

中欧瑾泰债券型证券投资基金 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37

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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	37
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12	投资组合报告附注.....	37
§ 8	基金份额持有人信息	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
§ 9	开放式基金份额变动	39
§ 10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4	基金投资策略的改变.....	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	42
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	43
§ 12	备查文件目录	43
12.1	备查文件目录.....	43
12.2	存放地点.....	44
12.3	查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧瑾泰债券型证券投资基金	
基金简称	中欧瑾泰债券	
基金主代码	004728	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 28 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	558,364,812.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧瑾泰债券 A	中欧瑾泰债券 C
下属分级基金的交易代码	004728	004729
报告期末下属分级基金的份额总额	554,896,628.11 份	3,468,184.32 份

2.2 基金产品说明

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	本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95528
传真	021-33830351	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋

邮政编码	200120	200126
法定代表人	窦玉明	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	中欧基金管理有限公司	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)	
	中欧瑾泰债券 A	中欧瑾泰债券 C
本期已实现收益	12,848,233.20	41,626.17
本期利润	14,303,511.93	38,688.14
加权平均基金份额本期利润	0.0192	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.78%	1.51%
本期基金份额净值增长率	1.72%	1.65%
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	35,124,431.65	169,714.68
期末可供分配基金份额利润	0.0633	0.0489
期末基金资产净值	590,021,059.76	3,637,899.00
期末基金份额净值	1.0633	1.0489
3.1.3 累计期末指	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

标		
基金份额累计净值增长率	16.90%	16.65%

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

中欧瑾泰债券 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	0.40%	0.07%	0.18%	0.05%	0.22%	0.02%
过去三个月	1.29%	0.05%	0.94%	0.04%	0.35%	0.01%
过去六个月	1.72%	0.04%	1.22%	0.04%	0.50%	0.00%
过去一年	4.05%	0.12%	1.35%	0.05%	2.70%	0.07%
过去三年	8.89%	0.08%	2.99%	0.05%	5.90%	0.03%
自基金合同转型生效至今	16.90%	0.08%	5.97%	0.06%	10.93%	0.02%

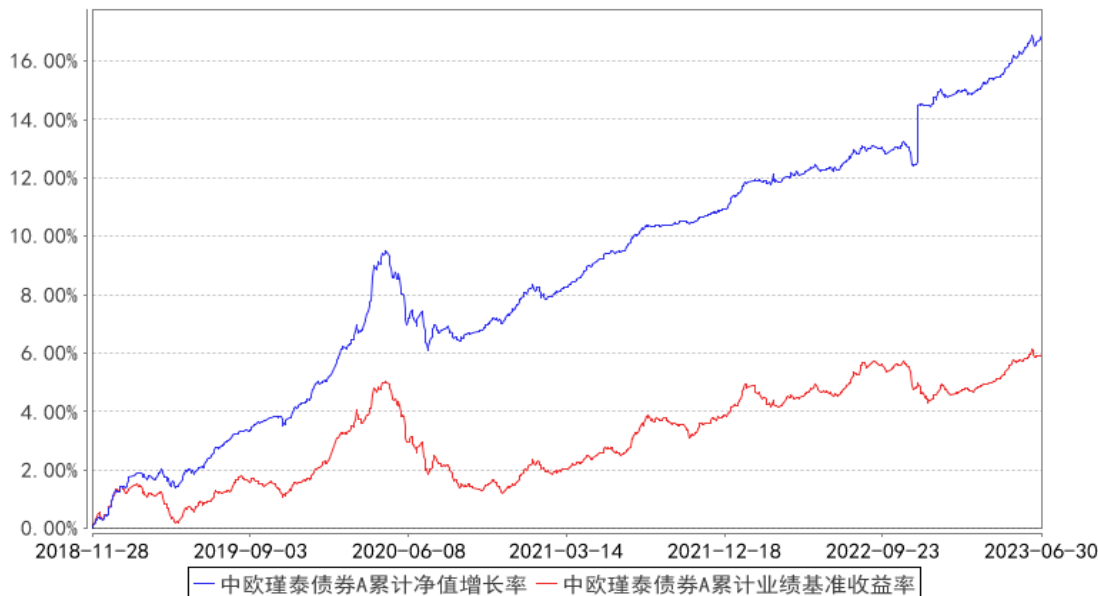
中欧瑾泰债券 C

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	0.39%	0.07%	0.18%	0.05%	0.21%	0.02%
过去三个月	1.26%	0.05%	0.94%	0.04%	0.32%	0.01%
过去六个月	1.65%	0.04%	1.22%	0.04%	0.43%	0.00%
过去一年	4.24%	0.13%	1.35%	0.05%	2.89%	0.08%
过去三年	8.70%	0.09%	2.99%	0.05%	5.71%	0.04%
自基金合同转型生效至今	16.65%	0.09%	5.97%	0.06%	10.68%	0.03%

