

# 中欧鼎利债券型证券投资基金 2024 年中期报告

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：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧鼎利债券型证券投资基金		
基金简称	中欧鼎利债券		
基金主代码	166010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 9 月 18 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	652,929,394.07 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
下属分级基金的交易代码	166010	009520	009519
报告期末下属分级基金的份额总额	646,787,031.86 份	6,011,538.08 份	130,824.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。
投资策略	本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、证券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。 本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整大类资产的配置比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+中证可转换债券指数×25%+中债综合财富指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中信银行股份有限公司
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	95558
传真	021-33830351	010-85230024
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	窦玉明	方合英

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	A 类：中国证券登记结算有限责任公司 C 类、E 类：中欧基金管理有限公司	A 类：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类、E 类：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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
本期已实现收益	8,018,405.17	-98,828.07	-1,336.73
本期利润	12,079,465.48	-1,119,437.44	-121,438.70
加权平均基金份额本期利润	0.0178	-0.0633	-0.1084
本期加权平均净值利润率	1.59%	-5.36%	-9.02%
本期基金份额净值增长	0.38%	0.17%	0.54%

率			
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	191,977,393.71	381,456.25	11,175.56
期末可供分配基金份额利润	0.2968	0.0635	0.0854
期末基金资产净值	724,658,234.92	7,148,146.61	158,445.34
期末基金份额净值	1.1204	1.1891	1.2111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	22.94%	7.77%	9.75%

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、上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

中欧鼎利债券 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	-1.07%	0.40%	-0.80%	0.21%	-0.27%	0.19%
过去三个月	-0.15%	0.43%	0.76%	0.21%	-0.91%	0.22%
过去六个月	0.38%	0.40%	2.05%	0.25%	-1.67%	0.15%
过去一年	-7.40%	0.42%	0.73%	0.23%	-8.13%	0.19%

过去三年	-8.60%	0.59%	3.94%	0.27%	-12.54%	0.32%
自基金合同生效起至今	22.94%	0.53%	21.15%	0.24%	1.79%	0.29%

注：本基金业绩比较基准为：中国债券总指数\*90%+沪深 300 指数\*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧鼎利债券 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	-1.10%	0.40%	-0.80%	0.21%	-0.30%	0.19%
过去三个月	-0.25%	0.43%	0.76%	0.21%	-1.01%	0.22%
过去六个月	0.17%	0.40%	2.05%	0.25%	-1.88%	0.15%
过去一年	-7.78%	0.42%	0.73%	0.23%	-8.51%	0.19%
过去三年	-9.72%	0.59%	3.94%	0.27%	-13.66%	0.32%
自基金份额起始运作日至今	7.77%	0.64%	12.90%	0.29%	-5.13%	0.35%

注：本基金业绩比较基准为：中国债券总指数\*90%+沪深 300 指数\*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧鼎利债券 E

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	-1.07%	0.40%	-0.80%	0.21%	-0.27%	0.19%
过去三个月	-0.16%	0.43%	0.76%	0.21%	-0.92%	0.22%
过去六个月	0.54%	0.40%	2.05%	0.25%	-1.51%	0.15%
过去一年	-7.26%	0.42%	0.73%	0.23%	-7.99%	0.19%
过去三年	-8.45%	0.59%	3.94%	0.27%	-12.39%	0.32%



					%	
自基金份额起始运 作日至今	9.75%	0.64%	12.90%	0.29%	-3.15%	0.35%

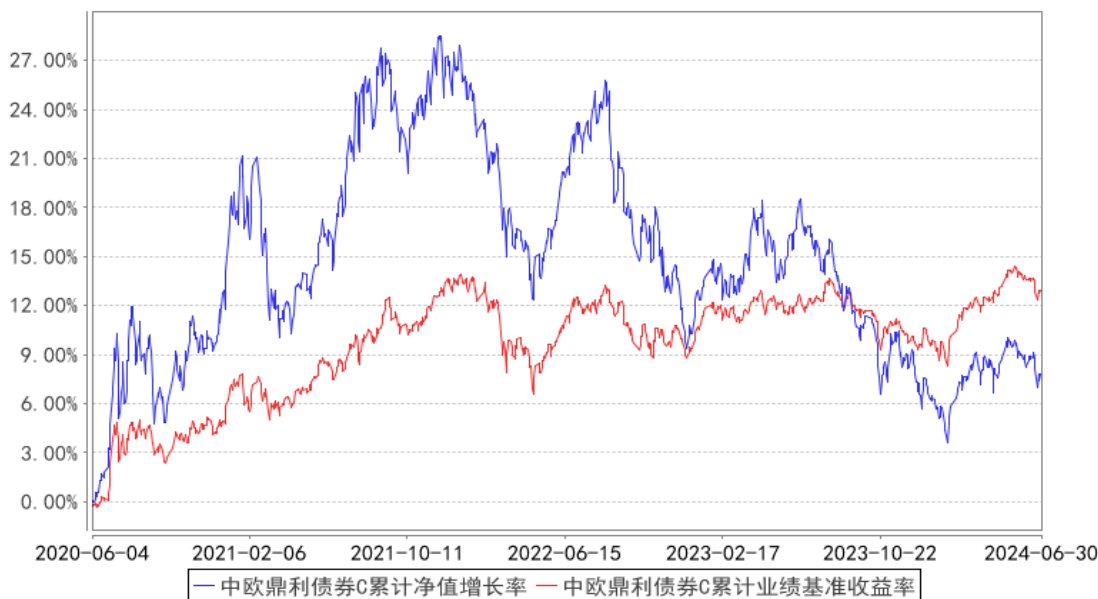
注：本基金业绩比较基准为：中国债券总指数\*90%+沪深 300 指数\*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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



注：本基金转型生效日为 2017 年 9 月 18 日，自 2020 年 6 月 3 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总值指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”变更为“中证 800 指数收益率\*15%+中证可转换债券指数\*25%+中债综合财富指数收益率\*60%”，图示日期为 2017 年 9 月 18 日至 2024 年 06 月 30 日。

中欧鼎利债券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



注：自 2020 年 6 月 3 日起，本基金增加 C 类份额。同日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总值指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”变更为“中证 800 指数收益率\*15%+中证可转换债券指数\*25%+中债综合财富指数收益率\*60%”。图示日期为 2020 年 6 月 4 日至 2024 年 06 月 30 日。

中欧鼎利债券E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 2020 年 6 月 3 日起，本基金增加 E 类份额，同日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总值指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”变更为“中证 800 指数收益率\*15%+中证可转换债券指数\*25%+中债综合财富指数收益率\*60%”。图示日期为 2020 年 6 月 4 日至 2024 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、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 175 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		
苏佳	基金经理 / 基金经理助理	2024-01-16	-	7 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。
张跃鹏	基金经理	2024-01-16	-	14 年	历任上海永邦投资有限公司投资经理，上海涌泉亿信投资发展中心（有限合伙）策略分析师。2013-09-23 加入中欧基金管理有限公司，历任交易员、投资运营部副总监、基础研究及投资支持部副总监。
赵宇澄	基金经理 / 基金经理助理	2024-04-26	-	5 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。
洪慧梅	基金经理	2019-10-10	2024-01-16	17 年	历任平安资产管理有限责任公司债券交易员，汇丰人寿保险股份有限公司债券交易主任，浙商基金管理有限公司基金经理，平安养老保险股份有限公司投资经理。2019-07-01 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 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 14 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

2024 年上半年国内宏观基本面持续承压，需求不足问题仍然突出，政策开始托底尾部风险。价格方面，CPI、PPI 预计均从底部温和回升，关注供给侧能耗调控导致的工业品涨价。资金面整体延续宽松且无分层的格局，关注近期资金中枢下移趋势。

总体来看，当前政策以防风险为主、基本面依然偏弱；流动性依然宽松，资金利率已有下移迹象；银行净息差偏低，把握负债成本下降的确定性，陡峭化依然是未来方向；资产荒格局不会轻易打破，当利率由于供给压力出现调整时，是比较好的配置介入机会，短期可能维持上有顶下有底的震荡格局。

