

中欧颐利债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 11 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 10 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 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧颐利债券	
基金主代码	016850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 25 日	
报告期末基金份额总额	395,662,180.84 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	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	中债新综合财富指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*3%	
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
下属分级基金的交易代码	016850	016851
报告期末下属分级基金的份额总额	388,101,915.11 份	7,560,265.73 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 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
1. 本期已实现收益	3,796,175.20	32,396.43
2. 本期利润	3,220,563.73	-24,897.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114	-0.0084
4. 期末基金资产净值	399,511,277.20	7,733,151.97
5. 期末基金份额净值	1.0294	1.0229

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

中欧颐利债券 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	1.31%	0.14%	1.55%	0.09%	-0.24%	0.05%
过去六个月	2.78%	0.15%	3.62%	0.11%	-0.84%	0.04%
过去一年	3.12%	0.13%	3.98%	0.11%	-0.86%	0.02%
自基金合同生效起至今	2.94%	0.14%	6.83%	0.11%	-3.89%	0.03%

中欧颐利债券 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	1.22%	0.14%	1.55%	0.09%	-0.33%	0.05%

过去六个月	2.59%	0.15%	3.62%	0.11%	-1.03%	0.04%
过去一年	2.72%	0.13%	3.98%	0.11%	-1.26%	0.02%
自基金合同生效起至今	2.29%	0.14%	6.83%	0.11%	-4.54%	0.03%

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		
刘勇	基金经理	2023-08-14	-	8 年	历任中铁资源集团商贸有限公司大宗商品部期货投资, 太平洋证券股份有限公司信用业务部证券研究及管理, 幸福人寿保险股份有限公司高级研究员、研究所总经理助理、股票投资部总经理助理。 2023-06-21 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 3 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，股票市场延续波动，前半段，随着新“国九条”的推出、地产政策预期的强化，指数延续一季度的反弹之势，虽区间震荡，但整体仍维持震荡修复的节奏。从 5 月下旬开始，指数达到本轮高点，部分数据不及预期叠加地产新政的效果尚在等待验证，市场走出兑现行情，部分微盘股下跌幅度较大，市场开始缩量调整。市场表现分化，公用事业、银行、煤炭等红利方向涨幅靠前，电子在成长股中领涨，但市场整体表现仍是价值优于成长。债券市场延续收益率下行趋势，取消手工补息后理财规模扩容，资金分层的情况大幅改善，同时央行对于长久期利率债下行区间管控，债券市场信用利差大幅压缩，长久期低等级品种表现最强。

报告期内，组合持股仍然追求确定性，配置策略以稳定商业模式和优质现金流的高股息资产为主，具体来看，以公用事业等作为底仓配置，积极寻找股息率有预期差的一些方向，组合的主要策略为红利增长策略，选股除了股息率的要求之外，还会考虑分红和业绩增长，当红利资产盈利出现分化时，红利增长策略可能具备更高的弹性，或能获取更多超额收益，基于红利行业的估值性价比较，增加了出版等行业的配置。同时保持了有色金属、煤炭为主的供给端受限的上游资源品的配置，资源股仍旧是顺周期品种中的优秀选择，由于多年资本开支的下滑，产能受限导致商品价格的弹性较大，是顺周期品种中攻守兼备的品种，在投资标的的选择上也将未来产能的增长和估值情况进行了考量。考虑到制造业景气度回升且在估值低位，叠加后续设备更新及耐用品以旧换新等政策的落地，增加工程机械等传统制造业的投资比重。债券资产上，维持中性久期配置，积极把握利率债的波段操作机会，延续高等级债券配置思路，努力保证组合的流动性。

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 1.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%；基金 C 类份额净值增长率为 1.22%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%。

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	50,490,863.05	10.87
	其中：股票	50,490,863.05	10.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	413,010,848.77	88.89

	其中：债券	413,010,848.77	88.89
	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	1,040,661.49	0.22
8	其他资产	82,461.97	0.02
9	合计	464,624,835.28	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 8,943,199.00 元，占基金资产净值比例 2.20%。

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	1,572,760.00	0.39
B	采矿业	4,463,146.00	1.10
C	制造业	15,183,883.65	3.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,567,384.00	2.59
E	建筑业	305,092.00	0.07
F	批发和零售业	1,111,392.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,151,818.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	348,163.00	0.09
J	金融业	1,555,334.00	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	240,217.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	176,236.20	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	132,444.00	0.03
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	4,739,794.20	1.16
S	综合	-	-
	合计	41,547,664.05	10.20

