

# 中欧磐固债券型证券投资基金 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	中欧磐固债券
基金主代码	019417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	972,689,387.93 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
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×12%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%+中债综合财富(总值)指数收益率×85%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
下属分级基金的交易代码	019417	019418
报告期末下属分级基金的份额总额	567,769,311.42 份	404,920,076.51 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)	
	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
1. 本期已实现收益	-8,281,990.80	-6,672,311.64
2. 本期利润	9,236,271.58	5,770,535.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.0129
4. 期末基金资产净值	599,952,467.30	426,298,630.02
5. 期末基金份额净值	1.0567	1.0528

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

中欧磐固债券 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

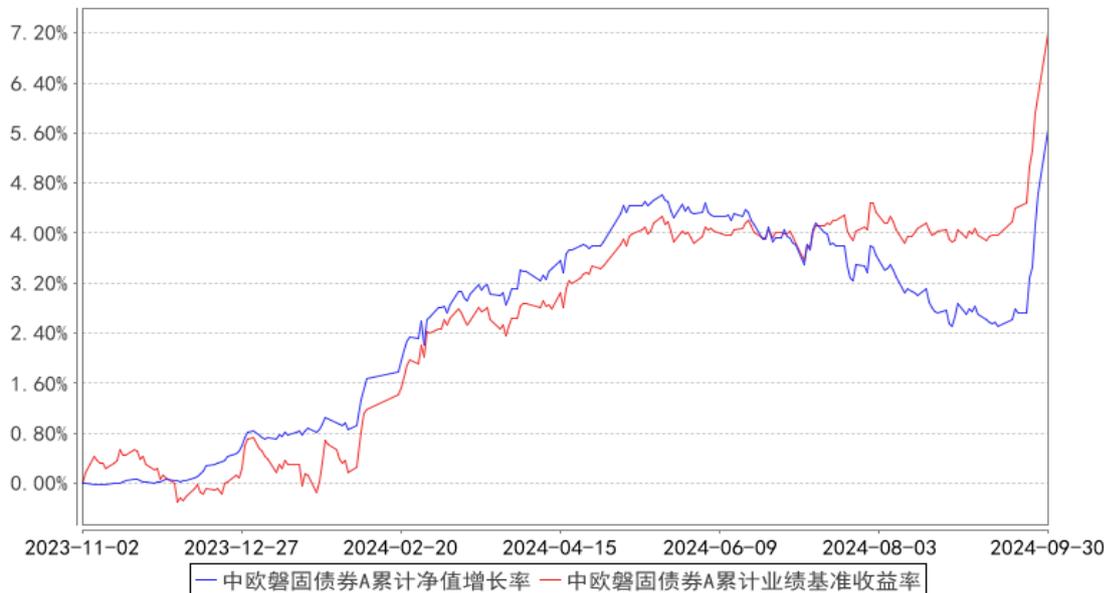
过去三个月	1.67%	0.22%	3.08%	0.20%	-1.41%	0.02%
过去六个月	2.48%	0.18%	4.46%	0.16%	-1.98%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.67%	0.15%	7.21%	0.16%	-1.54%	-0.01%

中欧磐固债券 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%	0.22%	3.08%	0.20%	-1.51%	0.02%
过去六个月	2.26%	0.18%	4.46%	0.16%	-2.20%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.28%	0.15%	7.21%	0.16%	-1.93%	-0.01%