效至今						
-----	--	--	--	--	--	--

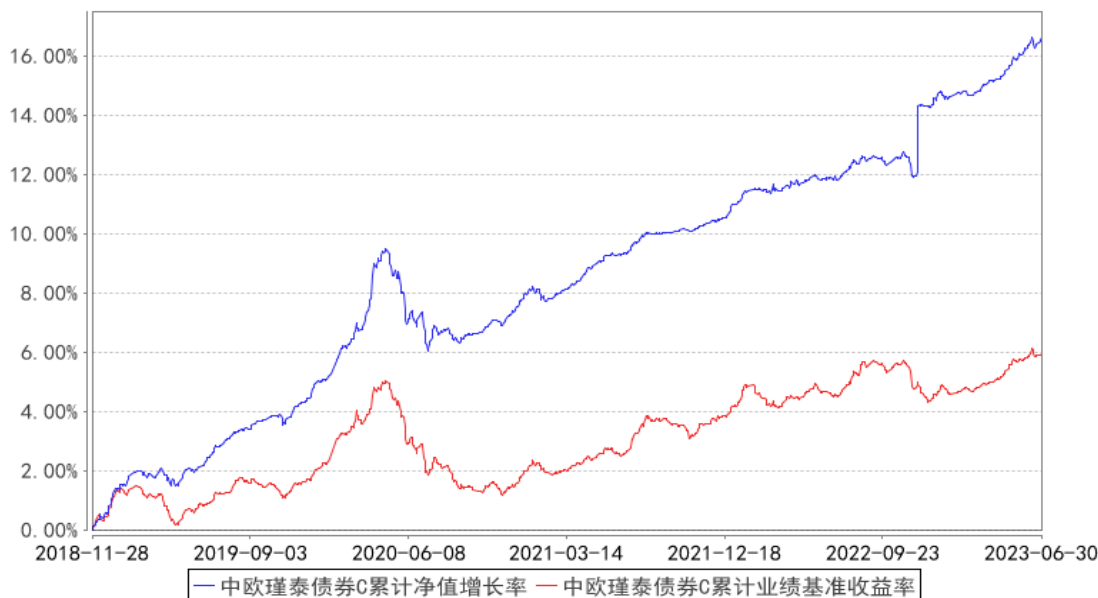
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧瑾泰债券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：自 2018 年 11 月 28 日起，原中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金转型为中欧瑾泰债券型证券投资基金。图示为 2018 年 11 月 28 日至 2023 年 06 月 30 日。

中欧瑾泰债券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：自 2018 年 11 月 28 日起，原中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金转型为中欧瑾泰债券型证券投资基金。图示为 2018 年 11 月 28 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		
LI TONG	固收投决会委员 / 联席投资总监 / 固收研究总监 / 基金经理	2022-11-30	-	24 年	历任怡和证券公司亚洲投资银行部，雷曼兄弟公司股票分析师，里昂证券高级股票分析师，比利时 KBC 证券公司高级股票分析师，苏格兰皇家银行首席亚洲金融债策略师，太平洋投资管理有限公司信用研究部高级副总裁，霸菱资产管理公司新兴市场债券部董事总经理。2019-10-08 加入中欧基金管理有限公司，历任固收海外投资总监。
余罗畅	基金经理	2021-11-24	2023-05-26	9 年	历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司评级分析师，申万菱信基金管理有限公司信用研究员。2017-07-10 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
孙甜	基金经理	2021-11-24	2023-04-10	14 年	历任长江养老保险股份有限公司投资助理、投资经理，海通证券股份有限公司投资经理，上海海通证券资产管理有限公司投资经理。2014-08-18 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理。
苏佳	基金经理助理	2023-06-21	-	6 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。
蔡熠阳	基金经理助理	2022-10-17	-	6 年	2017-06-19 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。

