

# 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF） 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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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	中欧增强回报债券（LOF）		
基金主代码	166008		
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）		
基金合同生效日	2010 年 12 月 2 日		
报告期末基金份额总额	1,992,788,207.10 份		
投资目标	在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。		
投资策略	本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响债券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、债券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。 本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整固定收益类资产投资比例。		
业绩比较基准	中国债券总指数		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧增强回报债券（LOF）A	中欧增强回报债券（LOF）C	中欧增强回报债券（LOF）E
下属分级基金的场内简称	中欧强债 LOF	-	-

下属分级基金的交易代码	166008	007446	001889
报告期末下属分级基金的份额总额	1,733,837,046.06 份	38,748,788.49 份	220,202,372.55 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）		
	中欧增强回报债券（LOF）A	中欧增强回报债券（LOF）C	中欧增强回报债券（LOF）E
1. 本期已实现收益	13,007,754.90	493,690.12	1,879,471.65
2. 本期利润	12,723,924.90	175,938.63	1,729,362.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0031	0.0084
4. 期末基金资产净值	1,823,222,916.58	40,029,974.07	230,525,055.37
5. 期末基金份额净值	1.0516	1.0331	1.0469

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

中欧增强回报债券（LOF）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	0.78%	0.12%	0.44%	0.13%	0.34%	-0.01%
过去六个月	2.59%	0.10%	1.43%	0.11%	1.16%	-0.01%
过去一年	5.15%	0.08%	3.54%	0.10%	1.61%	-0.02%
过去三年	5.24%	0.11%	5.41%	0.09%	-0.17%	0.02%
过去五年	2.70%	0.12%	7.73%	0.10%	-5.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	74.50%	0.13%	17.07%	0.11%	57.43%	0.02%

中欧增强回报债券 (LOF)C

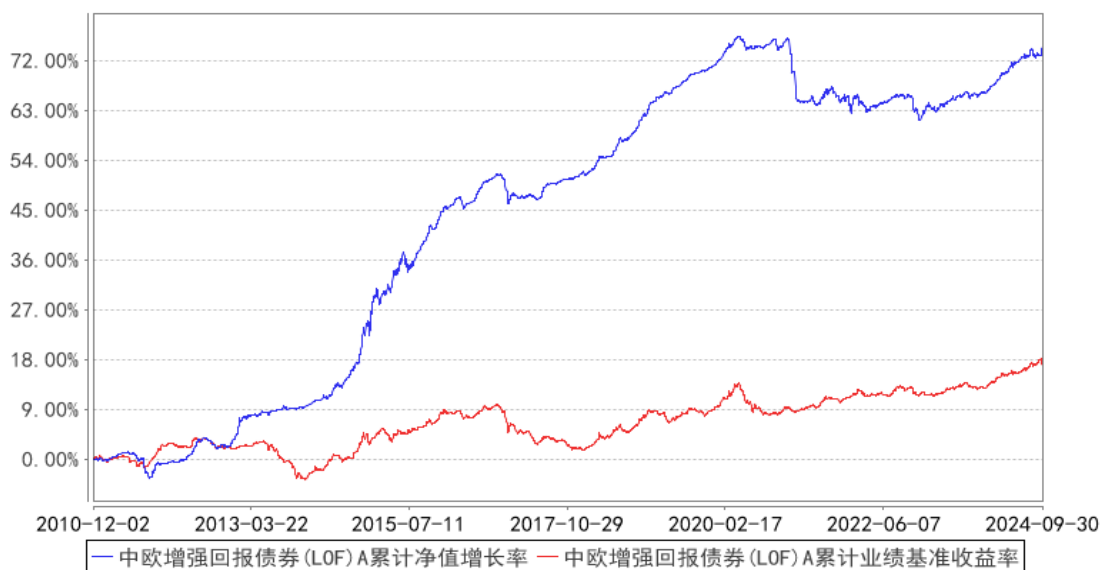
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.66%	0.12%	0.44%	0.13%	0.22%	-0.01%
过去六个月	2.37%	0.10%	1.43%	0.11%	0.94%	-0.01%
过去一年	4.72%	0.08%	3.54%	0.10%	1.18%	-0.02%
过去三年	3.99%	0.11%	5.41%	0.09%	-1.42%	0.02%
过去五年	0.66%	0.12%	7.73%	0.10%	-7.07%	0.02%
自基金份额 起始运作日 至今	2.23%	0.12%	8.92%	0.10%	-6.69%	0.02%

