

# 中欧颐利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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	770,962,046.97 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	764,522,902.15 份	6,439,144.82 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）	
	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
1. 本期已实现收益	1, 523, 673. 75	19, 248. 06
2. 本期利润	7, 281, 586. 13	76, 717. 06
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0181	0. 0115
4. 期末基金资产净值	796, 936, 277. 09	6, 662, 850. 97
5. 期末基金份额净值	1. 0424	1. 0347

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. 26%	0. 13%	2. 77%	0. 16%	-1. 51%	-0. 03%
过去六个月	2. 59%	0. 13%	4. 36%	0. 13%	-1. 77%	0. 00%
过去一年	4. 82%	0. 13%	6. 87%	0. 13%	-2. 05%	0. 00%
自基金合同 生效起至今	4. 24%	0. 14%	9. 79%	0. 12%	-5. 55%	0. 02%

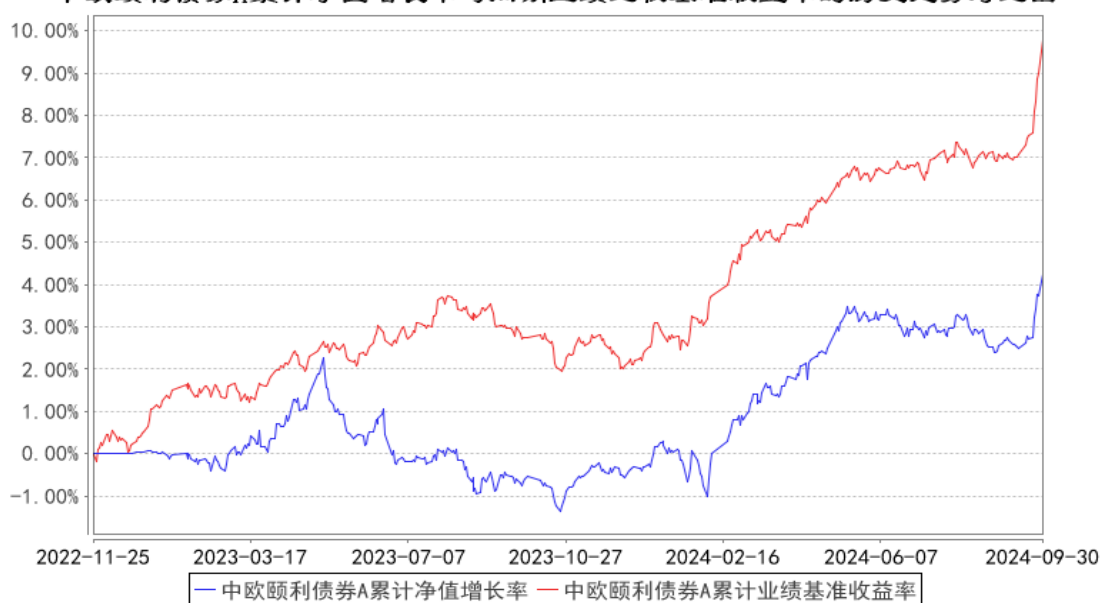
中欧颐利债券 C

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. 15%	0. 13%	2. 77%	0. 16%	-1. 62%	-0. 03%

