

# 中欧瑾添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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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        | 中欧瑾添混合   |          |
| 基金主代码       | 013998   |          |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |          |
| 基金合同生效日     | 2021 年 11 月 9 日  |          |
| 报告期末基金份额总额  | 76,955,038.72 份  |          |
| 投资目标        | 本基金依据科学严谨的大类资产配置框架，通过把握债券、股票市场的投资机会，在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        | 本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。 |          |
| 业绩比较基准      | 中证 800 指数收益率×18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2%+中债综合财富(总值)指数收益率×80%  |          |
| 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。本基金还可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       | 兴业银行股份有限公司   |          |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧瑾添混合 A   | 中欧瑾添混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013998   | 013999   |

|                 |                 |              |
|-----------------|-----------------|--------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 76,838,912.08 份 | 116,126.64 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） |            |
|-----------------|-------------------------------------|------------|
|                 | 中欧瑾添混合 A                            | 中欧瑾添混合 C   |
| 1. 本期已实现收益      | -3,320,873.06                       | -5,092.98  |
| 2. 本期利润         | 1,341,030.21                        | 1,843.91   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0175                              | 0.0153     |
| 4. 期末基金资产净值     | 66,306,428.10                       | 100,674.01 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8629                              | 0.8669     |

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

中欧瑾添混合 A

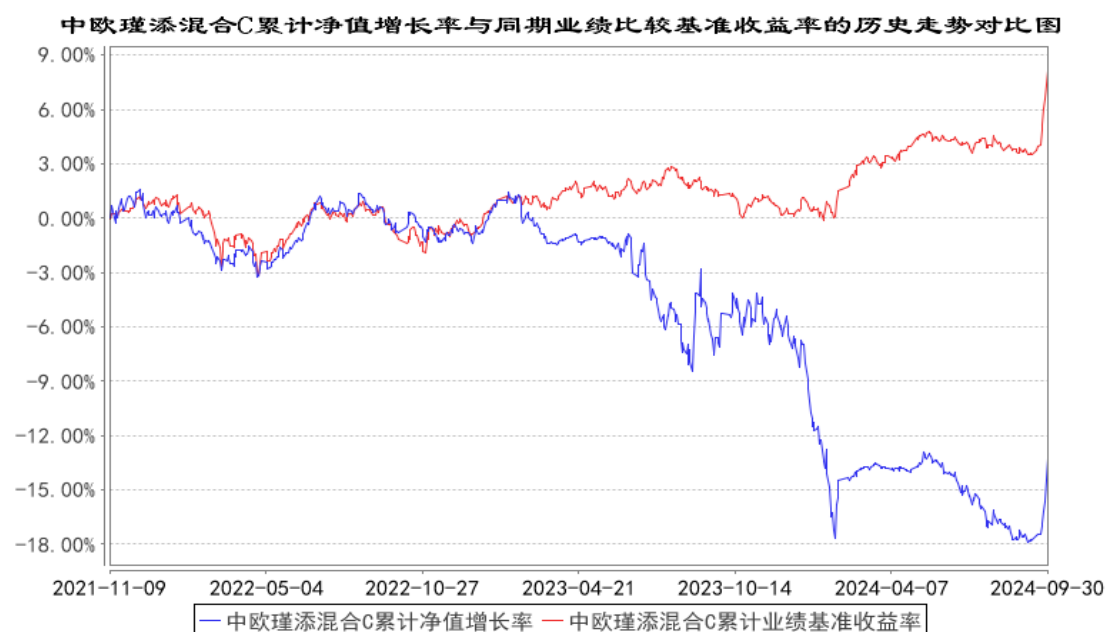
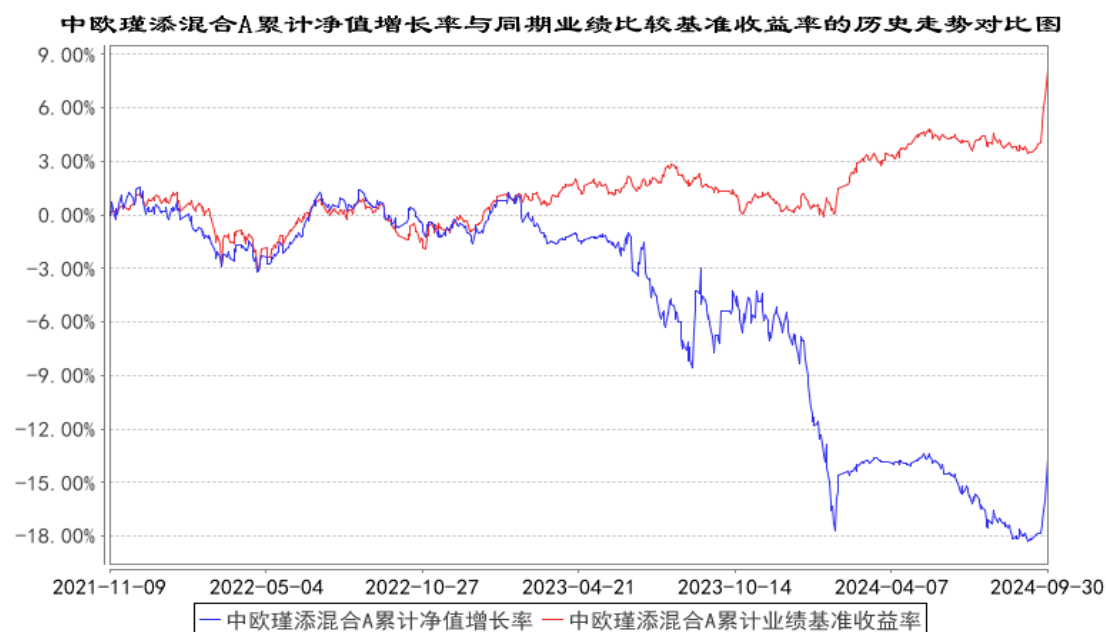
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 2.06%   | 0.47%     | 3.87%      | 0.28%         | -1.81%  | 0.19% |
| 过去六个月      | 0.12%   | 0.36%     | 4.88%      | 0.23%         | -4.76%  | 0.13% |
| 过去一年       | -8.83%  | 0.50%     | 6.74%      | 0.21%         | -15.57% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.71% | 0.41%     | 8.14%      | 0.21%         | -21.85% | 0.20% |