在此背景下，二季度资本市场延续债强股弱格局，中债总财富指数上涨 1.75%，万得全 A 指数下跌 5.32%，中证转债指数上涨 0.75%。

债券方面，5 年以内品种表现亮眼，5 年国债从 2.2% 下行至最低 1.98%，3 年国债从 2.06% 下行至最低 1.80%，四月底的情绪性冲击未对中短端下行趋势造成明显干扰。10 年以上品种经历震荡行情，在 4 月底的冲击后持续下行，超长期限如 40 年、50 年国债甚至突破了前期低位。

股市先涨后跌，全 A 市场在红利、资源类股票的带领下温和上涨至 5 月中旬，随后各风格均出现较为明显的调整。小盘风格和成长风格仍然处在逆风期，中证 1000 二季度下跌 10.02%，创业板指下跌 7.41%。

受益于资产荒的大背景，转债市场在 6 月前整体收益风险比好于权益市场，6 月后，受部分风险主体信用问题的发酵，转债市场快速走弱，转债等权指数 6 月下跌 4.20%，但在 6 月底出现反弹企稳迹象。

组合操作方面，报告期内，本组合在久期基本维持稳定下缓慢调降；组合在市场下跌中增加了部分转债仓位，股票仓位维持在偏高水平。

#### 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 0.38%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%；基金 C 类份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%；基金 E 类份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，海外利率水平或成为市场关注的核心宏观变量。美债进入下行区间将缓解汇率对中债的制约，进一步打开债券利率下行的空间。

对风险资产而言，交易可能性的衰退预期或将导致全球风险资产的估值承压，前期估值扩张较多国家的风险资产存在显著调整风险。展望国内权益市场，行情或出现分化，分母端受海外利率影响，分子端与海外基本面弱相关的资产，如质量类资产，或分子端兑现久期较长的资产，如成长类资产，可能迎来估值的修复。

转债市场在经历部分风险主体信用问题的发酵后，市场的定价效率会进一步提高，对转债资产的研究也提出了更高的要求。基本面存在瑕疵的主体转债价格可能持续承压，同时市场上存在可观数量被错杀的主体，其转债具备良好的投资价值，可期待这些转债的估值修复。

#### 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历。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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中欧鼎利债券型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，中欧基金管理有限公司在中欧鼎利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为中欧基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指

标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现  
有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：中欧鼎利债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,224,742.35	35,479,136.61
结算备付金		10,924,157.62	3,091,688.49
存出保证金		193,032.10	403,481.51
交易性金融资产	6.4.7.2	913,462,890.15	648,686,467.34
其中：股票投资		115,229,431.26	65,434,948.61
基金投资		-	-
债券投资		798,233,458.89	583,251,518.73
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		792,405.20	65,408,661.12
应收股利		-	-
应收申购款		359.71	2,257.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		926,597,587.13	753,071,692.80
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		191,506,285.83	40,000,000.00
应付清算款		1,563,409.05	-
应付赎回款		1,846.48	6,836,820.70
应付管理人报酬		422,177.15	442,417.89
应付托管费		60,311.01	63,202.56
应付销售服务费		2,355.67	52,757.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34,899.32	38,626.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,041,475.75	553,318.20
负债合计		194,632,760.26	47,987,143.36
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	457,241,660.10	472,701,339.22
未分配利润	6.4.7.8	274,723,166.77	232,383,210.22
净资产合计		731,964,826.87	705,084,549.44
负债和净资产总计		926,597,587.13	753,071,692.80

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 652,929,394.07 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.1204 元，基金份额总额 646,787,031.86 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.1891 元，基金份额总额 6,011,538.08 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 1.2111 元，基金份额总额 130,824.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧鼎利债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		16,249,394.19	39,486,763.63
1. 利息收入		92,595.07	137,651.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	92,595.07	137,651.52
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,190,650.56	26,642,931.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,253,172.56	12,977,246.63



基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,471,441.90	13,349,676.30
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
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	1,466,036.10	316,008.63
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	2,920,348.97	12,655,208.86
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	45,799.59	50,971.69
<b>减：二、营业总支出</b>		5,410,804.85	2,937,413.38
1. 管理人报酬		2,736,187.53	2,092,208.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		390,883.85	298,887.03
3. 销售服务费		40,287.19	107,575.62
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,102,822.81	314,265.32
其中：卖出回购金融资产支 出		2,102,822.81	314,265.32
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		13,134.96	12,637.70
8. 其他费用	6.4.7.18	127,488.51	111,838.90
<b>三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)</b>		10,838,589.34	36,549,350.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		10,838,589.34	36,549,350.25
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		10,838,589.34	36,549,350.25

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中欧鼎利债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	472,701,339.22	-	232,383,210.22	705,084,549.44

资产				
二、本期期初净资产	472,701,339.22	-	232,383,210.22	705,084,549.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,459,679.12	-	42,339,956.55	26,880,277.43
(一)、综合收益总额	-	-	10,838,589.34	10,838,589.34
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-15,459,679.12	-	31,501,367.21	16,041,688.09
其中：1. 基金申购款	308,404,972.40	-	168,569,127.84	476,974,100.24
2. 基金赎回款	-323,864,651.52	-	-137,067,760.63	-460,932,412.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	457,241,660.10	-	274,723,166.77	731,964,826.87
项目	上年度可比期间			
	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	307,567,371.01	-	187,694,823.04	495,262,194.05
二、本期期初净资产	307,567,371.01	-	187,694,823.04	495,262,194.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	228,244,070.79	-	138,445,844.97	366,689,915.76
(一)、综合收益总额	-	-	36,549,350.25	36,549,350.25
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	228,244,070.79	-	101,896,494.72	330,140,565.51
其中：1. 基金申	411,267,961.40	-	187,338,110.23	598,606,071.63

购款				
2. 基金赎回款	-183,023,890.61	-	-85,441,615.51	-268,465,506.12
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	535,811,441.80	-	326,140,668.01	861,952,109.81

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：

刘建平

杨毅

王音然

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

中欧鼎利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由中欧鼎利分级债券型证券投资基金转型而来。中欧鼎利分级债券型证券投资基金于 2017 年 7 月 31 日至 2017 年 8 月 14 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《关于中欧鼎利分级债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》,同意将中欧鼎利分级债券型证券投资基金转型为中欧鼎利债券型证券投资基金。根据《中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利分级债券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》及《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金转型份额转换结果公告》,自 2017 年 9 月 18 日起,中欧鼎利分级债券型证券投资基金正式转型并更名为中欧鼎利债券型证券投资基金。自同日起,《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》生效,原《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》失效。与此同时,中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同失效前的基金资产净值 143,772,483.06 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据基金管理人中欧基金管理有限公司 2020 年 6 月 3 日《中欧基金管理有限公司关于中欧鼎利债券型证券投资基金增加 C、E 类基金份额、变更业绩比较基准并相应修改基金合同和托管协议的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2020 年 6 月 3 日起对本基

金增加 C 类和 E 类基金份额、变更本基金的业绩比较基准并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额,新增的两类基金份额类别命名为 C 类基金份额和 E 类基金份额。新增 C 类和 E 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司。A 类和 E 类基金份额在投资者申购时收取申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费,C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

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 2024 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》、《中欧鼎利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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,224,742.35
等于：本金	1,224,453.54
加：应计利息	288.81
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	1,224,742.35

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	120,661,235.54	-	115,229,431.26	-5,431,804.28	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	398,078,173.36	2,687,807.68	400,986,096.24	220,115.20
	银行间市场	386,263,875.52	5,459,362.65	397,247,362.65	5,524,124.48
	合计	784,342,048.88	8,147,170.33	798,233,458.89	5,744,239.68
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	905,003,284.42	8,147,170.33	913,462,890.15	312,435.40	

### 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 2024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	942,192.45
其中：交易所市场	914,325.58
银行间市场	27,866.87
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-审计费	29,835.26
其他应付	9,775.70
合计	1,041,475.75

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧鼎利债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	498,987,226.71	348,010,184.05
本期申购	418,237,841.85	291,704,629.98
本期赎回（以“-”号填列）	-270,438,036.70	-188,615,516.14
本期末	646,787,031.86	451,099,297.89