中欧增强回报债券 (LOF)E

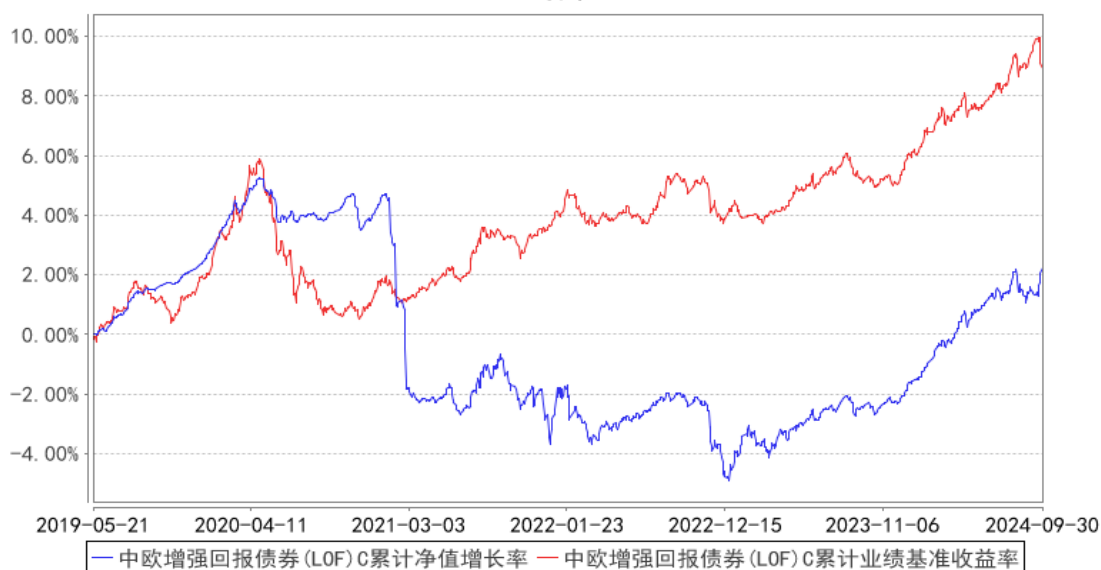
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.82%	0.12%	0.44%	0.13%	0.38%	-0.01%
过去六个月	2.63%	0.10%	1.43%	0.11%	1.20%	-0.01%
过去一年	5.19%	0.08%	3.54%	0.10%	1.65%	-0.02%
过去三年	5.29%	0.11%	5.41%	0.09%	-0.12%	0.02%
过去五年	2.72%	0.12%	7.73%	0.10%	-5.01%	0.02%
自基金份额 起始运作日 至今	25.27%	0.10%	10.02%	0.10%	15.25%	0.00%

### 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

中欧增强回报债券 (LOF) 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

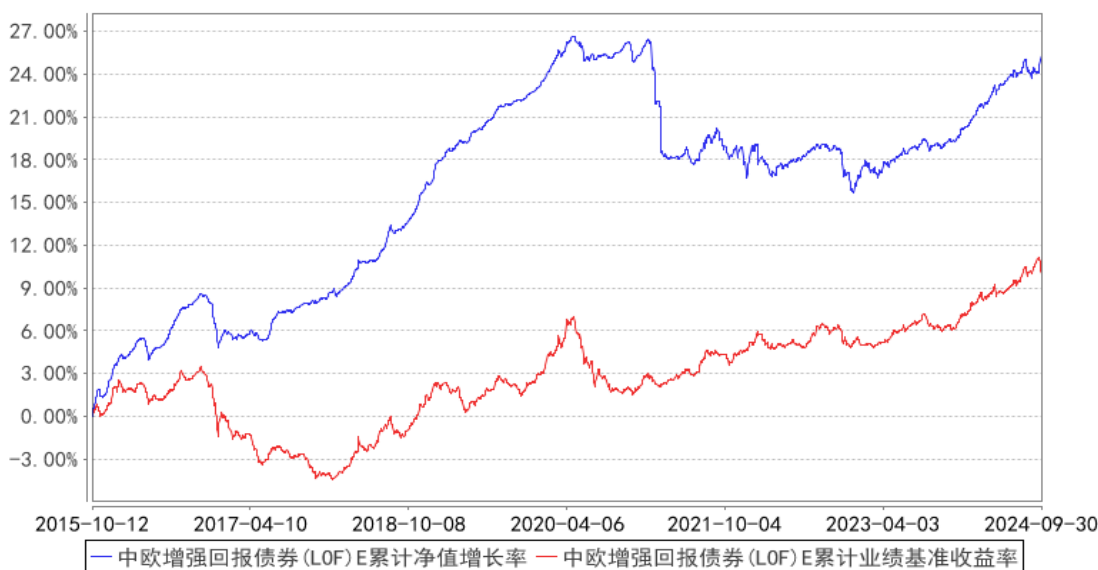


中欧增强回报债券 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2019 年 5 月 20 日新增 C 份额，图示日期为 2019 年 5 月 21 日至 2024 年 09 月 30 日。