中欧瑾添混合 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      | 2.04%   | 0.47% | 3.87% | 0.28% | -1.83%  | 0.19% |
| 过去六个月      | 0.53%   | 0.36% | 4.88% | 0.23% | -4.35%  | 0.13% |
| 过去一年       | -8.51%  | 0.50% | 6.74% | 0.21% | -15.25% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.31% | 0.41% | 8.14% | 0.21% | -21.45% | 0.20% |

### 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



## § 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       |        |  |
| 苏佳  | 基金经理<br>/基金经理助理        | 2024-02-02  | -          | 8 年    | 历任广发银行股份有限公司总行金融机构部行员,易方达基金管理有限公司投资支持专员,易方达基金管理有限公司投资经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管理有限公司。   |
| 赵宇澄 | 基金经理<br>/基金经理助理        | 2024-04-26  | -          | 6 年    | 历任博时基金管理有限公司基金经理助理兼高级研究员。2024-01-29 加入中欧基金管理有限公司。  |
| 李帅  | 基金经理                   | 2023-06-19  | 2024-08-23 | 15 年   | 历任嘉实基金管理有限公司国内和海外市场多行业研究员、周期和制造组组长、基金经理助理、基金经理,中信产业基金制造业高级研究员。2020-10-28 加入中欧基金管理有限公司。   |
| 王申  | 固收投决会委员/<br>研究组组长/基金经理 | 2024-08-23  | -          | 14 年   | 历任友邦保险上海分公司中国计算中心一级程序员,上海申银万国证券研究所有限公司债券分析师,国金证券研究所首席债券分析师/执行总监,博时基金管理有限公司宏观策略部总经理/固定收益研究部总经理、研究总监/基金经理。2024-02-19 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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中苏佳担任本基金的基金经理；赵宇澄担任本基金的基金经理。

### 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

三季度基本面进一步走弱，地方政府和居民部门债务存续的风险有所加剧，并成为各个大类资产的定价主线。权益市场上，5 月至 9 月中旬整体低迷，前期最强势的红利风格因子出现大幅回撤，其中 5-7 月的回撤驱动因素主要来自于情绪的降温、交易拥挤度的下降，而 7 月底至 9 月中旬的大幅回撤则表达出市场对于权益资产中最稳健风格的现金流存续性出现悲观预期；债市中 10 年国债收益率在中秋节前后达到 2% 整数关口；转债上，8 月之后开始出现民企转债大面积跌破债底的现象，表明市场对于民企的融资存续和信用风险担忧大幅度上升。各类资产在基本面风险加剧的情况下开始出现极度悲观的定价特征。