中欧鼎利债券 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	119,630,216.28	119,630,216.28
本期申购	114,385.06	114,385.06
本期赎回（以“-”号填列）	-113,733,063.26	-113,733,063.26
本期末	6,011,538.08	6,011,538.08

中欧鼎利债券 E

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,060,938.89	5,060,938.89
本期申购	16,585,957.36	16,585,957.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-21,516,072.12	-21,516,072.12
本期末	130,824.13	130,824.13

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

中欧鼎利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,698,883.37	64,269,165.93	208,968,049.30
本期期初	144,698,883.37	64,269,165.93	208,968,049.30
本期利润	8,018,405.17	4,061,060.31	12,079,465.48
本期基金份额交易产生的变动数	39,260,105.17	13,251,317.08	52,511,422.25
其中：基金申购款	118,522,227.83	46,611,067.19	165,133,295.02
基金赎回款	-79,262,122.66	-33,359,750.11	-112,621,872.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	191,977,393.71	81,581,543.32	273,558,937.03

中欧鼎利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,012,905.94	15,366,699.64	22,379,605.58
本期期初	7,012,905.94	15,366,699.64	22,379,605.58
本期利润	-98,828.07	-1,020,609.37	-1,119,437.44
本期基金份额交易产生的变动数	-6,532,621.62	-13,590,937.99	-20,123,559.61
其中：基金申购款	7,017.63	13,744.41	20,762.04
基金赎回款	-6,539,639.25	-13,604,682.40	-20,144,321.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	381,456.25	755,152.28	1,136,608.53

中欧鼎利债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	385,848.20	649,707.14	1,035,555.34
本期期初	385,848.20	649,707.14	1,035,555.34
本期利润	-1,336.73	-120,101.97	-121,438.70
本期基金份额交易产生的变动数	-373,335.91	-513,159.52	-886,495.43
其中：基金申购款	1,109,277.56	2,305,793.22	3,415,070.78
基金赎回款	-1,482,613.47	-2,818,952.74	-4,301,566.21



本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,175.56	16,445.65	27,621.21

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	18,086.80	
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	63,415.98	
其他	11,092.29	
合计	92,595.07	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	945,920,447.38	
减：卖出股票成本总额	941,633,682.35	
减：交易费用	2,033,592.47	
买卖股票差价收入	2,253,172.56	

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	9,959,017.90	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-487,576.00	
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	9,471,441.90	

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,105,536,143.42	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,094,607,492.69	

减：应计利息总额	11,383,667.66
减：交易费用	32,559.07
买卖债券差价收入	-487,576.00

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,466,036.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,466,036.10

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	2,920,348.97
股票投资	-5,132,191.92
债券投资	8,052,540.89
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	2,920,348.97

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	45,785.82
基金转换费收入	13.77
合计	45,799.59

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	19,380.91
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	127,488.51

#### 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

中欧基金管理有限公司已于 2024 年 4 月 9 日正式受让中欧私募基金管理（上海）有限公司全部股权，中欧私募基金管理（上海）有限公司已变更为中欧基金管理有限公司全资子公司。

##### 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、注册登记机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国都证券	465,174,144.80	24.00	514,663,106.62	32.32

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国都证券	745,733,891.21	73.29	908,879,215.86	39.90

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国都证券	4,279,056,000.00	48.84	404,650,000.00	50.58

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国都证券	342,368.22	23.84	178,279.51	19.50
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	376,370.18	32.32	283,499.73	42.42

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,736,187.53	2,092,208.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,680.72	95,284.68
应支付基金管理人的净管理费	2,672,506.81	1,996,924.13

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	390,883.85	298,887.03

注：支付基金托管人中信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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

##### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E	合计
中欧基金	0.00	34,883.09	0.00	34,883.09
合计	0.00	34,883.09	0.00	34,883.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E	合计
中欧基金	0.00	91,932.08	0.00	91,932.08
合计	0.00	91,932.08	0.00	91,932.08

注：本基金 A 类、E 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 0.4%，销售服务费按照前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付到指定账户。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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 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自有资金投资本基金的情况

中欧鼎利债券 C

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
报告期初持有的基金份额	131,775.45	131,775.45
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
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	131,775.45	131,775.45
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.19%	0.09%

中欧鼎利债券 E

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
报告期初持有的基金份额	130,729.61	130,729.61
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
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	130,729.61	130,729.61
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	99.93%	1.21%

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各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

3、本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金 A 类基金份额

#### 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金各类基金份额。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中信银行股份有限公司	1,224,742.35	18,086.80	5,163,686.26	109,116.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中信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

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2024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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002288	*ST 超华	2024年6月27日	重大事项停牌	0.37	-	-	9,700	24,237.96	3,589.00	-

##### 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

截至本报告期末 2024 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 113,038,125.11 元，是以如下债券作为质押：

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
------	------	-------	--------	-------	--------



2023016	20 中财再 保险	2024 年 7 月 1 日	105.66	200,000	21,132,393.44
2128019	21 中国银 行永续债 01	2024 年 7 月 1 日	104.12	100,000	10,412,452.60
2128032	21 兴业银 行二级 01	2024 年 7 月 1 日	106.48	47,000	5,004,696.12
2128049	21 建设银 行二级 05	2024 年 7 月 1 日	105.17	141,000	14,829,154.92
2228004	22 工商银 行二级 01	2024 年 7 月 1 日	104.36	100,000	10,435,861.20
2228023	22 中国银 行永续债 01	2024 年 7 月 1 日	104.82	200,000	20,964,000.00
230431	23 农发 31	2024 年 7 月 1 日	101.75	11,000	1,119,286.67
2128032	21 兴业银 行二级 01	2024 年 7 月 2 日	106.48	106,000	11,287,186.99
2128032	21 兴业银 行二级 01	2024 年 7 月 4 日	106.48	147,000	15,652,985.74
2128049	21 建设银 行二级 05	2024 年 7 月 4 日	105.17	59,000	6,205,107.38
2228011	22 农业银 行永续债 01	2024 年 7 月 4 日	104.68	100,000	10,468,169.40
合计				1,211,000	127,511,294.46

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 78,468,160.72 元，于 2024 年 7 月 1 日和 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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。本基金在控制风险的

基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	51,295,446.03	131,164,148.42
合计	51,295,446.03	131,164,148.42

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下未有三方评级的国债、一般短期融资券、政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

##### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	429,815,307.60	225,495,263.29
AAA 以下	202,087,296.51	137,227,897.66
未评级	115,035,408.75	89,364,209.36
合计	746,938,012.86	452,087,370.31

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一般公司债、一般中期票据、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制的投资品种比例等。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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。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 2024 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、股票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，股票及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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,224,742.35	-	-	-	1,224,742.35
结算备付金	10,924,157.62	-	-	-	10,924,157.62
存出保证金	193,032.10	-	-	-	193,032.10
交易性金融资产	79,945,717.46	609,395,604.98	108,892,136.45	115,229,431.26	913,462,890.15
应收申购款	-	-	-	359.71	359.71
应收清算款	-	-	-	792,405.20	792,405.20
资产总计	92,287,649.53	609,395,604.98	108,892,136.45	116,022,196.17	926,597,587.13
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,846.48	1,846.48
应付管理人报酬	-	-	-	422,177.15	422,177.15
应付托管费	-	-	-	60,311.01	60,311.01
应付清算款	-	-	-	1,563,409.05	1,563,409.05
卖出回购金融资产款	191,506,285.83	-	-	-	191,506,285.83
应付销售服务费	-	-	-	2,355.67	2,355.67
应交税费	-	-	-	34,899.32	34,899.32
其他负债	-	-	-	1,041,475.75	1,041,475.75
负债总计	191,506,285.83	-	-	3,126,474.43	194,632,760.26
利率敏感度缺口	-99,218,636.30	609,395,604.98	108,892,136.45	112,895,721.74	731,964,826.87
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	35,479,136.61	-	-	-	35,479,136.61
结算备付金	3,091,688.49	-	-	-	3,091,688.49
存出保证金	403,481.51	-	-	-	403,481.51
交易性金融资产	282,674,513.40	258,685,966.46	41,891,038.87	65,434,948.61	648,686,467.34
应收申购款	-	-	-	2,257.73	2,257.73
应收清算款	-	-	-	65,408,661.12	65,408,661.12
资产总计	321,648,820.01	258,685,966.46	41,891,038.87	130,845,867.46	753,071,692.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,836,820.70	6,836,820.70
应付管理人报酬	-	-	-	442,417.89	442,417.89
应付托管费	-	-	-	63,202.56	63,202.56
卖出回购金融资产款	40,000,000.00	-	-	-	40,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	52,757.30	52,757.30
应交税费	-	-	-	38,626.71	38,626.71
其他负债	-	-	-	553,318.20	553,318.20
负债总计	40,000,000.00	-	-	7,987,143.36	47,987,143.36
利率敏感度缺口	281,648,820.01	258,685,966.46	41,891,038.87	122,858,724.10	705,084,549.44