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、因个人原因，蔡熠阳自 2023 年 7 月 7 日起不再担任该基金的基金经理助理。

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 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

上半年股市先涨后跌、债市先跌后涨，二季度主要大类资产进入加速反映经济预期走弱的阶段，但政治局会议后权益资产止跌反弹。基本面方面，二季度确认了经济短暂的反弹期结束，经济重回环比走弱趋势，地产、出口下行压力加大。最新政治局会议回应了经济面对的压力，在房地产、地方化债、活跃资本市场方面有针对性的给出了新提法，重新提振了市场预期，后续仍需观察一批政策落地的效果。货币政策在 6 月超预期降息，政治局会议表态加强逆周期调节，后续仍有继续放松的可能。

操作方面，报告期内，组合采取灵活的杠杆和久期策略，利用杠杆变动调整组合有效久期，

结合基本面预期变化和资金面影响因素等分析，在收益率较大幅波动的情况下进行波段交易，在净值上实现了较好的回报。

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 1.72%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%；基金 C 类份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济走势取决于政治局会议提到的几方面政策的落地和执行情况。目前来看，政治局会议对财政政策方面的总量性政策未有明确提及，更多是从防风险的角度提及地产、地方债务，经济增长动能难以有较快的明显转向。债市策略方面，短期需等待政策落地及效果，债市可能偏震荡，更重视信用债的票息价值；中长期仍然看好大类资产中债券的配置价值。信用债方面，经济下行压力尚未显著缓解，政策着力于托底不能排除局部风险的阶段性发生，相关行业的性价比需适当重估。货币政策有望继续维持宽松局面，仍有利于杠杆套息。

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规定的估值方法、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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧瑾泰债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中欧瑾泰债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：中欧瑾泰债券型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	409,881.41	561,332.58
结算备付金		-	65,628.33
存出保证金		61.15	878.43
交易性金融资产	6.4.7.2	708,453,476.13	727,237,163.57
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		708,453,476.13	727,237,163.57
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		257,066.16	100,399.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		709,120,484.85	727,965,402.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
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		115,045,501.53	71,015,129.57
应付清算款		-	-
应付赎回款		15,255.30	222,676.48
应付管理人报酬		177,063.17	80,865.99
应付托管费		59,021.04	26,955.33
应付销售服务费		246.96	202.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	164,438.09	147,801.83
负债合计		115,461,526.09	71,493,631.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	558,364,812.43	602,774,917.92
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	35,294,146.33	53,696,853.19
净资产合计		593,658,958.76	656,471,771.11
负债和净资产总计		709,120,484.85	727,965,402.48

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 558,364,812.43 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0633 元，基金份额总额 554,896,628.11 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0489 元，基金份额总额 3,468,184.32 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧瑾泰债券型证券投资基金

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
一、营业总收入		17,128,002.17	750,508.07
1. 利息收入		31,037.70	23,833.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,237.76	5,753.98
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		26,799.94	18,079.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,589,259.62	510,517.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,589,259.62	510,517.44
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	-	-
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	1,452,340.70	215,686.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	55,364.15	470.83
减：二、营业总支出		2,785,802.10	225,612.39
1. 管理人报酬		1,185,522.94	77,582.09
2. 托管费		395,174.33	25,860.78
3. 销售服务费		1,268.10	297.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,096,828.68	36,755.73

其中：卖出回购金融资产支出		1,096,828.68	36,755.73
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	107,008.05	85,116.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,342,200.07	524,895.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,342,200.07	524,895.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,342,200.07	524,895.68

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧瑾泰债券型证券投资基金

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）	602,774,917.92	-	53,696,853.19	656,471,771.11
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）	602,774,917.92	-	53,696,853.19	656,471,771.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,410,105.49	-	-18,402,706.86	-62,812,812.35
（一）、综合收益总额	-	-	14,342,200.07	14,342,200.07
（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）	-44,410,105.49	-	3,878,023.68	-40,532,081.81
其中：1. 基金申购款	279,611,366.92	-	24,999,665.35	304,611,032.27
2. 基金赎回	-324,021,472.4	-	-21,121,641.67	-345,143,114.08