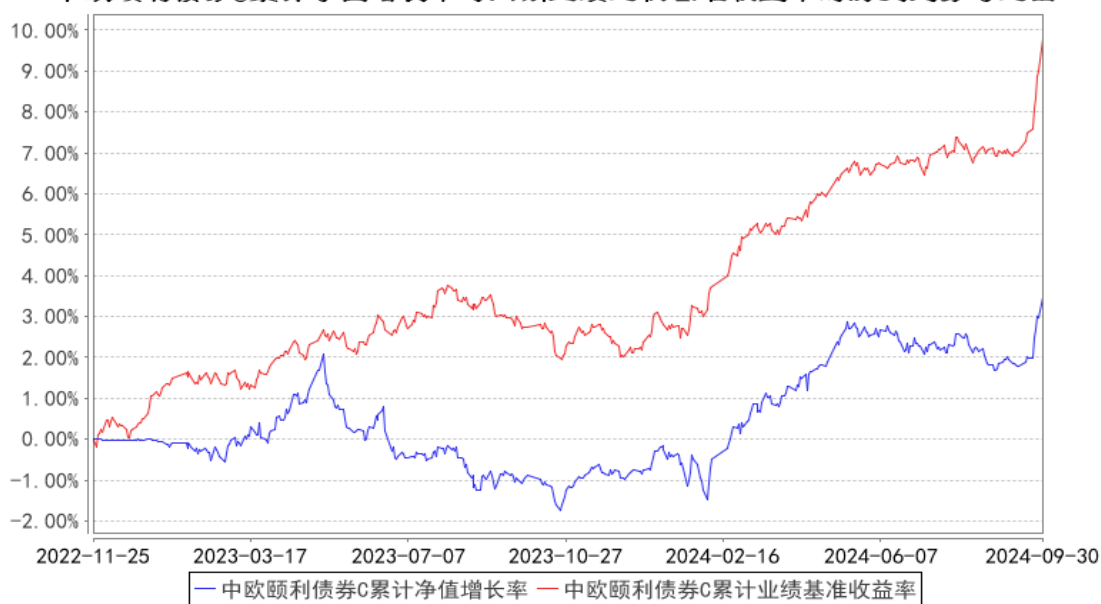
过去六个月	2.38%	0.13%	4.36%	0.13%	-1.98%	0.00%
过去一年	4.40%	0.13%	6.87%	0.13%	-2.47%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.47%	0.14%	9.79%	0.12%	-6.32%	0.02%

### 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

中欧颐利债券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



中欧颐利债券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



## § 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 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，股票市场先抑后扬，由于经济数据的不及预期，市场调整一直延续到 9 月下旬，随着一揽子增量政策的推出和落地，经济持续回升的预期向好，市场的信心在 9 月末快速抬升，随着成交量的快速放大，最后一周连续上演逼空行情，之前的超跌板块也得以快速反弹，市场走出低位区间，非银金融（申万一级行业）领涨三季度，涨幅 41.67%。债券市场受央行政策影响较大，波动性大幅增加，受央行意外降息影响，机构抢筹情绪高涨，10 年国债收益率在 8 月初一度下破 2.10%。随后央行逐步公布丰富货币政策工具箱的具体内容，包括设立临时正逆回购机制、开展公开市场国债买卖等操作。此外，大行连续抛售中长期国债、交易商协会调查国债违规交易，债券收益率低位大幅反弹。政策影响下，机构观望情绪浓厚，活跃利率品种流动性大幅减弱。理财预防性赎回、基金为应对可能的流动性压力大幅抛售债券引发赎回负反馈，信用债更是面临流动性枯竭，回调压力更甚。9 月份以来，在资金面转松的帮助下，市场逐渐回归理性。受央行买短卖长的操作，曲线陡峭性下行。直至 9 月末一揽子增量政策的公布，债券市场再次面临强烈回调压力。

报告期内，股票组合坚持稳健红利类资产、顺周期资产、科技制造和消费等重点行业的均衡配置。在逆周期调节的政策发力之前，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，一揽子增量政策的推出之后，组合增加了顺周期类资产的配置比例，增加了上游资源品、低估值建筑央企和非银金融等行业的配置权重；因为交易量的放大或会带动股票市场风险偏好的提升，组合也提升了科技股和消费股的配置权重。央行推出新的互换便利工具或对高股息股票形成增量资金支持，同时证监会推出《上市公司市值管理指引》后，也有利于长期破净的低估值蓝筹股制定市值管理计划，所以红利的底仓配置不会改变，组合利用红利增长策略，积极寻找股息率有预期差的一些方向，选股除了股息率的要求之外，还会考虑分红和业绩增长。稳健类资产中增加有估值性价比的燃气、固废处理等行业的配置比重，也重点关注因中报不及预期而调整比较充分的高速公路、电信运营商等行业。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 1.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.77%；基金 C 类份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为 2.77%。

#### 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	78,965,486.66	9.11
	其中：股票	78,965,486.66	9.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	631,011,474.49	72.83
	其中：债券	631,011,474.49	72.83
	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	130,125,467.37	15.02
	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	26,143,167.90	3.02
8	其他资产	138,898.53	0.02
9	合计	866,384,494.95	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 14,862,563.00 元，占基金资产净值比例 1.85%。