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	利率上升 25BP	-4,050,153.48	-898,558.01
	利率下降 25BP	4,108,413.54	902,906.72

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 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股票和债券，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	115,229,431.26	15.74	65,434,948.61	9.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	115,229,431.26	15.74	65,434,948.61	9.28

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 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 15.74%（2023 年 12 月 31 日：9.28%），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（2023 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	350,173,331.49	225,083,734.77
第二层次	563,289,558.66	423,602,732.57
第三层次	-	-
合计	913,462,890.15	648,686,467.34

##### 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事项发生的当期期初为确认各层次之间的转换时点。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、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	115,229,431.26	12.44
	其中：股票	115,229,431.26	12.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	798,233,458.89	86.15
	其中：债券	798,233,458.89	86.15
	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	12,148,899.97	1.31
8	其他各项资产	985,797.01	0.11
9	合计	926,597,587.13	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

金额单位：人民币元

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	406,778.00	0.06
B	采矿业	9,408,821.00	1.29
C	制造业	81,933,822.32	11.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,518,982.32	0.21
E	建筑业	1,508,691.00	0.21
F	批发和零售业	1,654,655.40	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	705,434.00	0.10
H	住宿和餐饮业	18,715.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,890,369.29	1.21
J	金融业	2,015,663.00	0.28
K	房地产业	2,588,747.00	0.35
L	租赁和商务服务业	993,523.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	866,947.54	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	252,054.59	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,384.00	0.00
Q	卫生和社会工作	80,695.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,379,148.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	115,229,431.26	15.74



### 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港股通投资股票。

### 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

金额单位：人民币元

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	600522	中天科技	417,200	6,612,620.00	0.90
2	000333	美的集团	63,500	4,095,750.00	0.56
3	301589	诺瓦星云	17,280	3,360,960.00	0.46
4	600129	太极集团	110,600	3,198,552.00	0.44
5	603501	韦尔股份	27,100	2,692,927.00	0.37
6	601225	陕西煤业	93,700	2,414,649.00	0.33
7	688008	澜起科技	38,367	2,193,057.72	0.30
8	600048	保利发展	250,200	2,191,752.00	0.30
9	603338	浙江鼎力	36,000	2,175,120.00	0.30
10	300134	大富科技	306,000	2,086,920.00	0.29
11	002467	二六三	602,800	2,013,352.00	0.28
12	600373	中文传媒	135,500	2,010,820.00	0.27
13	002463	沪电股份	48,900	1,784,850.00	0.24
14	603236	移远通信	37,800	1,766,394.00	0.24
15	600489	中金黄金	116,500	1,724,200.00	0.24
16	300502	新易盛	14,200	1,498,810.00	0.20
17	000975	山金国际	86,500	1,409,085.00	0.19
18	688099	晶晨股份	21,160	1,255,211.20	0.17
19	002240	盛新锂能	92,800	1,245,376.00	0.17
20	002008	大族激光	53,600	1,114,880.00	0.15
21	000837	秦川机床	149,500	1,100,320.00	0.15
22	688400	凌云光	64,415	1,074,442.20	0.15
23	601168	西部矿业	59,700	1,071,615.00	0.15
24	002128	电投能源	50,000	1,055,000.00	0.14
25	300615	欣天科技	108,300	1,036,431.00	0.14
26	601600	中国铝业	134,600	1,026,998.00	0.14
27	688120	华海清科	5,044	956,241.52	0.13
28	002472	双环传动	40,900	900,618.00	0.12
29	300211	亿通科技	166,700	881,843.00	0.12
30	000651	格力电器	20,900	819,698.00	0.11
31	603986	兆易创新	8,300	793,646.00	0.11
32	300414	中光防雷	119,500	789,895.00	0.11
33	301029	怡合达	40,100	788,366.00	0.11
34	603985	恒润股份	63,900	760,410.00	0.10
35	603206	嘉环科技	59,000	745,170.00	0.10
36	603308	应流股份	58,800	730,296.00	0.10
37	301153	中科江南	25,380	717,238.80	0.10

38	688728	格科微	57,746	699,304.06	0.10
39	600366	宁波韵升	133,200	695,304.00	0.09
40	600031	三一重工	41,300	681,450.00	0.09
41	688041	海光信息	9,620	676,478.40	0.09
42	002547	春兴精工	278,400	673,728.00	0.09
43	601890	亚星锚链	91,400	644,370.00	0.09
44	300382	斯莱克	109,000	644,190.00	0.09
45	601899	紫金矿业	35,300	620,221.00	0.08
46	000810	创维数字	71,600	614,328.00	0.08
47	600172	黄河旋风	321,800	604,984.00	0.08
48	002415	海康威视	19,500	602,745.00	0.08
49	300012	华测检测	58,500	588,510.00	0.08
50	002036	联创电子	82,000	553,500.00	0.08
51	601186	中国铁建	61,700	528,769.00	0.07
52	601601	中国太保	18,900	526,554.00	0.07
53	300323	华灿光电	118,200	514,170.00	0.07
54	688630	芯碁微装	8,116	507,818.12	0.07
55	300504	天邑股份	41,500	505,885.00	0.07
56	688002	睿创微纳	17,875	499,963.75	0.07
57	000933	神火股份	24,700	499,681.00	0.07
58	688383	新益昌	9,096	473,992.56	0.06
59	600582	天地科技	68,500	471,965.00	0.06
60	300940	南极光	36,700	467,558.00	0.06
61	600030	中信证券	25,500	464,865.00	0.06
62	600016	民生银行	118,100	447,599.00	0.06
63	002430	杭氧股份	20,000	445,000.00	0.06
64	601668	中国建筑	83,800	444,978.00	0.06
65	000423	东阿阿胶	7,000	438,200.00	0.06
66	600219	南山铝业	110,100	419,481.00	0.06
67	300571	平治信息	19,600	410,424.00	0.06
68	688313	仕佳光子	41,817	398,097.84	0.05
69	601636	旗滨集团	59,700	385,065.00	0.05
70	002497	雅化集团	43,000	383,560.00	0.05
71	688371	菲沃泰	38,106	382,584.24	0.05
72	300278	华昌达	128,600	369,082.00	0.05
73	002183	怡亚通	124,900	354,716.00	0.05
74	002326	永太科技	45,300	354,246.00	0.05
75	000633	合金投资	86,300	340,022.00	0.05
76	002268	电科网安	23,400	332,982.00	0.05
77	603160	汇顶科技	4,800	330,000.00	0.05
78	600499	科达制造	38,400	323,712.00	0.04
79	601006	大秦铁路	44,600	319,336.00	0.04
80	002385	大北农	81,900	315,315.00	0.04