回款	1			
(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)	-	-	-36,622,930.61	-36,622,930.61
(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)	558,364,812.43	-	35,294,146.33	593,658,958.76
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)	49,026,399.79	-	2,701,221.79	51,727,621.58
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)	49,026,399.79	-	2,701,221.79	51,727,621.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	141,124,634.50	-	9,583,414.96	150,708,049.46
(一)、综合收益总额	-	-	524,895.68	524,895.68
(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)	141,124,634.50	-	9,058,519.28	150,183,153.78
其中: 1. 基金申购款	141,943,517.76	-	9,102,375.55	151,045,893.31
2. 基金赎回款	-818,883.26	-	-43,856.27	-862,739.53
(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)	-	-	-	-

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)	190,151,034.29	-	12,284,636.75	202,435,671.04

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：

<u>刘建平</u>	<u>杨毅</u>	<u>王音然</u>
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

中欧瑾泰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金转型而来。中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 10 月 30 日至 2018 年 11 月 23 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于修改中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,同意将中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金转型为中欧瑾泰债券型证券投资基金。根据《关于中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,自 2018 年 11 月 28 日起,中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金正式转型并更名为中欧瑾泰债券型证券投资基金。自同日起,《中欧瑾泰债券型证券投资基金基金合同》生效,原《中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。与此同时,中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同失效前的基金资产净值 22,349,705.97 元,于本基金基金合同生效时全部转为本基金的期初基金资产净值。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中欧瑾泰债券型证券投资基金基金合同》和《中欧瑾泰债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,各类别基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧瑾泰债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 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净值变动情况。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的比例计算缴纳。

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	409,881.41
等于：本金	409,855.41
加：应计利息	26.00
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	409,881.41

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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	695,278,741.50	9,786,476.13	708,453,476.13	3,388,258.50
	合计	695,278,741.50	9,786,476.13	708,453,476.13	3,388,258.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		695,278,741.50	9,786,476.13	708,453,476.13	3,388,258.50

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	30,135.53
其中：交易所市场	-
银行间市场	30,135.53
应付利息	-

预提费用-审计费	74,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	164,438.09

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧瑾泰债券 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	600,629,841.86	600,629,841.86
本期申购	275,919,442.05	275,919,442.05
本期赎回（以“-”号填列）	-321,652,655.80	-321,652,655.80
本期末	554,896,628.11	554,896,628.11

中欧瑾泰债券 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	2,145,076.06	2,145,076.06
本期申购	3,691,924.87	3,691,924.87
本期赎回（以“-”号填列）	-2,368,816.61	-2,368,816.61
本期末	3,468,184.32	3,468,184.32

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

中欧瑾泰债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,076,360.38	-27,541,592.73	53,534,767.65
本期利润	12,848,233.20	1,455,278.73	14,303,511.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,791,224.91	1,019,017.92	3,810,242.83
其中：基金申购款	38,220,918.56	-13,450,701.07	24,770,217.49
基金赎回款	-35,429,693.65	14,469,718.99	-20,959,974.66
本期已分配利润	-36,524,090.76	-	-36,524,090.76
本期末	60,191,727.73	-25,067,296.08	35,124,431.65

中欧瑾泰债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	260,854.46	-98,768.92	162,085.54
本期利润	41,626.17	-2,938.03	38,688.14
本期基金份额交易产生的变动数	123,445.66	-55,664.81	67,780.85
其中：基金申购款	400,180.28	-170,732.42	229,447.86
基金赎回款	-276,734.62	115,067.61	-161,667.01

本期已分配利润	-98,839.85	-	-98,839.85
本期末	327,086.44	-157,371.76	169,714.68

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	4,201.74	
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	30.82	
其他	5.20	
合计	4,237.76	

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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	12,555,450.32	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,033,809.30	
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	15,589,259.62	

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	1,555,290,364.22	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,533,324,000.70	
减：应计利息总额	18,908,154.22	
减：交易费用	24,400.00	
买卖债券差价收入	3,033,809.30	

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

无。

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	1,452,340.70
股票投资	-
债券投资	1,452,340.70
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	1,452,340.70

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	52,340.82
基金转换费收入	3,023.33
合计	55,364.15

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,105.49
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	107,008.05

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
自然人股东	基金管理人的股东
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

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

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

无。

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	1,185,522.94	77,582.09
其中：支付销售机构的客户维护费	176,806.86	476.62

