容，包括设立临时正逆回购机制、开展公开市场国债买卖等操作。此外，央行连续抛售中长期国债、交易商协会调查国债违规交易，债券收益率低位大幅反弹。政策影响下，机构观望情绪浓厚，活跃利率品种流动性大幅减弱。理财预防性赎回、基金为应对可能的流动性压力大幅抛售债券引发赎回负反馈，信用债更是面临流动性枯竭，回调压力更甚。9 月份以来，在资金面转松的帮助下，市场逐渐回归理性。受央行买

短卖长的操作影响，曲线陡峭性下行。直至 9 月末一揽子增量政策的公布，债券市场再次面临强烈回调压力。

伴随经济复苏概率的逐步抬升，组合在三季度更加注重权益资产的仓位和结构布局。结构上，组合坚持对高股息资产作为底仓的逢低配置。此外，随经济周期拐点逐渐明朗，我们看好更具有顺周期弹性的各细分行业。债券层面，市场剧烈波动情况下，组合逐步抬升利率债和高等级信用债仓位，一方面保证组合流动性，另一方面也是因为弱流动性信用债在市场波动中回调压力更大而跟涨能力不足。另外，组合仍将灵活运用利率、二永等流动性品种把握市场波段交易机会。基金投资依旧以均衡为配置思路。

#### 4.5 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 1.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.78%；基金 C 类份额净值增长率为 1.57%，同期业绩比较基准收益率为 2.78%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	46,932,183.90	12.55
	其中：股票	46,932,183.90	12.55
2	基金投资	14,326,944.96	3.83
3	固定收益投资	309,710,986.97	82.83
	其中：债券	309,710,986.97	82.83
	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	2,231,056.13	0.60
8	其他资产	711,949.23	0.19
9	合计	373,913,121.19	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 21,507,748.90 元，占基金资产净值比例 7.35%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 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	1,421,717.00	0.49
B	采矿业	7,592,650.00	2.59
C	制造业	12,536,068.00	4.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,194,000.00	0.75
J	金融业	1,680,000.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,424,435.00	8.69

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,762,155.00	0.60
消费者非必需品	200,091.90	0.07
消费者常用品	-	-
能源	6,828,900.00	2.33
金融	3,775,640.00	1.29
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	8,940,962.00	3.06
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	21,507,748.90	7.35

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细



## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	22,300	8,940,962.00	3.06
2	00883	中国海洋石油	390,000	6,828,900.00	2.33
3	300750	宁德时代	20,000	5,037,800.00	1.72
4	601088	中国神华	89,200	3,889,120.00	1.33
5	601600	中国铝业	310,800	2,766,120.00	0.95
6	000333	美的集团	34,700	2,639,282.00	0.90
7	600941	中国移动	20,000	2,194,000.00	0.75
8	00939	建设银行	363,000	1,923,900.00	0.66
9	01398	工商银行	443,000	1,851,740.00	0.63
10	600028	中国石化	260,400	1,812,384.00	0.62

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,160,526.03	6.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	114,968,496.67	39.29
	其中：政策性金融债	10,547,983.56	3.60
4	企业债券	67,145,504.66	22.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	93,415,478.10	31.93
7	可转债（可交换债）	14,020,981.51	4.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	309,710,986.97	105.85

## 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2223002	22 工银安盛人寿	200,000	20,991,139.73	7.17
2	149974	22 国信 Y2	200,000	20,796,745.21	7.11
3	102200206	22 湖州城投 MTN004(可持续 挂钩)	200,000	20,551,036.71	7.02
4	132380037	23 融和融资 GN003(碳中和 债)	200,000	20,425,966.03	6.98
5	102200164	22 武夷投资 MTN001	200,000	20,384,993.97	6.97

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。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。

##### 5.10.2 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投资国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证监局的处罚。

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。

## 5.11.2

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。

## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,615.71
2	应收证券清算款	489,552.93
3	应收股利	189,780.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	711,949.23

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	230,038.42	0.08
2	123194	百洋转债	222,087.89	0.08
3	127075	百川转 2	220,170.56	0.08
4	113648	巨星转债	218,716.99	0.07
5	128144	利民转债	214,697.94	0.07
6	113668	鹿山转债	207,792.92	0.07
7	123213	天源转债	205,429.96	0.07
8	127077	华宏转债	203,278.25	0.07
9	123225	翔丰转债	196,619.77	0.07
10	123219	宇瞳转债	194,174.00	0.07
11	113629	泉峰转债	194,157.15	0.07
12	127095	广泰转债	193,424.52	0.07
13	111005	富春转债	192,551.06	0.07
14	128087	孚日转债	192,174.33	0.07
15	118039	煜邦转债	175,827.20	0.06
16	123221	力诺转债	173,405.72	0.06
17	123185	能辉转债	160,895.66	0.05
18	123208	孩王转债	155,358.70	0.05
19	123089	九洲转 2	152,827.48	0.05
20	113033	利群转债	144,856.64	0.05
21	113069	博 23 转债	144,619.12	0.05
22	110093	神马转债	139,768.65	0.05
23	123107	温氏转债	139,093.40	0.05
24	127045	牧原转债	138,805.18	0.05
25	110079	杭银转债	138,634.49	0.05