81	003816	中国广核	67,900	314,377.00	0.04
82	002624	完美世界	41,200	313,120.00	0.04
83	300601	康泰生物	20,000	312,200.00	0.04
84	603517	绝味食品	20,200	311,080.00	0.04
85	300841	康华生物	6,100	308,904.00	0.04
86	600011	华能国际	32,100	308,802.00	0.04
87	600066	宇通客车	11,900	307,020.00	0.04
88	002643	万润股份	30,600	306,000.00	0.04
89	601666	平煤股份	27,300	305,760.00	0.04
90	600335	国机汽车	50,200	289,654.00	0.04
91	600372	中航机载	23,500	281,295.00	0.04
92	300595	欧普康视	17,900	280,672.00	0.04
93	600089	特变电工	20,100	278,787.00	0.04
94	600406	国电南瑞	11,100	277,056.00	0.04
95	601000	唐山港	58,200	273,540.00	0.04
96	002517	恺英网络	28,600	273,130.00	0.04
97	300953	震裕科技	5,000	271,000.00	0.04
98	603000	人民网	13,200	263,868.00	0.04
99	002646	天佑德酒	25,600	261,888.00	0.04
100	688800	瑞可达	9,317	261,621.36	0.04
101	300369	绿盟科技	50,700	259,077.00	0.04
102	300390	天华新能	14,800	254,264.00	0.03
103	300433	蓝思科技	13,900	253,675.00	0.03
104	300212	易华录	14,700	247,401.00	0.03
105	600502	安徽建工	57,000	245,100.00	0.03
106	688077	大地熊	15,221	240,948.43	0.03
107	603883	老百姓	13,040	239,414.40	0.03
108	600452	涪陵电力	18,300	231,861.00	0.03
109	002867	周大生	17,600	229,856.00	0.03
110	300058	蓝色光标	41,800	227,392.00	0.03
111	002100	天康生物	32,700	226,611.00	0.03
112	000735	罗牛山	51,200	221,696.00	0.03
113	002724	海洋王	49,700	221,165.00	0.03
114	603127	昭衍新药	16,600	220,282.00	0.03
115	000016	深康佳 A	102,900	219,177.00	0.03
116	300142	沃森生物	18,800	213,944.00	0.03
117	002777	久远银海	14,100	211,359.00	0.03
118	600329	达仁堂	6,500	210,535.00	0.03
119	300587	天铁股份	51,300	207,252.00	0.03
120	600585	海螺水泥	8,600	202,874.00	0.03
121	300195	长荣股份	47,900	200,701.00	0.03
122	600132	重庆啤酒	3,300	200,310.00	0.03
123	603421	鼎信通讯	44,700	199,362.00	0.03

124	002549	凯美特气	39,000	199,290.00	0.03
125	603609	禾丰股份	30,400	198,816.00	0.03
126	002068	黑猫股份	27,900	198,090.00	0.03
127	603013	亚普股份	14,600	196,662.00	0.03
128	600559	老白干酒	10,800	196,344.00	0.03
129	600745	闻泰科技	6,900	194,925.00	0.03
130	001236	弘业期货	27,100	192,681.00	0.03
131	600556	天下秀	51,300	186,732.00	0.03
132	601011	宝泰隆	116,400	186,240.00	0.03
133	002558	巨人网络	19,600	185,024.00	0.03
134	300973	立高食品	6,500	182,585.00	0.02
135	300639	凯普生物	39,600	182,160.00	0.02
136	300079	数码视讯	44,400	180,264.00	0.02
137	300869	康泰医学	13,700	179,059.00	0.02
138	688061	灿瑞科技	6,308	173,343.84	0.02
139	603032	德新科技	15,100	172,593.00	0.02
140	600409	三友化工	33,800	169,676.00	0.02
141	300558	贝达药业	5,200	169,260.00	0.02
142	600696	岩石股份	25,100	164,907.00	0.02
143	603937	丽岛新材	21,200	164,512.00	0.02
144	688010	福光股份	10,387	161,725.59	0.02
145	000028	国药一致	5,000	161,150.00	0.02
146	688519	南亚新材	6,279	160,554.03	0.02
147	300161	华中数控	7,100	159,679.00	0.02
148	603666	亿嘉和	10,100	159,378.00	0.02
149	603456	九洲药业	11,600	159,152.00	0.02
150	601778	晶科科技	69,700	158,916.00	0.02
151	002317	众生药业	13,900	158,877.00	0.02
152	688135	利扬芯片	9,850	157,797.00	0.02
153	600770	综艺股份	68,500	156,865.00	0.02
154	600100	同方股份	30,200	153,718.00	0.02
155	601689	拓普集团	2,800	150,108.00	0.02
156	002416	爱施德	16,900	149,565.00	0.02
157	600595	中孚实业	59,900	149,151.00	0.02
158	603489	八方股份	5,500	148,390.00	0.02
159	002250	联化科技	30,900	148,320.00	0.02
160	002981	朝阳科技	8,100	148,311.00	0.02
161	002028	思源电气	2,200	147,180.00	0.02
162	002122	汇洲智能	69,900	146,091.00	0.02
163	002239	奥特佳	63,400	145,820.00	0.02
164	600481	双良节能	31,200	145,704.00	0.02
165	002291	遥望科技	33,200	142,760.00	0.02
166	300565	科信技术	14,200	142,710.00	0.02

167	603129	春风动力	1,000	142,340.00	0.02
168	002760	凤形股份	10,700	141,240.00	0.02
169	300498	温氏股份	7,100	140,722.00	0.02
170	600882	妙可蓝多	11,200	139,664.00	0.02
171	600309	万华化学	1,700	137,462.00	0.02
172	600985	淮北矿业	8,100	135,594.00	0.02
173	603008	喜临门	7,300	126,509.00	0.02
174	600348	华阳股份	12,200	121,512.00	0.02
175	300451	创业慧康	34,700	120,062.00	0.02
176	601939	建设银行	16,000	118,400.00	0.02
177	002132	恒星科技	55,700	118,084.00	0.02
178	601555	东吴证券	19,900	117,410.00	0.02
179	002950	奥美医疗	17,300	114,180.00	0.02
180	300426	唐德影视	16,800	113,904.00	0.02
181	601868	中国能建	53,700	113,844.00	0.02
182	000860	顺鑫农业	6,800	113,832.00	0.02
183	300802	矩子科技	7,200	113,544.00	0.02
184	002929	润建股份	3,900	113,529.00	0.02
185	605376	博迁新材	5,000	112,850.00	0.02
186	001256	炜冈科技	8,200	112,504.00	0.02
187	688516	奥特维	2,688	112,385.28	0.02
188	002027	分众传媒	18,200	110,292.00	0.02
189	600604	市北高新	31,600	109,336.00	0.01
190	600699	均胜电子	7,300	108,186.00	0.01
191	300724	捷佳伟创	2,000	108,020.00	0.01
192	605389	长龄液压	5,100	107,049.00	0.01
193	002421	达实智能	45,900	106,947.00	0.01
194	301035	润丰股份	2,400	106,896.00	0.01
195	002163	海南发展	19,000	104,120.00	0.01
196	300226	上海钢联	6,100	103,334.00	0.01
197	600704	物产中大	23,800	103,292.00	0.01
198	600062	华润双鹤	5,200	101,816.00	0.01
199	688019	安集科技	804	101,143.20	0.01
200	605222	起帆电缆	6,500	99,710.00	0.01
201	003006	百亚股份	4,200	99,540.00	0.01
202	002440	闰土股份	18,300	99,369.00	0.01
203	300144	宋城演艺	12,300	98,769.00	0.01
204	600511	国药股份	3,200	98,528.00	0.01
205	600801	华新水泥	7,100	97,625.00	0.01
206	002912	中新赛克	5,500	97,460.00	0.01
207	601966	玲珑轮胎	5,300	97,361.00	0.01
208	002488	金固股份	22,100	97,019.00	0.01
209	605208	永茂泰	15,500	96,565.00	0.01