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	263,190.00	0.06
消费者非必需品	694,885.00	0.17
消费者常用品	1,046,100.00	0.26
能源	109,600.00	0.03
金融	602,790.00	0.15
医疗保健	1,201,791.00	0.30
工业	3,240,383.00	0.80
信息技术	704,200.00	0.17
电信服务	679,760.00	0.17
公用事业	-	-
地产业	400,500.00	0.10
合计	8,943,199.00	2.20

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	000425	徐工机械	376,953	2,695,213.95	0.66
2	600988	赤峰黄金	137,800	2,251,652.00	0.55
3	601801	皖新传媒	290,600	2,013,858.00	0.49
4	600011	华能国际	198,200	1,906,684.00	0.47
5	603025	大豪科技	133,700	1,847,734.00	0.45
6	603477	巨星农牧	54,800	1,572,760.00	0.39
7	002034	旺能环境	114,600	1,490,946.00	0.37
8	600483	福能股份	125,200	1,459,832.00	0.36
9	603558	健盛集团	142,300	1,415,885.00	0.35
10	601991	大唐发电	406,900	1,224,769.00	0.30

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	21,008,527.86	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,091,490.86	36.61
	其中：政策性金融债	40,972,780.82	10.06
4	企业债券	64,369,392.33	15.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	172,042,126.78	42.25
7	可转债（可交换债）	6,499,310.94	1.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	413,010,848.77	101.42

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	230208	23 国开 08	200,000	20,439,090.41	5.02
2	232380066	23 中行二级资本 债 03A	100,000	10,735,931.15	2.64
3	240109	23 华泰 Y2	100,000	10,681,303.01	2.62
4	272380015	23 新华人寿资本 补充债 01	100,000	10,676,874.32	2.62
5	2128030	21 交通银行二级	100,000	10,616,792.35	2.61

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。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。

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持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，交通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的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、央行的处罚。新华人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行北京市分行、国家金融监督管理总局的处罚。华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行江苏省分行、国家外汇管理局江苏省分局的处罚。广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会、央行广东省分行的处罚。

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	41,473.06
2	应收证券清算款	528.00
3	应收股利	40,440.91
4	应收利息	-
5	应收申购款	20.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	82,461.97

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	127084	柳工转 2	136,048.79	0.03
2	111002	特纸转债	123,478.49	0.03
3	127053	豪美转债	123,475.35	0.03
4	113628	晨丰转债	117,579.27	0.03
5	123178	花园转债	92,848.66	0.02
6	127095	广泰转债	92,124.08	0.02

7	113651	松霖转债	91,573.42	0.02
8	128087	孚日转债	90,825.74	0.02
9	127035	濮耐转债	90,824.20	0.02
10	113069	博 23 转债	90,810.42	0.02
11	113658	密卫转债	90,150.96	0.02
12	123184	天阳转债	89,710.32	0.02
13	113673	岱美转债	89,063.15	0.02
14	111015	东亚转债	88,961.18	0.02
15	127075	百川转 2	88,739.52	0.02
16	123194	百洋转债	87,745.85	0.02
17	113042	上银转债	81,844.92	0.02
18	113056	重银转债	81,344.38	0.02
19	127067	恒逸转 2	81,278.77	0.02
20	113037	紫银转债	81,254.37	0.02
21	128129	青农转债	79,819.01	0.02
22	127059	永东转 2	79,810.58	0.02
23	123205	大叶转债	74,763.73	0.02
24	113545	金能转债	73,423.51	0.02
25	113662	豪能转债	72,703.65	0.02
26	113532	海环转债	72,399.94	0.02
27	128066	亚泰转债	72,212.68	0.02
28	118046	诺泰转债	72,172.15	0.02
29	123222	博俊转债	71,994.86	0.02
30	111011	冠盛转债	70,973.20	0.02
31	113638	台 21 转债	67,255.97	0.02
32	123218	宏昌转债	62,447.60	0.02
33	123201	纽泰转债	61,537.21	0.02
34	123223	九典转 02	60,370.41	0.01
35	111013	新港转债	59,438.01	0.01
36	128105	长集转债	55,462.02	0.01
37	123190	道氏转 02	55,381.89	0.01
38	127078	优彩转债	53,573.62	0.01
39	118022	锂科转债	53,572.44	0.01
40	123228	震裕转债	53,447.39	0.01
41	111005	富春转债	53,443.77	0.01
42	127060	湘佳转债	53,416.80	0.01
43	123216	科顺转债	53,405.88	0.01
44	113652	伟 22 转债	53,162.45	0.01
45	113068	金铜转债	53,130.32	0.01
46	113046	金田转债	53,107.35	0.01
47	113657	再 22 转债	53,021.93	0.01
48	127068	顺博转债	52,950.02	0.01