### 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	3,563,580.00	0.44
B	采矿业	6,464,899.00	0.80
C	制造业	21,651,537.07	2.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,247,280.00	1.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	780,372.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	3,018,025.80	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,104,250.19	0.39
J	金融业	5,464,572.00	0.68
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	257,830.00	0.03

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	479,484.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,071,093.60	1.00
S	综合	-	-
	合计	64,102,923.66	7.98

### 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	456,640.00	0.06
消费者非必需品	1,048,840.00	0.13
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	2,418,798.00	0.30
医疗保健	290,485.00	0.04
工业	5,345,180.00	0.67
信息技术	225,600.00	0.03
电信服务	3,576,256.00	0.45
公用事业	1,500,764.00	0.19
地产业	-	-
合计	14,862,563.00	1.85

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	002034	旺能环境	262,410	4,146,078.00	0.52
2	000719	中原传媒	320,000	3,971,200.00	0.49
3	000425	徐工机械	495,653	3,851,223.81	0.48
4	00586	海螺创业	519,000	3,591,480.00	0.45
5	603558	健盛集团	295,800	3,168,018.00	0.39
6	600008	首创环保	862,800	2,821,356.00	0.35
7	601336	新华保险	57,400	2,664,508.00	0.33
8	603477	巨星农牧	122,600	2,648,160.00	0.33
9	002911	佛燃能源	227,300	2,609,404.00	0.32
10	601801	皖新传媒	331,900	2,509,164.00	0.31

### 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	12,365,643.84	1.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	286,040,083.15	35.59



	其中：政策性金融债	102,008,753.43	12.69
4	企业债券	80,537,701.90	10.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	238,480,099.57	29.68
7	可转债（可交换债）	13,587,946.03	1.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	631,011,474.49	78.52

### 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	232480004	24 农行二级资本债 01A	500,000	51,582,901.64	6.42
2	240210	24 国开 10	500,000	50,921,438.36	6.34
3	102480276	24 中海企业 MTN001A	220,000	22,535,958.47	2.80
4	272380004	23 农银人寿资本补充债 01	200,000	21,138,013.15	2.63
5	102481363	24 知识城 MTN001	200,000	20,344,990.68	2.53

### 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，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。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。中国农业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	99,979.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	38,919.53
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	138,898.53
---	----	------------

## 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	128141	旺能转债	738,543.20	0.09
2	113050	南银转债	330,601.66	0.04
3	123213	天源转债	316,543.02	0.04
4	128144	利民转债	308,766.62	0.04
5	113668	鹿山转债	291,166.62	0.04
6	123219	宇瞳转债	287,271.12	0.04
7	123208	孩王转债	209,284.85	0.03
8	127075	百川转 2	205,134.52	0.03
9	113632	鹤 21 转债	202,294.88	0.03
10	123194	百洋转债	200,636.22	0.02
11	113648	巨星转债	199,032.46	0.02
12	110079	杭银转债	198,223.00	0.02
13	127085	韵达转债	196,330.19	0.02
14	113623	凤 21 转债	193,406.67	0.02
15	113048	晶科转债	192,818.63	0.02
16	110076	华海转债	189,620.89	0.02
17	113059	福莱转债	188,993.21	0.02
18	111005	富春转债	182,648.44	0.02
19	118013	道通转债	181,437.10	0.02
20	128087	孚日转债	180,643.87	0.02
21	123225	翔丰转债	177,079.92	0.02
22	113629	泉峰转债	176,924.27	0.02
23	113640	苏利转债	176,918.61	0.02
24	128128	齐翔转 2	170,162.71	0.02
25	111017	蓝天转债	165,747.04	0.02
26	113637	华翔转债	164,973.96	0.02
27	111002	特纸转债	164,524.92	0.02
28	113638	台 21 转债	161,096.55	0.02
29	123221	力诺转债	160,066.82	0.02
30	113653	永 22 转债	157,347.92	0.02
31	123223	九典转 02	140,956.23	0.02
32	123089	九洲转 2	137,671.03	0.02
33	113069	博 23 转债	134,730.63	0.02
34	123185	能辉转债	132,200.90	0.02
35	123190	道氏转 02	131,939.24	0.02
36	113033	利群转债	130,258.69	0.02
37	127027	能化转债	129,775.25	0.02
38	113549	白电转债	124,799.52	0.02