9 月下旬政策出现大幅转向。9 月 24 日央行等三部委召开新闻发布会，提出远超市场预期的货币政策组合拳，表明决策层开始关注到基本面风险并开始进行强力干预，之后中央各部委持续表态发力，这些政策转向极大地扭转了市场对于基本面的悲观预期，并在资产定价上出现剧烈表达。权益市场在不到两周的时间里上涨超过 30%，债券则出现比较大的收益率上行，而居民部门明显开始进行股债资产配置切换。总体而言，9 月下旬以来的政策转向节奏快、远超市场预期，有力扭转了市场前期的极度悲观预期。

组合在 9 月下旬之前立足于防守和回撤控制，保持了较低的权益和转债仓位，以红利风格和质量风格为主，并保持较长的债券久期。在观察到政策大幅转向后，组合明显提升了权益和转债仓位，并加大了质量和成长风格的配置，大幅降低组合久期。

展望后续，随着权益市场急速暴涨的阶段逐步过去，组合将逐步调整为比较均衡的风格配置，并且在仓位上根据短期盈亏比进行动态调节。总体上，中期低利率的环境概率较大，基本面的修复需要观察，企业盈利的修复依旧存在较大的不确定性、并且预计需要较长时间才能有所显现，预计政策转向的核心诉求仍旧在于稳定地方政府和居民部门的债务存续风险底线。在这些宏观特征下，预计红利和价值风格依旧会是中期的占优风格，组合会以此为底仓配置，并根据流动性环境的变化对质量、成长等其他风格因子进行适度地动态配置。债券上，预计未来 2-3 个月收益率整体下行空间有限，组合将保持比较中性的久期配置。组合会继续尽力把握股债资产的绝对收益机会。

#### 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 2.06%，同期业绩比较基准收益率为 3.87%；基金 C 类份额净值增长率为 2.04%，同期业绩比较基准收益率为 3.87%。

#### 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              | 19,426,335.45 | 29.18        |
|    | 其中：股票             | 19,426,335.45 | 29.18        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 23,131,134.27 | 34.75        |
|    | 其中：债券             | 23,131,134.27 | 34.75        |
|    | 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          | 23,893,637.87 | 35.90        |
|    | 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      | 109,312.04    | 0.16         |
| 8  | 其他资产              | 2,976.00      | 0.00         |
| 9  | 合计                | 66,563,395.63 | 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

| 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         | 98,892.00     | 0.15         |
| B  | 采矿业              | 1,539,206.68  | 2.32         |
| C  | 制造业              | 13,077,924.07 | 19.69        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 770,622.00    | 1.16         |
| E  | 建筑业              | 215,800.00    | 0.32         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 766,256.60    | 1.15         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,320,827.10  | 1.99         |
| J  | 金融业              | 1,286,256.00  | 1.94         |
| K  | 房地产业             | 99,792.00     | 0.15         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 202,909.00    | 0.31         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 47,850.00     | 0.07         |
| 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               | 19,426,335.45 | 29.25        |

## 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港股通投资股票。

## 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

| 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  | 300628 | 亿联网络 | 8,700  | 367,836.00 | 0.55         |
| 2  | 601225 | 陕西煤业 | 12,100 | 333,718.00 | 0.50         |
| 3  | 600066 | 宇通客车 | 11,800 | 310,930.00 | 0.47         |
| 4  | 688188 | 柏楚电子 | 1,235  | 260,226.85 | 0.39         |
| 5  | 002749 | 国光股份 | 18,500 | 258,260.00 | 0.39         |
| 6  | 002270 | 华明装备 | 14,400 | 255,888.00 | 0.39         |
| 7  | 601958 | 金钼股份 | 21,100 | 251,090.00 | 0.38         |
| 8  | 601717 | 郑煤机  | 16,400 | 231,076.00 | 0.35         |
| 9  | 603589 | 口子窖  | 4,800  | 230,160.00 | 0.35         |
| 10 | 600866 | 星湖科技 | 35,900 | 225,452.00 | 0.34         |

## 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      | 10,352,877.93 | 15.59        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 12,778,256.34 | 19.24        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 23,131,134.27 | 34.83        |