中欧增强回报债券（LOF）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：本基金于 2015 年 10 月 8 日新增 E 份额，图示日期为 2015 年 10 月 12 日至 2024 年 09 月 30 日。

## § 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		
周锦程	基金经理	2023-05-26	-	13 年	历任德邦证券股份有限公司研究员、债券投资经理，浙商基金有限责任公司固定收益部基金经理。2022-10-12 加入中欧基金管理有限公司。
董霖哲	基金经理	2024-08-23	-	10 年	历任中再资产管理股份有限公司组合与市场风险管理部主管、固定收益部主管、助理投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益年金与专户投资部、多资产养老金投资部投资经理助理。2024-06-24 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。

-

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 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

三季度国内经济基本面总体有所走弱。工业生产维持了较强的韧性，制造业 PMI 9 月反弹至 49.8；出口金额维持了较高的增速水平，8 月出口金额增速达到 8.7%。但在居民预期出现转冷迹象的背景下，反映内需的消费和地产销售均出现了一定程度的下滑：8 月社零同比下降至 2.1%，而地产销售面积累计同比依然处于 -20.4% 的低位。地方政府在卖地收入下滑的财力制约下，地方基建投资增速也有所放缓，8 月基建投资（不含电力）累计同比下滑至 4.4% 的水平。

大类资产表现方面：权益类及含权资产在三季度大多数时间段处于下行状态，对于经济长期悲观情绪叠加基本面实际走弱是影响市场走势的主要原因。债券市场三季度大部分时间趋势性走强，收益率总体下行较多，期间在政策调控因素影响下有所反弹，但未能改变在居民及市场低风险偏好、资产荒背景下的收益率总体下行走势。而三季度末，在重要会议、重大政策影响下，大类资产表现出现了大幅转变，股票及转债市场迅速上行，债券收益率也出现了较大幅度的反弹。

操作回顾：纯债资产方面，组合在 7、8 月份采取较高的久期中枢，同时把握市场在政策冲击影响下收益率抬升的时点进行久期抬升，获取了较好的收益。进入 9 月后，组合采取偏保守的久

期策略。转债市场方面，组合利用转债市场大幅调整的时机，稳步提高转债资产比例。在 8 月末转债市场已处于较为极端的估值状态的情况下，积极大幅提高转债持仓比例。

市场展望方面：展望四季度，在强有力政策的支撑下，居民预期可能出现回暖，内需的循环也有可能重新恢复畅通，内需不足所带来的产需不平衡、通胀乏力问题也将随之缓解。与此同时，政策方面对于地产市场的呵护力度进一步加强，有利于地产销售额的提升和房价的企稳，从而进一步提升地产投资，同时降低房价下行带来的居民财富效应的下降。制造业投资方面，从库存及设备更新周期角度看，制造业依然处于顺周期阶段，向好局面大概率将依然保持。出口方面，美国经济大概率走向软着陆，全球经济失速风险降低，有利于出口维持较高增速水平。

未来投资策略：债券方面，虽然经济预计将持续回暖，但绝对位置依然不高，通胀水平回到目标位置仍需时间，因此央行对于实体经济的呵护预计将维持，资金利率预计将低位平稳。因此，组合将积极把握中短久期债券的配置窗口，追求确定性的票息，并通过一定的杠杆水平力争获取套息收益。对于长端债券，虽然四季度对于债市而言，经济基本面和政策面均存在逆风，组合也将积极把握市场情绪过热或者过冷所带来的波段操作机会，获取资本利得。权益及含权市场方面，政策层提振股市态度明确，经济基本面在更强有力的逆周期调节支持下具有较大的反转可能和上行空间。因此，权益市场具有较为坚实的上涨基础。转债方面，虽已跟随正股上行，但涨幅滞后，估值依然处于底部区域，投资性价比较高。未来随着权益市场持续走暖，交易热度预计也将抬升，补涨空间较大。组合将保持对转债资产的积极操作。仓位层面，保持相对积极仓位，做好市场情绪热度跟踪，在未来波动性可能加大的市场中做好择时。风格品种配置结构上，尽力挑选投资风险收益比较好的“双低品种”，降低对高转股溢价率品种的配置。行业选择上，关注具有较高弹性的小盘成长、长期政策导向明确的消费以及周期顺风、有出海逻辑的机械板块。