210	000530	冰山冷热	26,600	96,292.00	0.01
211	002153	石基信息	16,300	93,399.00	0.01
212	300687	赛意信息	6,700	93,264.00	0.01
213	603618	杭电股份	21,200	92,856.00	0.01
214	605338	巴比食品	7,000	92,750.00	0.01
215	603906	龙蟠科技	11,900	92,701.00	0.01
216	002181	粤传媒	28,600	92,378.00	0.01
217	002698	博实股份	7,500	92,025.00	0.01
218	300620	光库科技	2,500	91,950.00	0.01
219	300176	派生科技	20,400	89,964.00	0.01
220	301396	宏景科技	4,600	89,746.00	0.01
221	600521	华海药业	5,200	88,660.00	0.01
222	301370	国科恒泰	8,100	88,047.00	0.01
223	000683	远兴能源	12,700	87,757.00	0.01
224	603719	良品铺子	7,400	86,358.00	0.01
225	600449	宁夏建材	7,300	85,775.00	0.01
226	600886	国投电力	4,700	85,728.00	0.01
227	002603	以岭药业	5,500	84,315.00	0.01
228	000012	南玻 A	16,500	83,160.00	0.01
229	603213	镇洋发展	11,100	83,028.00	0.01
230	603019	中科曙光	2,000	83,000.00	0.01
231	600802	福建水泥	29,600	82,288.00	0.01
232	600115	中国东航	20,200	81,002.00	0.01
233	688072	拓荆科技	662	79,512.82	0.01
234	603999	读者传媒	16,600	78,518.00	0.01
235	002135	东南网架	19,800	78,408.00	0.01
236	688256	寒武纪	394	78,275.98	0.01
237	600980	北矿科技	6,000	78,180.00	0.01
238	301316	慧博云通	5,300	77,804.00	0.01
239	002142	宁波银行	3,500	77,210.00	0.01
240	601699	潞安环能	4,100	74,333.00	0.01
241	000576	甘化科工	12,100	72,600.00	0.01
242	688348	昱能科技	1,227	72,393.00	0.01
243	600660	福耀玻璃	1,500	71,850.00	0.01
244	002358	森源电气	20,500	70,110.00	0.01
245	603596	伯特利	1,800	70,020.00	0.01
246	300519	新光药业	6,400	69,440.00	0.01
247	600067	冠城大通	39,600	69,300.00	0.01
248	603076	乐惠国际	3,200	68,128.00	0.01
249	002653	海思科	2,200	67,540.00	0.01
250	300472	新元科技	15,100	66,893.00	0.01
251	300767	震安科技	7,800	66,144.00	0.01
252	300999	金龙鱼	2,400	65,640.00	0.01

253	600658	电子城	19,500	64,155.00	0.01
254	600510	黑牡丹	17,000	63,240.00	0.01
255	001311	多利科技	2,600	62,868.00	0.01
256	603106	恒银科技	14,700	62,622.00	0.01
257	600184	光电股份	7,300	62,123.00	0.01
258	603065	宿迁联盛	8,300	62,001.00	0.01
259	002397	梦洁股份	31,600	60,672.00	0.01
260	603255	鼎际得	2,600	60,580.00	0.01
261	688216	气派科技	3,392	60,513.28	0.01
262	002439	启明星辰	3,400	58,684.00	0.01
263	600642	申能股份	6,600	58,278.00	0.01
264	600863	内蒙华电	12,500	58,000.00	0.01
265	603158	腾龙股份	8,200	57,728.00	0.01
266	300005	探路者	11,500	57,615.00	0.01
267	601991	大唐发电	19,100	57,491.00	0.01
268	301373	凌玮科技	2,500	57,000.00	0.01
269	605369	拱东医疗	1,400	55,860.00	0.01
270	601798	蓝科高新	11,100	54,945.00	0.01
271	600210	紫江企业	10,300	54,796.00	0.01
272	603939	益丰药房	2,200	54,010.00	0.01
273	002145	中核钛白	16,200	53,136.00	0.01
274	603633	徕木股份	6,700	52,997.00	0.01
275	600771	广誉远	2,800	52,724.00	0.01
276	688161	威高骨科	2,641	52,344.62	0.01
277	600758	辽宁能源	18,200	52,052.00	0.01
278	603949	雪龙集团	4,600	51,796.00	0.01
279	603882	金城医学	1,900	51,661.00	0.01
280	301296	新巨丰	7,100	51,191.00	0.01
281	002164	宁波东力	13,100	50,304.00	0.01
282	300326	凯利泰	13,100	49,780.00	0.01
283	002768	国恩股份	2,600	48,620.00	0.01
284	002279	久其软件	11,200	48,272.00	0.01
285	002933	新兴装备	2,100	48,111.00	0.01
286	002988	豪美新材	3,100	47,585.00	0.01
287	002003	伟星股份	3,700	46,435.00	0.01
288	002946	新乳业	5,300	46,428.00	0.01
289	600613	神奇制药	8,600	46,010.00	0.01
290	000607	华媒控股	14,800	45,732.00	0.01
291	600208	新潮中宝	28,800	45,504.00	0.01
292	688390	固德威	798	44,783.76	0.01
293	301149	隆华新材	4,800	44,352.00	0.01
294	300289	利德曼	11,400	43,890.00	0.01
295	688186	广大特材	4,452	43,317.96	0.01

296	002191	劲嘉股份	11,800	42,598.00	0.01
297	600609	金杯汽车	12,200	42,334.00	0.01
298	000983	山西焦煤	4,000	41,240.00	0.01
299	605068	明新旭腾	3,000	39,540.00	0.01
300	600716	凤凰股份	15,000	39,300.00	0.01
301	601916	浙商银行	13,900	38,364.00	0.01
302	002327	富安娜	3,800	38,190.00	0.01
303	600900	长江电力	1,300	37,596.00	0.01
304	301355	南王科技	3,900	37,401.00	0.01
305	688276	百克生物	1,302	36,937.74	0.01
306	300681	英搏尔	2,800	36,512.00	0.00
307	600819	耀皮玻璃	8,400	35,448.00	0.00
308	603176	汇通集团	9,500	35,435.00	0.00
309	002115	三维通信	7,200	34,992.00	0.00
310	600410	华胜天成	9,000	34,830.00	0.00
311	002662	京威股份	11,400	34,656.00	0.00
312	300871	回盛生物	3,600	34,344.00	0.00
313	002286	保龄宝	6,200	34,162.00	0.00
314	002666	德联集团	9,400	34,028.00	0.00
315	688315	诺禾致源	3,089	33,731.88	0.00
316	301009	可靠股份	4,500	33,615.00	0.00
317	002570	贝因美	14,300	33,462.00	0.00
318	600738	丽尚国潮	8,900	32,663.00	0.00
319	601881	中国银河	3,000	32,580.00	0.00
320	003007	直真科技	1,300	32,435.00	0.00
321	603355	莱克电气	1,500	32,400.00	0.00
322	600545	卓郎智能	23,800	31,892.00	0.00
323	600691	阳煤化工	18,600	31,806.00	0.00
324	603569	长久物流	4,600	31,556.00	0.00
325	600467	好当家	22,100	31,382.00	0.00
326	603122	合富中国	6,100	31,049.00	0.00
327	002634	棒杰股份	8,500	30,515.00	0.00
328	002801	微光股份	1,600	30,336.00	0.00
329	002082	万邦德	7,200	30,312.00	0.00
330	300765	新诺威	1,200	30,276.00	0.00
331	300080	易成新能	10,400	29,952.00	0.00
332	300867	圣元环保	2,800	29,708.00	0.00
333	301408	华人健康	2,900	29,667.00	0.00
334	300391	长药控股	12,700	29,337.00	0.00
335	002334	英威腾	4,900	29,302.00	0.00
336	603917	合力科技	2,700	29,214.00	0.00
337	600249	两面针	7,900	28,993.00	0.00
338	600391	航发科技	1,900	28,975.00	0.00