26	127027	能化转债	138,109.44	0.05
27	127085	韵达转债	136,005.27	0.05
28	123190	道氏转 02	135,937.40	0.05
29	127101	豪鹏转债	135,273.26	0.05
30	113048	晶科转债	134,973.04	0.05
31	110087	天业转债	134,524.62	0.05
32	113619	世运转债	134,424.76	0.05
33	113623	凤 21 转债	134,246.98	0.05
34	123228	震裕转债	134,071.82	0.05
35	113682	益丰转债	133,751.88	0.05
36	128132	交建转债	132,670.57	0.05
37	113647	禾丰转债	132,514.64	0.05
38	113549	白电转债	132,140.66	0.05
39	110076	华海转债	131,109.30	0.04
40	127052	西子转债	130,831.14	0.04
41	127068	顺博转债	129,885.03	0.04
42	113632	鹤 21 转债	129,706.72	0.04
43	128119	龙大转债	129,107.99	0.04
44	123115	捷捷转债	128,829.13	0.04
45	127019	国城转债	128,707.23	0.04
46	113658	密卫转债	128,428.52	0.04
47	128130	景兴转债	128,422.12	0.04
48	113640	苏利转债	128,408.67	0.04
49	118028	会通转债	128,190.35	0.04
50	118042	奥维转债	128,044.49	0.04
51	113636	甬金转债	127,973.44	0.04
52	113065	齐鲁转债	127,610.87	0.04
53	113064	东材转债	126,944.52	0.04
54	123179	立高转债	126,482.92	0.04
55	123117	健帆转债	126,318.76	0.04
56	118013	道通转债	126,063.44	0.04
57	128141	旺能转债	125,861.06	0.04
58	113644	艾迪转债	123,260.86	0.04
59	127015	希望转债	123,120.41	0.04
60	123192	科思转债	121,919.54	0.04
61	113059	福莱转债	121,202.16	0.04
62	113677	华懋转债	121,172.01	0.04
63	128063	未来转债	120,241.10	0.04
64	123113	仙乐转债	119,407.71	0.04
65	128128	齐翔转 2	117,804.96	0.04
66	113637	华翔转债	117,481.46	0.04
67	113569	科达转债	117,307.32	0.04

68	123204	金丹转债	117,306.13	0.04
69	111016	神通转债	117,250.88	0.04
70	113639	华正转债	117,038.64	0.04
71	127092	运机转债	115,729.12	0.04
72	111017	蓝天转债	114,046.13	0.04
73	128142	新乳转债	113,886.63	0.04
74	127054	双箭转债	113,666.07	0.04
75	111002	特纸转债	113,259.91	0.04
76	127076	中宠转 2	113,159.58	0.04
77	113653	永 22 转债	112,942.98	0.04
78	123183	海顺转债	112,382.54	0.04
79	118033	华特转债	111,102.63	0.04
80	127060	湘佳转债	110,999.18	0.04
81	113681	镇洋转债	110,723.54	0.04
82	113651	松霖转债	108,334.20	0.04
83	123133	佩蒂转债	108,288.26	0.04
84	113638	台 21 转债	107,022.18	0.04
85	123022	长信转债	106,069.53	0.04
86	113628	晨丰转债	105,994.52	0.04
87	113662	豪能转债	105,163.51	0.04
88	113657	再 22 转债	104,847.10	0.04
89	111011	冠盛转债	104,534.07	0.04
90	113664	大元转债	101,475.80	0.03
91	127053	豪美转债	101,031.31	0.03
92	127059	永东转 2	96,288.25	0.03
93	123220	易瑞转债	95,437.76	0.03
94	123050	聚飞转债	91,204.05	0.03
95	123227	雅创转债	91,078.20	0.03
96	123223	九典转 02	89,699.42	0.03
97	111013	新港转债	88,769.34	0.03
98	128117	道恩转债	82,028.19	0.03
99	123103	震安转债	70,691.86	0.02
100	123206	开能转债	67,474.30	0.02
101	123205	大叶转债	66,216.72	0.02
102	123143	胜蓝转债	66,049.58	0.02
103	110058	永鼎转债	63,651.35	0.02
104	123177	测绘转债	61,890.30	0.02
105	123159	崧盛转债	60,510.50	0.02

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 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。

## §6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001811	中欧明睿新常态混合 A	契约型开放式	1,480,000.82	3,438,633.91	1.18	是
2	166002	中欧新蓝筹混合 A	契约型开放式	1,819,159.33	3,362,534.11	1.15	是
3	001810	中欧潜力价值灵活配置混合 A	契约型开放式	1,280,000.00	2,404,992.00	0.82	是
4	004814	中欧红利优享灵活配置混合 A	契约型开放式	1,406,545.17	2,348,367.82	0.80	是
5	001955	中欧养老混合 A	契约型开放式	698,000.00	1,909,658.20	0.65	是
6	004812	中欧先进制造股票 A	契约型开放式	382,564.26	862,758.92	0.29	是

注：本基金为混合型基金，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金，本基金管理人根据基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期投资基金的情况。

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	1,620.92	1,620.92
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	410.36	410.36
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	40,735.16	40,735.16

当期持有基金产生的应支付托管费（元）	6,789.08	6,789.08
--------------------	----------	----------

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧招益稳健一年持有混合 A	中欧招益稳健一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	279,802,819.86	67,162,708.21
报告期期间基金总申购份额	128,389.72	28,422.73
减：报告期期间基金总赎回份额	53,563,044.55	14,152,638.71
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	226,368,165.03	53,038,492.23

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。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；

2、基金管理人业务资格批件、营业执照

3、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

## 10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 10.3 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

2024 年 10 月 25 日