#### 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 0.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；基金 C 类份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；基金 E 类份额净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,323,916,703.12	96.33
	其中：债券	2,323,916,703.12	96.33
	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	52,164,121.55	2.16
8	其他资产	36,482,281.13	1.51
9	合计	2,412,563,105.80	100.00

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 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股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	34,766,782.75	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	733,641,517.90	35.04
	其中：政策性金融债	184,602,532.56	8.82
4	企业债券	251,290,065.47	12.00
5	企业短期融资券	105,776,247.09	5.05
6	中期票据	799,068,009.40	38.16
7	可转债（可交换债）	399,374,080.51	19.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,323,916,703.12	110.99

**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	2128028	21 邮储银行二级 01	500,000	51,257,024.66	2.45
2	252480007	24 东方债 01BC	500,000	50,518,553.42	2.41
3	240411	24 农发 11	500,000	50,331,712.33	2.40
4	102483603	24 昆明安居 MTN002	500,000	49,996,761.64	2.39
5	102483594	24 滨建投 MTN010	500,000	49,281,761.64	2.35

**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**

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**5.9.2 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。

**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**

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**5.10.3 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。

## 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，昆明市安居集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到昆明市官渡区城市管理局的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。中国东方资产管理股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

截止本报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	63,002.79
2	应收证券清算款	9,980,157.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,439,120.58
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	36,482,281.13

### 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	118025	奕瑞转债	9,840,187.35	0.47
2	113059	福莱转债	9,604,757.96	0.46
3	111010	立昂转债	8,880,061.90	0.42
4	127045	牧原转债	8,611,704.93	0.41
5	127084	柳工转2	7,314,171.64	0.35
6	118034	晶能转债	6,390,345.66	0.31
7	123107	温氏转债	6,275,205.02	0.30
8	123179	立高转债	6,100,760.92	0.29
9	123192	科思转债	6,095,976.78	0.29
10	110093	神马转债	5,942,458.84	0.28
11	123219	宇瞳转债	5,519,329.45	0.26
12	127100	神码转债	5,488,250.19	0.26

13	113647	禾丰转债	5,430,111.23	0.26
14	118024	冠宇转债	5,407,631.23	0.26
15	127101	豪鹏转债	5,351,007.68	0.26
16	113634	珀莱转债	5,286,316.73	0.25
17	110085	通 22 转债	5,148,900.00	0.25
18	127095	广泰转债	5,144,297.34	0.25
19	113644	艾迪转债	5,137,687.36	0.25
20	113033	利群转债	5,112,653.51	0.24
21	123194	百洋转债	5,047,452.05	0.24
22	113639	华正转债	5,013,509.91	0.24
23	127030	盛虹转债	4,618,480.36	0.22
24	123109	昌红转债	4,449,498.50	0.21
25	123168	惠云转债	4,364,542.29	0.21
26	123184	天阳转债	4,327,644.36	0.21
27	123145	药石转债	4,283,277.21	0.20
28	127042	嘉美转债	4,239,673.52	0.20
29	123212	立中转债	4,232,174.91	0.20
30	127105	龙星转债	4,222,223.61	0.20
31	123191	智尚转债	4,218,800.90	0.20
32	123089	九洲转 2	4,216,017.46	0.20
33	111015	东亚转债	4,202,566.84	0.20
34	123217	富仕转债	4,200,487.07	0.20
35	123078	飞凯转债	4,184,955.33	0.20
36	123149	通裕转债	4,184,076.15	0.20
37	111005	富春转债	4,182,209.06	0.20
38	127053	豪美转债	4,179,444.75	0.20
39	111016	神通转债	4,178,003.90	0.20
40	123233	凯盛转债	4,172,859.49	0.20
41	127052	西子转债	4,160,665.93	0.20
42	127059	永东转 2	4,154,889.78	0.20
43	113682	益丰转债	4,148,518.90	0.20
44	123169	正海转债	4,144,189.60	0.20
45	113679	芯能转债	4,127,610.72	0.20
46	123159	崧盛转债	4,124,268.10	0.20
47	123174	精锻转债	4,119,998.75	0.20
48	123211	阳谷转债	4,119,432.74	0.20
49	111004	明新转债	4,119,243.58	0.20
50	111014	李子转债	4,110,807.48	0.20
51	113677	华懋转债	4,106,268.75	0.20
52	113661	福 22 转债	4,100,057.36	0.20
53	111018	华康转债	4,096,739.10	0.20
54	113656	嘉诚转债	4,064,451.57	0.19