339	688231	隆达股份	2,017	28,762.42	0.00
340	300291	百纳千成	6,700	28,542.00	0.00
341	603399	永杉锂业	4,600	28,474.00	0.00
342	002824	和胜股份	2,200	28,072.00	0.00
343	600741	华域汽车	1,700	27,846.00	0.00
344	603520	司太立	2,900	27,666.00	0.00
345	688162	巨一科技	1,386	26,999.28	0.00
346	002531	天顺风能	3,000	26,820.00	0.00
347	300328	宜安科技	6,200	26,536.00	0.00
348	002686	亿利达	6,200	25,978.00	0.00
349	301185	鸥玛软件	1,800	25,794.00	0.00
350	002175	东方智造	14,600	25,696.00	0.00
351	000999	华润三九	600	25,548.00	0.00
352	002557	洽洽食品	900	25,371.00	0.00
353	000789	万年青	5,500	24,970.00	0.00
354	605266	健之佳	960	24,912.00	0.00
355	000505	京粮控股	4,500	24,480.00	0.00
356	300482	万孚生物	1,000	24,400.00	0.00
357	603811	诚意药业	3,900	24,375.00	0.00
358	301290	东星医疗	1,200	23,892.00	0.00
359	000509	华塑控股	9,200	23,644.00	0.00
360	300253	卫宁健康	4,000	23,600.00	0.00
361	002866	传艺科技	1,800	23,166.00	0.00
362	300409	道氏技术	2,600	22,256.00	0.00
363	603630	拉芳家化	2,100	22,071.00	0.00
364	300140	节能环境	3,600	21,492.00	0.00
365	688707	振华新材	2,195	21,379.30	0.00
366	002174	游族网络	2,800	21,252.00	0.00
367	600965	福成股份	5,800	21,112.00	0.00
368	600851	海欣股份	4,600	21,022.00	0.00
369	000537	中绿电	2,200	20,966.00	0.00
370	600158	中体产业	2,700	20,763.00	0.00
371	002060	广东建工	6,000	20,520.00	0.00
372	003011	海象新材	1,500	20,115.00	0.00
373	600795	国电电力	3,300	19,767.00	0.00
374	300279	和晶科技	4,600	19,182.00	0.00
375	600929	雪天盐业	3,600	19,080.00	0.00
376	603808	歌力思	3,000	18,990.00	0.00
377	603333	尚纬股份	6,000	18,660.00	0.00
378	002254	泰和新材	2,100	18,585.00	0.00
379	600258	首旅酒店	1,500	18,525.00	0.00
380	600831	ST 广网	6,900	18,492.00	0.00
381	300443	金雷股份	1,200	18,396.00	0.00

382	688690	纳微科技	1,059	18,394.83	0.00
383	300622	博士眼镜	1,500	18,255.00	0.00
384	688733	壹石通	1,181	17,655.95	0.00
385	002094	青岛金王	9,700	17,363.00	0.00
386	300021	大禹节水	5,200	17,160.00	0.00
387	688133	泰坦科技	1,087	17,152.86	0.00
388	002568	百润股份	1,000	16,830.00	0.00
389	300071	福石控股	8,100	16,767.00	0.00
390	002474	榕基软件	3,800	16,568.00	0.00
391	002522	浙江众成	5,100	16,116.00	0.00
392	688023	安恒信息	401	16,044.01	0.00
393	600251	冠农股份	2,200	15,928.00	0.00
394	002375	亚厦股份	4,900	15,925.00	0.00
395	300111	向日葵	8,500	15,895.00	0.00
396	603138	海量数据	1,500	15,720.00	0.00
397	002817	黄山胶囊	2,900	15,486.00	0.00
398	002084	海鸥住工	6,200	15,190.00	0.00
399	002863	今飞凯达	3,700	15,059.00	0.00
400	002095	生意宝	1,200	14,688.00	0.00
401	002476	宝莫股份	3,900	14,313.00	0.00
402	002905	金逸影视	2,300	14,260.00	0.00
403	002661	克明食品	1,900	14,193.00	0.00
404	300534	陇神戎发	2,000	14,160.00	0.00
405	002301	齐心集团	2,900	14,007.00	0.00
406	002219	新里程	7,400	13,764.00	0.00
407	000523	红棉股份	5,300	13,727.00	0.00
408	603818	曲美家居	4,900	13,671.00	0.00
409	300248	新开普	2,100	13,629.00	0.00
410	601999	出版传媒	2,600	13,572.00	0.00
411	300011	鼎汉技术	2,700	13,473.00	0.00
412	002873	新天药业	1,600	13,280.00	0.00
413	300878	维康药业	900	13,086.00	0.00
414	001201	东瑞股份	700	12,978.00	0.00
415	688078	龙软科技	540	12,436.20	0.00
416	300908	仲景食品	446	12,389.88	0.00
417	605398	新炬网络	600	12,294.00	0.00
418	600960	渤海汽车	4,400	11,704.00	0.00
419	300375	鹏翎股份	3,000	11,610.00	0.00
420	603758	秦安股份	1,500	11,400.00	0.00
421	300987	川网传媒	900	10,926.00	0.00
422	002622	皓宸医疗	7,800	10,842.00	0.00
423	000931	中关村	2,900	10,237.00	0.00
424	002631	德尔未来	2,800	10,024.00	0.00

425	000593	德龙汇能	2,100	9,786.00	0.00
426	688365	光云科技	1,593	9,589.86	0.00
427	603197	保隆科技	300	9,450.00	0.00
428	603307	扬州金泉	300	9,432.00	0.00
429	688468	科美诊断	1,469	9,298.77	0.00
430	688588	凌志软件	1,342	9,192.70	0.00
431	603987	康德莱	1,400	8,554.00	0.00
432	600336	澳柯玛	1,900	8,132.00	0.00
433	002066	瑞泰科技	1,000	7,950.00	0.00
434	603648	畅联股份	1,000	7,920.00	0.00
435	603366	日出东方	2,200	7,854.00	0.00
436	600784	鲁银投资	1,600	7,584.00	0.00
437	002885	京泉华	700	7,546.00	0.00
438	000859	国风新材	2,200	7,524.00	0.00
439	000715	中兴商业	1,500	7,140.00	0.00
440	002953	日丰股份	910	7,134.40	0.00
441	002451	摩恩电气	1,300	6,981.00	0.00
442	300969	恒帅股份	100	6,913.00	0.00
443	002022	科华生物	1,200	6,780.00	0.00
444	301333	诺思格	200	6,722.00	0.00
445	300569	天能重工	1,600	6,656.00	0.00
446	300055	万邦达	1,600	6,480.00	0.00
447	688273	麦澜德	323	6,395.40	0.00
448	600730	中国高科	1,600	6,384.00	0.00
449	688426	康为世纪	336	6,249.60	0.00
450	002016	世荣兆业	1,000	6,160.00	0.00
451	688058	宝兰德	295	6,144.85	0.00
452	002441	众业达	800	6,064.00	0.00
453	688051	佳华科技	339	5,620.62	0.00
454	600624	复旦复华	1,700	5,049.00	0.00
455	600313	农发种业	900	5,031.00	0.00
456	688670	金迪克	421	4,959.38	0.00
457	688678	福立旺	449	4,862.67	0.00
458	002959	小熊电器	100	4,811.00	0.00
459	603982	泉峰汽车	600	4,800.00	0.00
460	688156	路德环境	361	4,776.03	0.00
461	688368	晶丰明源	81	4,487.40	0.00
462	002172	澳洋健康	1,800	4,428.00	0.00
463	603330	天洋新材	900	4,311.00	0.00
464	688369	致远互联	261	4,105.53	0.00
465	002288	*ST 超华	9,700	3,589.00	0.00
466	688578	艾力斯	56	3,569.44	0.00
467	688036	传音控股	35	2,678.90	0.00

468	688122	西部超导	68	2,605.76	0.00
469	688107	安路科技	99	2,516.58	0.00
470	688689	银河微电	94	1,995.62	0.00
471	688682	霍莱沃	64	1,877.76	0.00
472	688056	莱伯泰科	73	1,617.68	0.00
473	688210	统联精密	69	1,528.35	0.00
474	688788	科思科技	65	1,511.25	0.00
475	688345	博力威	88	1,486.32	0.00
476	688251	井松智能	80	1,485.60	0.00
477	688168	安博通	55	1,479.50	0.00
478	688636	智明达	62	1,413.60	0.00
479	688252	天德钰	97	1,409.41	0.00
480	688711	宏微科技	83	1,332.98	0.00
481	688011	新光光电	87	1,318.05	0.00
482	688395	正弦电气	92	1,311.00	0.00
483	688589	力合微	51	1,285.71	0.00
484	300852	四会富仕	40	1,164.80	0.00
485	688291	金橙子	61	1,050.42	0.00
486	688163	赛伦生物	85	1,031.90	0.00
487	688288	鸿泉物联	61	953.43	0.00
488	688526	科前生物	64	940.16	0.00
489	688580	伟思医疗	34	909.84	0.00
490	300557	理工光科	30	844.50	0.00
491	688669	聚石化学	72	815.04	0.00
492	688172	燕东微	45	728.10	0.00
493	688079	美迪凯	98	727.16	0.00
494	688203	海正生材	79	671.50	0.00
495	688679	通源环境	96	668.16	0.00
496	688593	新相微	60	600.00	0.00
497	688247	宣泰医药	67	550.74	0.00
498	688579	山大地纬	70	549.50	0.00
499	300983	尤安设计	35	548.80	0.00
500	300787	海能实业	40	496.40	0.00
501	301468	博盈特焊	21	485.73	0.00
502	688485	九州一轨	58	452.40	0.00
503	301317	鑫磊股份	26	404.04	0.00
504	301309	万得凯	15	383.40	0.00
505	688597	XD 煜邦电	53	368.88	0.00
506	000685	中山公用	40	288.40	0.00
507	603759	海天股份	44	260.92	0.00
508	688098	申联生物	55	229.35	0.00
509	601007	金陵饭店	30	190.80	0.00
510	300065	海兰信	26	171.86	0.00