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	395,174.33	25,860.78

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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		
	中欧瑾泰债券 A	中欧瑾泰债券 C	合计
国都证券	-	53.83	53.83
中欧财富	-	20.88	20.88
中欧基金	-	75.35	75.35
合计	-	150.06	150.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧瑾泰债券 A	中欧瑾泰债券 C	合计
国都证券	-	52.44	52.44
中欧基金	-	21.68	21.68
合计	-	74.12	74.12

注：本基金 A 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 0.10%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

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，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。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

中欧瑾泰债券 A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	1,074,950.34	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	140,162.97
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,074,950.34	140,162.97
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.19%	0.07%

中欧瑾泰债券 C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	143,102.46	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	143,102.46
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	143,102.46	143,102.46
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.13%	24.23%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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

中欧瑾泰债券 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
浦发银行	553,146,492.12	99.68%	276,573,246.06	46.05%
自然人股东	4,645.23	0.00%	4,616.87	0.00%

份额单位：份

中欧瑾泰债券 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
浦发银行	0.00	0.00%	0.00	0.00%
自然人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注：1、截止本报告期末，本基金的自然人股东持有 A 类基金的份额占 A 类基金总份额的比例为 0.0008%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

2、截止上年度末，本基金的自然人股东持有 A 类基金的份额占 A 类基金总份额的比例为 0.0008%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	409,881.41	4,201.74	5,310,936.11	2,810.95

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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

单位：人民币元

中欧瑾泰债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 3 月 13 日	-	2023 年 3 月 13 日	0.2200	18,260, 711.32	1,068.19	18,261, 779.51	-
2	2023 年 5 月 29 日	-	2023 年 5 月 29 日	0.2200	18,261, 297.26	1,013.99	18,262, 311.25	-
合计	-	-	-	0.4400	36,522, 008.58	2,082.18	36,524, 090.76	-
中欧瑾泰债券 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 3 月 13 日	-	2023 年 3 月 13 日	0.2200	40,907. 60	5,906.64	46,814. 24	-
2	2023 年 5 月 29 日	-	2023 年 5 月 29 日	0.2200	45,272. 04	6,753.57	52,025. 61	-
合计	-	-	-	0.4400	86,179. 64	12,660.2 1	98,839. 85	-

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截止本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金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 115,045,501.53 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200305	20 进出 05	2023 年 7 月 3 日	102.00	500,000	50,999,330.60
200408	20 农发 08	2023 年 7 月 3 日	105.00	438,000	45,988,260.00
210402	21 农发 02	2023 年 7 月 3 日	101.75	500,000	50,872,950.82
合计				1,438,000	147,860,541.42

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

本基金属于债券型基金，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。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。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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之内。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	74,253,703.29
合计	-	74,253,703.29

注：本期末基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	708,453,476.13	652,983,460.28
合计	708,453,476.13	652,983,460.28

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

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公司的证券不得超过该证券的 10%。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同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，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。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

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	409,881.41	-	-	-	409,881.41
存出保证金	61.15	-	-	-	61.15
交易性金融资产	50,872,950.82	544,370,448.32	113,210,076.99	-	708,453,476.13
应收申购款	-	-	-	257,066.16	257,066.16
资产总计	51,282,893.38	544,370,448.32	113,210,076.99	257,066.16	709,120,484.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,255.30	15,255.30
应付管理人报酬	-	-	-	177,063.17	177,063.17
应付托管费	-	-	-	59,021.04	59,021.04
卖出回购金融资产款	115,045,501.53	-	-	-	115,045,501.53
应付销售服务费	-	-	-	246.96	246.96
其他负债	-	-	-	164,438.09	164,438.09
负债总计	115,045,501.53	-	-	416,024.56	115,461,526.09
利率敏感度缺口	-63,762,608.15	544,370,448.32	113,210,076.99	-158,958.40	593,658,958.76
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
资产					
银行存款	561,332.58	-	-	-	561,332.58
结算备付金	65,628.33	-	-	-	65,628.33
存出保证金	878.43	-	-	-	878.43
交易性金融资产	125,117,812.88	582,396,621.92	19,722,728.77	-	727,237,163.57
应收申购款	-	-	-	100,399.57	100,399.57
资产总计	125,745,652.22	582,396,621.92	19,722,728.77	100,399.57	727,965,402.48
负债					
卖出回购金融资产款	71,015,129.57	-	-	-	71,015,129.57
应付赎回款	-	-	-	222,676.48	222,676.48
应付管理人报酬	-	-	-	80,865.99	80,865.99
应付托管费	-	-	-	26,955.33	26,955.33
应付销售服务费	-	-	-	202.17	202.17
其他负债	-	-	-	147,801.83	147,801.83
负债总计	71,015,129.57	-	-	478,501.80	71,493,631.37
利率敏感度缺口	54,730,522.65	582,396,621.92	19,722,728.77	-378,102.23	656,471,771.11