### 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  | 019729 | 23 国债 26 | 43,000 | 4,512,146.69 | 6.79         |
| 2  | 019693 | 22 国债 28 | 35,000 | 3,568,484.93 | 5.37         |
| 3  | 113042 | 上银转债     | 16,840 | 1,910,971.37 | 2.88         |
| 4  | 019702 | 23 国债 09 | 15,000 | 1,764,105.21 | 2.66         |
| 5  | 110087 | 天业转债     | 5,720  | 574,239.42   | 0.86         |

### 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。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。

### 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。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。

### 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，本钢板材股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到沈阳铁路监督管理局、本溪市生态环境局的处罚。上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。深圳市道通科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市市场监管局南山监管局的处罚。

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   | -        |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | 2,976.00 |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |

|   |    |          |
|---|----|----------|
| 8 | 合计 | 2,976.00 |
|---|----|----------|

#### 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  | 113042 | 上银转债    | 1,910,971.37 | 2.88         |
| 2  | 110087 | 天业转债    | 574,239.42   | 0.86         |
| 3  | 118028 | 会通转债    | 537,499.87   | 0.81         |
| 4  | 127018 | 本钢转债    | 515,412.47   | 0.78         |
| 5  | 118013 | 道通转债    | 460,661.74   | 0.69         |
| 6  | 127090 | 兴瑞转债    | 459,841.97   | 0.69         |
| 7  | 118024 | 冠宇转债    | 446,774.92   | 0.67         |
| 8  | 128137 | 洁美转债    | 435,109.07   | 0.66         |
| 9  | 111010 | 立昂转债    | 428,721.42   | 0.65         |
| 10 | 127100 | 神码转债    | 427,655.86   | 0.64         |
| 11 | 127064 | 杭氧转债    | 400,791.76   | 0.60         |
| 12 | 127043 | 川恒转债    | 395,583.12   | 0.60         |
| 13 | 127040 | 国泰转债    | 393,854.51   | 0.59         |
| 14 | 123150 | 九强转债    | 392,207.59   | 0.59         |
| 15 | 110079 | 杭银转债    | 387,933.37   | 0.58         |
| 16 | 110062 | 烽火转债    | 379,899.73   | 0.57         |
| 17 | 113054 | 绿动转债    | 366,088.40   | 0.55         |
| 18 | 127045 | 牧原转债    | 353,953.22   | 0.53         |
| 19 | 110093 | 神马转债    | 348,275.98   | 0.52         |
| 20 | 110067 | 华安转债    | 342,053.99   | 0.52         |
| 21 | 113043 | 财通转债    | 330,719.94   | 0.50         |
| 22 | 110073 | 国投转债    | 330,672.36   | 0.50         |
| 23 | 127039 | 北港转债    | 329,389.39   | 0.50         |
| 24 | 113021 | 中信转债    | 323,702.63   | 0.49         |
| 25 | 113056 | 重银转债    | 320,501.45   | 0.48         |
| 26 | 110089 | 兴发转债    | 313,902.82   | 0.47         |
| 27 | 113060 | 浙 22 转债 | 292,234.82   | 0.44         |
| 28 | 127016 | 鲁泰转债    | 229,093.45   | 0.34         |
| 29 | 123222 | 博俊转债    | 219,753.16   | 0.33         |
| 30 | 110059 | 浦发转债    | 130,756.54   | 0.20         |

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 中欧瑾添混合 A      | 中欧瑾添混合 C   |
|---------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 76,841,413.06 | 123,987.91 |
| 报告期期间基金总申购份额              | -             | 1,973.77   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,500.98      | 9,835.04   |
| 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               | 76,838,912.08 | 116,126.64 |

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                       | 中欧瑾添混合 A      | 中欧瑾添混合 C |
|--------------------------|---------------|----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 53,615,400.24 | -        |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -        |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -        |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 53,615,400.24 | -        |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 69.78         | -        |

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

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

## § 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 | 53,615,400.24 | 0.00 | 0.00 | 53,615,400.24 | 69.67% |

|  |                                    |               |      |      |               |        |
|--|------------------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|  | 月 30 日                             |               |      |      |               |        |
| 2  | 2024 年 07 月 01 日至 2024 年 09 月 30 日 | 23,198,004.87 | 0.00 | 0.00 | 23,198,004.87 | 30.14% |
| 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