49	113050	南银转债	52,673.07	0.01
50	113047	旗滨转债	52,632.92	0.01
51	113065	齐鲁转债	52,438.90	0.01
52	110084	贵燃转债	52,347.45	0.01
53	123121	帝尔转债	52,211.51	0.01
54	123179	立高转债	52,122.87	0.01
55	118028	会通转债	51,874.58	0.01
56	118043	福立转债	51,775.70	0.01
57	127034	绿茵转债	51,730.03	0.01
58	118013	道通转债	51,391.05	0.01
59	113059	福莱转债	51,269.79	0.01
60	113584	家悦转债	49,915.21	0.01
61	113632	鹤 21 转债	49,562.24	0.01
62	113653	永 22 转债	49,461.36	0.01
63	127077	华宏转债	49,126.35	0.01
64	113606	荣泰转债	49,025.76	0.01
65	113661	福 22 转债	48,923.44	0.01
66	111004	明新转债	48,881.36	0.01
67	110076	华海转债	48,871.05	0.01
68	123117	健帆转债	48,781.91	0.01
69	123133	佩蒂转债	48,589.41	0.01
70	113530	大丰转债	48,563.34	0.01
71	128130	景兴转债	48,527.75	0.01
72	110059	浦发转债	48,521.16	0.01
73	127070	大中转债	48,338.38	0.01
74	128135	洽洽转债	47,680.53	0.01
75	118030	睿创转债	47,605.54	0.01
76	127042	嘉美转债	47,526.53	0.01
77	128116	瑞达转债	46,379.66	0.01
78	111012	福新转债	45,796.41	0.01
79	123061	航新转债	45,538.12	0.01
80	123127	耐普转债	45,003.21	0.01
81	128138	侨银转债	44,542.17	0.01
82	113527	维格转债	44,253.19	0.01
83	113546	迪贝转债	43,206.99	0.01
84	128071	合兴转债	42,220.82	0.01
85	123209	聚隆转债	42,090.74	0.01
86	113669	景 23 转债	39,697.93	0.01
87	123191	智尚转债	38,845.40	0.01
88	128128	齐翔转 2	38,209.24	0.01
89	123220	易瑞转债	38,038.96	0.01
90	127092	运机转债	37,817.53	0.01

91	113672	福蓉转债	37,746.47	0.01
92	127032	苏行转债	37,710.90	0.01
93	113602	景 20 转债	37,290.37	0.01
94	123204	金丹转债	37,281.52	0.01
95	123170	南电转债	37,120.58	0.01
96	128117	道恩转债	36,632.22	0.01
97	123219	宇瞳转债	36,604.68	0.01
98	113648	巨星转债	36,455.12	0.01
99	123226	中富转债	36,196.47	0.01
100	123180	浙矿转债	34,422.27	0.01
101	123087	明电转债	29,943.92	0.01
102	123203	明电转 02	29,922.70	0.01
103	128090	汽模转 2	27,439.88	0.01
104	123048	应急转债	26,530.57	0.01
105	123130	设研转债	26,483.27	0.01
106	123089	九洲转 2	26,186.25	0.01
107	123227	雅创转债	26,123.37	0.01
108	110060	天路转债	26,044.10	0.01
109	113674	华设转债	25,715.37	0.01
110	123206	开能转债	19,194.80	0.00
111	123143	胜蓝转债	18,900.23	0.00
112	123177	测绘转债	18,630.91	0.00
113	123152	润禾转债	18,488.59	0.00
114	110052	贵广转债	18,065.85	0.00

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	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
报告期期初基金份额总额	262,161,071.21	212,179.30
报告期期间基金总申购份额	125,940,985.38	7,357,933.04
减:报告期期间基金总赎回份额	141.48	9,846.61
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	388,101,915.11	7,560,265.73
-------------	----------------	--------------

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	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	35,555,666.50	150,015.00
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	35,555,666.50	150,015.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	9.16	1.98

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 04 月 01 日至 2024 年 06 月 23 日	70,284,545.73	0.00	0.00	70,284,545.73	17.76%
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、中欧颐利债券型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧颐利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧颐利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧颐利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

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) 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 07 月 11 日