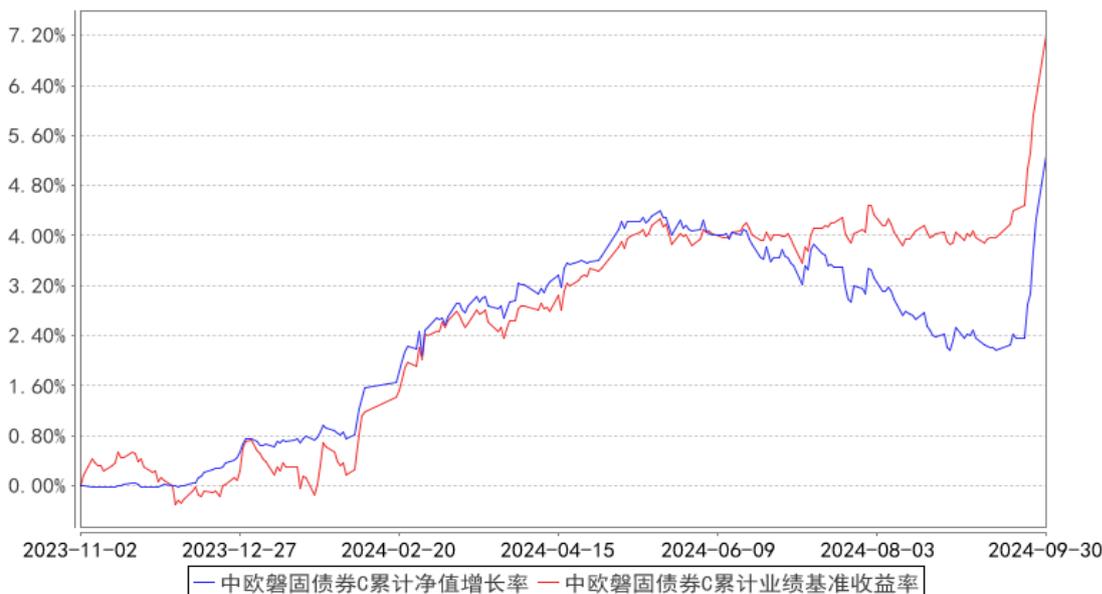
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧磐固债券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



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 11 月 2 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧磐固债券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：本基金基金合同生效日期为 2023 年 11 月 2 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

## § 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		
华李成	多资产投资决策会委员/多资产公募组组长/基金经理	2023-11-02	-	10 年	历任浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资经理。2016-05-09 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理。

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

2024 年三季度股票基本延续前期走势，但最后两周走出反转行情，债券受监管和政策影响转为震荡。三季度中证 800 指数上涨 16.10%，中债新综合财富（1-3 年）指数上涨 0.51%。

股票层面，受悲观预期影响市场延续前期跌势，前期强势结构也出现明显回调，市场宽度下降对策略有效性构成明显挑战。但随着 9 月下旬政策转向得到确认，市场预期和情绪迅速扭转，叠加各类资金快速流入市场，推动市场走出历史罕见的快速上涨。从短期情绪指标看，市场维持如此高的热度存在难度，但相信随着情绪回归常态后，市场可操作性会明显上升，后续市场机会值得期待。

债券层面，市场面临内在趋势和外部变量的反复博弈，波动率显著上升。利率债同样受悲观预期影响，10 年期国债收益率一度逼近 2.0% 这一重要关口，但受央行和政策等外部变量影响，最终呈现出区间震荡走势。信用债除了受无风险利率影响，信用利差跟随机构行为变化重新走阔。转债在经历前期多重冲击后一度出现抛售，转债经过调整后配置价值较为明显，在 9 月下旬随着股票快速上涨也出现明显修复。

三季度组合坚持资产配置理念，适时调整组合股债配置，保持了合理的权益资产配置比例。股票方面，组合采用多策略管理框架，充分发挥不同策略间的分散化效果来平滑组合波动，通过

策略配置权重调整来更好地契合市场节奏，并积极通过 ETF 把握结构性机会；债券方面，组合坚持高等级信用债配置策略，适时通过长久期利率债调节组合久期，基本把握了市场机会；转债方面，组合根据市场走势和投资判断，积极参与转债投资，但节奏上仍有优化空间。

#### 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 3.08%；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 3.08%。

#### 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	63,818,393.33	4.66
	其中：股票	63,818,393.33	4.66
2	基金投资	92,115,188.80	6.73
3	固定收益投资	1,183,238,115.80	86.39
	其中：债券	1,183,238,115.80	86.39
	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	27,908,217.21	2.04
8	其他资产	2,546,375.25	0.19
9	合计	1,369,626,290.39	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	50,524.00	0.00
B	采矿业	3,767,495.00	0.37
C	制造业	43,875,067.24	4.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,393,748.00	0.14