55	113609	永安转债	4,057,083.44	0.19
56	123165	回天转债	4,053,992.13	0.19
57	118009	华锐转债	3,957,270.87	0.19
58	123223	九典转 02	3,825,039.52	0.18
59	128134	鸿路转债	3,808,114.78	0.18
60	113669	景 23 转债	3,780,608.83	0.18
61	113674	华设转债	3,775,396.15	0.18
62	118036	力合转债	3,692,153.18	0.18
63	110075	南航转债	3,679,063.56	0.18
64	113667	春 23 转债	3,647,707.79	0.17
65	118028	会通转债	3,524,110.02	0.17
66	110087	天业转债	3,438,409.11	0.16
67	113047	旗滨转债	3,393,150.11	0.16
68	113061	拓普转债	3,338,847.24	0.16
69	113060	浙 22 转债	3,298,711.20	0.16
70	118038	金宏转债	3,280,094.03	0.16
71	118005	天奈转债	3,257,221.43	0.16
72	127039	北港转债	3,240,610.34	0.15
73	127092	运机转债	3,202,925.77	0.15
74	127073	天赐转债	3,202,665.52	0.15
75	123150	九强转债	3,112,577.71	0.15
76	113048	晶科转债	2,971,335.09	0.14
77	123222	博俊转债	2,884,785.09	0.14
78	127089	晶澳转债	2,672,872.60	0.13
79	113616	韦尔转债	2,641,919.35	0.13
80	123127	耐普转债	2,302,356.10	0.11
81	128081	海亮转债	2,237,975.89	0.11
82	128136	立讯转债	2,236,500.22	0.11
83	118003	华兴转债	2,215,671.81	0.11
84	118004	博瑞转债	2,212,980.09	0.11
85	113648	巨星转债	2,164,204.58	0.10
86	113584	家悦转债	2,128,110.69	0.10
87	113045	环旭转债	2,117,137.10	0.10
88	123190	道氏转 02	2,058,052.30	0.10
89	127074	麦米转 2	2,025,047.74	0.10
90	127018	本钢转债	2,022,369.04	0.10
91	113068	金铜转债	1,932,774.12	0.09
92	123131	奥飞转债	1,842,266.20	0.09
93	111000	起帆转债	1,637,742.05	0.08
94	113659	莱克转债	1,551,602.20	0.07
95	123101	拓斯转债	1,165,939.73	0.06
96	110089	兴发转债	1,109,197.26	0.05

97	113655	欧 22 转债	1,064,549.32	0.05
98	127070	大中转债	1,005,979.89	0.05
99	127064	杭氧转债	698,385.65	0.03
100	127072	博实转债	674,620.47	0.03
101	127067	恒逸转 2	648,793.02	0.03
102	123071	天能转债	549,549.32	0.03

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧增强回报债券 (LOF) A	中欧增强回报 债券 (LOF) C	中欧增强回报债 券 (LOF) E
报告期期初基金份额总额	1,271,715,584.56	52,623,498.14	201,481,817.44
报告期期间基金总申购份额	496,722,455.83	26,441,994.72	49,746,510.33
减:报告期期间基金总赎回份额	34,600,994.33	40,316,704.37	31,025,955.22
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	1,733,837,046.06	38,748,788.49	220,202,372.55

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	中欧增强回报债券 (LOF) A	中欧增强回报债券 (LOF) C	中欧增强回报债券 (LOF) E
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	199,094,883.16
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	30,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	169,094,883.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-	76.79

注：买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，卖出/赎回总份额含转换出份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申赎	2024-09-27	-30,000,000.00	-31,295,344.50	0.0005
合计			-30,000,000.00	-31,295,344.50	

注：本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用的费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024年07月01日至2024年09月30日	601,383,181.32	0.00	0.00	601,383,181.32	30.18%
	2	2024年08月02日至2024年09月26日	193,274,469.07	191,332,742.71	0.00	384,607,211.78	19.30%
产品特有风险							

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

## 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 9.3 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