39	113682	益丰转债	122,698.00	0.02
40	123228	震裕转债	120,541.64	0.02
41	123117	健帆转债	118,206.54	0.01
42	113644	艾迪转债	116,716.04	0.01
43	113658	密卫转债	116,197.23	0.01
44	113064	东材转债	116,094.56	0.01
45	127019	国城转债	114,992.52	0.01
46	118028	会通转债	114,696.62	0.01
47	127101	豪鹏转债	114,032.00	0.01
48	127077	华宏转债	113,914.38	0.01
49	127068	顺博转债	112,943.51	0.01
50	113636	甬金转债	111,976.76	0.01
51	123115	捷捷转债	111,727.92	0.01
52	118042	奥维转债	111,654.79	0.01
53	123179	立高转债	111,182.57	0.01
54	123192	科思转债	110,708.54	0.01
55	127015	希望转债	110,160.36	0.01
56	128119	龙大转债	109,943.52	0.01
57	128063	未来转债	109,785.35	0.01
58	123113	仙乐转债	108,552.47	0.01
59	113569	科达转债	107,440.35	0.01
60	113619	世运转债	107,253.80	0.01
61	113677	华懋转债	106,547.80	0.01
62	111016	神通转债	105,418.22	0.01
63	123204	金丹转债	105,336.12	0.01
64	113651	松霖转债	103,295.40	0.01
65	128132	交建转债	103,188.22	0.01
66	127054	双箭转债	102,897.70	0.01
67	113639	华正转债	101,078.83	0.01
68	118033	华特转债	100,102.37	0.01
69	123183	海顺转债	97,678.28	0.01
70	123133	佩蒂转债	97,008.24	0.01
71	127053	豪美转债	91,741.08	0.01
72	128130	景兴转债	91,419.13	0.01
73	113664	大元转债	90,603.39	0.01
74	123227	雅创转债	88,548.25	0.01
75	118039	煜邦转债	86,814.68	0.01
76	110087	天业转债	83,324.95	0.01
77	127095	广泰转债	82,139.18	0.01
78	110093	神马转债	80,195.13	0.01
79	127059	永东转 2	77,651.82	0.01
80	123220	易瑞转债	76,789.00	0.01

81	128117	道恩转债	73,160.28	0.01
82	128142	新乳转债	71,458.28	0.01
83	113681	镇洋转债	67,488.63	0.01
84	127076	中宠转 2	65,817.31	0.01
85	123103	震安转债	64,022.82	0.01
86	113657	再 22 转债	63,906.81	0.01
87	123022	长信转债	62,677.45	0.01
88	123206	开能转债	61,108.80	0.01
89	123205	大叶转债	60,581.25	0.01
90	113628	晨丰转债	59,621.92	0.01
91	127092	运机转债	58,679.56	0.01
92	123177	测绘转债	56,838.03	0.01
93	123159	崧盛转债	55,202.56	0.01
94	111011	冠盛转债	53,573.71	0.01
95	111013	新港转债	51,213.08	0.01
96	113647	禾丰转债	49,817.53	0.01
97	127060	湘佳转债	48,099.64	0.01
98	113662	豪能转债	44,539.84	0.01
99	110058	永鼎转债	39,170.06	0.00
100	123143	胜蓝转债	37,152.89	0.00
101	127045	牧原转债	35,858.01	0.00
102	123107	温氏转债	35,696.54	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	388,101,915.11	7,560,265.73
报告期期间基金总申购份额	413,623,495.67	2,407.44
减：报告期期间基金总赎回份额	37,202,508.63	1,123,528.35
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	764,522,902.15	6,439,144.82

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 (%)	4.65	2.33

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 09 月 27 日至 2024 年 09 月 30 日	0.00	346,920,111.79	0.00	346,920,111.79	45.00%
	2	2024 年 08 月 27 日至 2024 年 09 月 26 日	48,846,396.83	56,981,392.44	0.00	105,827,789.27	13.73%
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