E	建筑业	1,528,440.00	0.15
F	批发和零售业	538,338.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,497,918.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,393,086.09	0.14
J	金融业	8,773,777.00	0.85
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	63,818,393.33	6.22

### 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	600309	万华化学	31,100	2,840,052.00	0.28
2	300750	宁德时代	5,800	1,460,962.00	0.14
3	600519	贵州茅台	700	1,223,600.00	0.12
4	000333	美的集团	13,700	1,042,022.00	0.10
5	000651	格力电器	20,800	997,152.00	0.10
6	601668	中国建筑	159,400	985,092.00	0.10
7	601101	昊华能源	87,300	874,746.00	0.09
8	603299	苏盐井神	70,000	821,100.00	0.08
9	688608	恒玄科技	3,614	767,541.32	0.07
10	000039	中集集团	80,300	721,897.00	0.07

### 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	81,813,699.42	7.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,835,198.97	31.26
	其中：政策性金融债	132,835,825.53	12.94
4	企业债券	218,407,260.82	21.28

5	企业短期融资券	30,496,905.21	2.97
6	中期票据	481,619,197.45	46.93
7	可转债（可交换债）	50,065,853.93	4.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,183,238,115.80	115.30

### 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	240305	24 进出 05	500,000	51,282,876.71	5.00
2	240210	24 国开 10	500,000	50,921,438.36	4.96
3	102483318	24 建安投资 MTN003	500,000	49,498,052.05	4.82
4	232400032	24 成都银行二级资本债 02	500,000	49,171,800.00	4.79
5	240256	延长 KY09	400,000	42,460,306.85	4.14

### 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

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-2,104,917.90
国债期货投资本期公允价值变动（元）					502,300.00

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

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

## 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，南京溧水经济技术开发区集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到南京市规划和自然资源局的处罚。青岛国信发展(集团)有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局青岛市分局的处罚。

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	100,474.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,445,900.35
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	2,546,375.25
---	----	--------------

#### 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	123107	温氏转债	914,569.90	0.09
2	127075	百川转 2	877,460.24	0.09
3	123213	天源转债	866,940.27	0.08
4	111005	富春转债	853,826.42	0.08
5	128133	奇正转债	847,783.54	0.08
6	113648	巨星转债	840,966.81	0.08
7	123222	博俊转债	830,023.07	0.08
8	123225	翔丰转债	781,594.13	0.08
9	113668	鹿山转债	770,886.07	0.08
10	128087	孚日转债	769,978.48	0.08
11	123204	金丹转债	767,277.88	0.07
12	113629	泉峰转债	760,544.59	0.07
13	127077	华宏转债	755,173.80	0.07
14	123050	聚飞转债	716,603.29	0.07
15	118039	煜邦转债	701,110.96	0.07
16	123221	力诺转债	681,496.60	0.07
17	123089	九洲转 2	575,944.87	0.06
18	113632	鹤 21 转债	567,615.62	0.06
19	123190	道氏转 02	550,746.39	0.05
20	113069	博 23 转债	548,811.00	0.05
21	127032	苏行转债	543,652.18	0.05
22	123208	孩王转债	541,829.50	0.05
23	113682	益丰转债	531,691.34	0.05
24	127045	牧原转债	530,929.83	0.05
25	127027	能化转债	529,816.39	0.05
26	113033	利群转债	528,895.19	0.05
27	110093	神马转债	524,705.25	0.05
28	113619	世运转债	517,678.35	0.05
29	113623	凤 21 转债	515,371.89	0.05
30	113065	齐鲁转债	515,001.00	0.05
31	110089	兴发转债	512,449.13	0.05
32	127085	韵达转债	511,116.59	0.05
33	113048	晶科转债	510,969.37	0.05
34	113059	福莱转债	509,459.95	0.05
35	110087	天业转债	506,977.11	0.05
36	113658	密卫转债	499,036.54	0.05
37	123228	震裕转债	498,156.77	0.05
38	127019	国城转债	497,949.27	0.05