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

假设	除市场利率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）
	利率上升 25BP	-5,104,075.66	-2,812,067.14
利率下降 25BP	5,246,079.82	2,843,090.34	

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

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 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	-	-
第二层次	708,453,476.13	727,237,163.57
第三层次	-	-
合计	708,453,476.13	727,237,163.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	708,453,476.13	99.91
	其中：债券	708,453,476.13	99.91
	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	409,881.41	0.06
8	其他各项资产	257,127.31	0.04
9	合计	709,120,484.85	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无买入及卖出股票的情况。

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	708,453,476.13	119.34
	其中：政策性金融债	708,453,476.13	119.34
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	708,453,476.13	119.34

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	220412	22 农发 12	1,000,000	102,050,136.99	17.19
2	200408	20 农发 08	800,000	83,996,821.92	14.15
3	230404	23 农发 04	800,000	81,284,153.01	13.69
4	230203	23 国开 03	600,000	61,283,391.78	10.32
5	190210	19 国开 10	500,000	52,674,439.89	8.87

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收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

截止本报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

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	61.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	257,066.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,127.31

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
中欧瑾泰债券 A	360	1,541,379.52	554,221,442.45	99.88%	675,185.66	0.12%
中欧瑾泰债券 C	490	7,077.93	143,102.46	4.13%	3,325,081.86	95.87%
合计	850	656,899.78	554,364,544.91	99.28%	4,000,267.52	0.72%

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	中欧瑾泰债券 A	7,556.28	0.00%
	中欧瑾泰债券 C	226.18	0.01%

	合计	7,782.46	0.00%
--	----	----------	-------

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员持有本基金 A 类份额的实际比例为 0.0014%，持有本基金总份额的实际比例为 0.0014%，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	中欧瑾泰债券 A	0~10
	中欧瑾泰债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧瑾泰债券 A	0
	中欧瑾泰债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧瑾泰债券 A	中欧瑾泰债券 C
基金合同生效日 （2018 年 11 月 28 日）基金份额总额	265,450.31	21,537,773.40
本报告期期初基金份 额总额	600,629,841.86	2,145,076.06
本报告期基金总申购 份额	275,919,442.05	3,691,924.87
减：本报告期基金总 赎回份额	321,652,655.80	2,368,816.61
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	554,896,628.11	3,468,184.32

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-

申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	本报告 期新增 1个
中信证券	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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	中欧瑾泰债券型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	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
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	中欧瑾泰债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证监会指定媒介	2023-03-07
5	中欧瑾泰债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2023-03-10
6	中欧瑾泰债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-03-10
7	中欧瑾泰债券型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
8	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
9	中欧瑾泰债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2023-04-10
10	中欧瑾泰债券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	2023-04-12
11	中欧瑾泰债券型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2023-04-12
12	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
13	中欧瑾泰债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
14	中欧瑾泰债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证监会指定媒介	2023-05-22
15	中欧瑾泰债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2023-05-25
16	中欧瑾泰债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2023-05-26
17	中欧瑾泰债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2023-05-27
18	中欧瑾泰债券型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 5 月）	中国证监会指定媒介	2023-05-31
19	中欧瑾泰债券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	2023-05-31

20	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
21	中欧瑾泰债券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

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	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	276,573,246.06	0.00	0.00	276,573,246.06	49.53%
	2	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	184,381,856.73	0.00	0.00	184,381,856.73	33.02%
	3	2023 年 02 月 15 日至 2023 年 06 月 12 日	0.00	275,278,950.27	275,278,950.27	0.00	0.00%

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份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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、中国证监会准予中欧瑾泰债券型证券投资基金变更注册的文件
- 2、《中欧瑾泰债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧瑾泰债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧瑾泰债券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)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