39	127043	川恒转债	496,690.63	0.05
40	127091	科数转债	492,866.92	0.05
41	113064	东材转债	492,588.13	0.05
42	113549	白电转债	489,409.86	0.05
43	127052	西子转债	487,964.79	0.05
44	123076	强力转债	487,627.61	0.05
45	127101	豪鹏转债	484,077.04	0.05
46	113637	华翔转债	481,174.05	0.05
47	118042	奥维转债	478,374.20	0.05
48	113647	禾丰转债	474,262.93	0.05
49	118013	道通转债	473,621.53	0.05
50	113673	岱美转债	473,502.98	0.05
51	113639	华正转债	472,410.53	0.05
52	123192	科思转债	472,263.03	0.05
53	113644	艾迪转债	471,227.38	0.05
54	127015	希望转债	470,881.55	0.05
55	113640	苏利转债	469,880.62	0.05
56	111002	特纸转债	457,808.48	0.04
57	127068	顺博转债	455,538.81	0.04
58	123115	捷捷转债	454,892.25	0.04
59	128128	齐翔转 2	454,560.53	0.04
60	127095	广泰转债	451,765.49	0.04
61	128063	未来转债	450,904.13	0.04
62	128130	景兴转债	449,477.40	0.04
63	128119	龙大转债	448,851.99	0.04
64	113636	甬金转债	447,907.04	0.04
65	123179	立高转债	447,790.34	0.04
66	123133	佩蒂转债	446,689.08	0.04
67	128116	瑞达转债	446,196.06	0.04
68	123113	仙乐转债	443,979.58	0.04
69	113677	华懋转债	443,949.18	0.04
70	113638	台 21 转债	441,607.33	0.04
71	128134	鸿路转债	439,960.57	0.04
72	127060	湘佳转债	437,521.76	0.04
73	113047	旗滨转债	437,381.71	0.04
74	127054	双箭转债	433,127.55	0.04
75	118033	华特转债	424,610.05	0.04
76	113653	永 22 转债	419,916.23	0.04
77	127092	运机转债	414,016.87	0.04
78	123183	海顺转债	412,769.52	0.04
79	118015	芯海转债	402,353.56	0.04
80	123223	九典转 02	398,842.06	0.04

81	127053	豪美转债	395,996.29	0.04
82	127090	兴瑞转债	395,464.10	0.04
83	113651	松霖转债	389,247.30	0.04
84	127072	博实转债	384,461.13	0.04
85	113664	大元转债	381,742.28	0.04
86	123220	易瑞转债	376,266.11	0.04
87	111008	沿浦转债	365,141.88	0.04
88	127059	永东转 2	309,571.90	0.03
89	113662	豪能转债	306,830.02	0.03
90	123103	震安转债	265,427.94	0.03
91	123227	雅创转债	263,114.81	0.03
92	123205	大叶转债	257,822.53	0.03
93	123206	开能转债	255,893.10	0.02
94	123143	胜蓝转债	250,437.98	0.02
95	123022	长信转债	247,093.80	0.02
96	123177	测绘转债	246,298.14	0.02
97	113546	迪贝转债	245,163.77	0.02
98	128101	联创转债	241,510.36	0.02
99	123159	崧盛转债	230,364.52	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	159792	富国中证港股通互联网 ETF	交易型开放式	45,000,000.00	33,075,000.00	3.22	否
2	512070	易方达沪深 300 非银 ETF	交易型开放式	22,842,000.00	18,684,756.00	1.82	否

3	513690	博时恒生高股息 ETF	交易型开放式	14,918,800.00	13,516,432.80	1.32	否
4	512690	酒 ETF	交易型开放式	15,000,000.00	10,650,000.00	1.04	否
5	512100	南方中证 1000ETF	交易型开放式	3,000,000.00	7,167,000.00	0.70	否
6	510500	南方中证 500ETF	交易型开放式	1,000,000.00	5,995,000.00	0.58	否
7	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放式	3,000,000.00	3,027,000.00	0.29	否

注：本基金为债券型基金，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)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	54,178.88	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	10,836.16	-
当期交易所交易基金产生的交易费(元)	4,422.86	-

### 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	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
报告期期初基金份额总额	588,114,398.91	448,091,789.67
报告期期间基金总申购份额	155,984,427.55	127,130,155.02
减：报告期期间基金总赎回份额	176,329,515.04	170,301,868.18
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	567,769,311.42	404,920,076.51

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