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	11,987,280.00	1.70
2	301030	仕净科技	11,306,017.00	1.60
3	688169	石头科技	9,853,976.59	1.40
4	000933	神火股份	9,361,720.00	1.33
5	000975	山金国际	9,284,807.00	1.32
6	002128	电投能源	7,061,672.00	1.00
7	601728	中国电信	6,770,294.00	0.96
8	603297	永新光学	6,276,254.40	0.89
9	300394	天孚通信	6,246,003.00	0.89
10	000333	美的集团	6,179,428.00	0.88
11	600489	中金黄金	6,068,717.08	0.86
12	600129	太极集团	6,066,927.00	0.86
13	300433	蓝思科技	6,059,603.00	0.86
14	603501	韦尔股份	5,690,542.00	0.81
15	600048	保利发展	5,396,241.00	0.77
16	600522	中天科技	5,183,307.00	0.74
17	600919	江苏银行	5,139,423.50	0.73
18	600089	特变电工	5,126,457.10	0.73
19	300504	天邑股份	5,111,263.00	0.72
20	002463	沪电股份	5,083,006.00	0.72

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	12,597,104.50	1.79
2	301030	仕净科技	12,418,001.36	1.76
3	688169	石头科技	10,265,159.15	1.46
4	600066	宇通客车	10,116,710.00	1.43
5	000933	神火股份	9,001,447.00	1.28
6	600546	山煤国际	8,854,996.00	1.26
7	300502	新易盛	8,433,163.00	1.20
8	000975	山金国际	7,634,609.00	1.08
9	600660	福耀玻璃	7,404,715.00	1.05
10	601728	中国电信	6,701,868.00	0.95
11	300394	天孚通信	6,434,443.84	0.91
12	688008	澜起科技	6,336,512.80	0.90

13	300433	蓝思科技	6,196,160.00	0.88
14	603297	永新光学	5,933,410.80	0.84
15	002128	电投能源	5,929,923.00	0.84
16	300308	中际旭创	5,827,770.80	0.83
17	600919	江苏银行	5,256,270.00	0.75
18	600188	兖矿能源	5,207,511.00	0.74
19	600690	海尔智家	5,129,888.00	0.73
20	300088	长信科技	4,802,076.00	0.68

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	996,560,356.92
卖出股票收入（成交）总额	945,920,447.38

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	509,095.21	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	293,231,094.67	40.06
	其中：政策性金融债	62,148,092.89	8.49
4	企业债券	133,809,487.14	18.28
5	企业短期融资券	10,192,760.66	1.39
6	中期票据	83,280,931.05	11.38
7	可转债（可交换债）	234,947,489.23	32.10
8	同业存单	-	-
9	其他	42,262,600.93	5.77
10	合计	798,233,458.89	109.05

### 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	2128032	21 兴业银行二级 01	300,000	31,944,868.85	4.36
2	230431	23 农发 31	300,000	30,526,000.00	4.17
3	115522	23 国元 G1	300,000	30,412,109.59	4.15
4	2305879	23 广东债 46	200,000	21,600,785.71	2.95
5	220215	22 国开 15	200,000	21,554,502.73	2.94

### 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中，中信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的处罚和中国证监会的立案调查。中国建设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。

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。

#### 7.12.2

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。

#### 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	193,032.10
2	应收清算款	792,405.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	359.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	985,797.01

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127084	柳工转 2	14,289,608.03	1.95
2	113648	巨星转债	12,832,201.47	1.75
3	127045	牧原转债	11,050,278.11	1.51
4	110083	苏租转债	10,222,099.13	1.40
5	123219	宇瞳转债	8,136,337.23	1.11
6	118004	博瑞转债	8,085,831.86	1.10
7	123107	温氏转债	7,622,422.08	1.04
8	118030	睿创转债	7,589,208.06	1.04
9	123150	九强转债	7,479,617.74	1.02
10	123223	九典转 02	7,384,721.54	1.01
11	127076	中宠转 2	7,308,533.53	1.00
12	113069	博 23 转债	7,118,528.25	0.97
13	118028	会通转债	7,050,332.10	0.96
14	113064	东材转债	6,238,657.60	0.85
15	110093	神马转债	6,213,629.14	0.85
16	110048	福能转债	6,051,235.14	0.83
17	113530	大丰转债	6,028,476.74	0.82
18	123211	阳谷转债	5,813,309.18	0.79
19	127037	银轮转债	5,198,807.25	0.71
20	113060	浙 22 转债	5,004,094.25	0.68
21	127072	博实转债	4,558,353.05	0.62
22	111010	立昂转债	4,477,747.00	0.61
23	127100	神码转债	4,456,136.94	0.61
24	118038	金宏转债	4,312,844.97	0.59
25	123158	宙邦转债	4,207,442.33	0.57
26	113643	风语转债	4,082,117.48	0.56
27	127088	赫达转债	4,060,228.00	0.55
28	123174	精锻转债	4,006,596.76	0.55
29	113615	金诚转债	3,707,824.59	0.51
30	123059	银信转债	3,465,162.72	0.47
31	118035	国力转债	3,431,035.25	0.47
32	123076	强力转债	3,278,893.15	0.45
33	127082	亚科转债	3,105,796.81	0.42
34	118031	天 23 转债	3,057,591.10	0.42
35	118024	冠宇转债	2,854,292.91	0.39
36	118027	宏图转债	2,621,650.10	0.36
37	128081	海亮转债	2,574,843.48	0.35
38	123235	亿田转债	2,466,358.84	0.34



39	118043	福立转债	2,203,221.37	0.30
40	113677	华懋转债	2,164,013.70	0.30
41	123078	飞凯转债	1,849,719.33	0.25
42	113653	永 22 转债	1,732,177.93	0.24
43	123213	天源转债	1,607,411.96	0.22
44	118034	晶能转债	1,468,251.77	0.20
45	110062	烽火转债	9,400.20	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
中欧鼎利债券 A	1,368	472,797.54	623,416,845.88	96.39%	23,370,185.98	3.61%
中欧鼎利债券 C	57	105,465.58	5,660,128.00	94.15%	351,410.08	5.85%
中欧鼎利债券 E	8	16,353.02	130,729.61	99.93%	94.52	0.07%
合计	1,433	455,638.10	629,207,703.49	96.37%	23,721,690.58	3.63%

### 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	中欧鼎利债券 A	49,750.20	0.01%
	中欧鼎利债券 C	0.00	0.00%
	中欧鼎利债券 E	0.00	0.00%
	合计	49,750.20	0.01%

### 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	中欧鼎利债券 A	0
	中欧鼎利债券 C	0
	中欧鼎利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧鼎利债券 A	0
	中欧鼎利债券 C	0
	中欧鼎利债券 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
基金合同生效日（2017 年 9 月 18 日）基金份额总额	141,832,319.99	-	-
本报告期期初基金份额总额	498,987,226.71	119,630,216.28	5,060,938.89
本报告期基金总申购份额	418,237,841.85	114,385.06	16,585,957.36
减：本报告期基金总赎回份额	270,438,036.70	113,733,063.26	21,516,072.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	646,787,031.86	6,011,538.08	130,824.13

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未受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
开源证券	1	606,406,830.17	31.29	452,329.86	31.49	-
兴业证券	1	468,006,404.47	24.15	349,079.34	24.31	-
国都证券	1	465,174,144.80	24.00	342,368.22	23.84	-
广发证券	1	398,683,171.82	20.57	292,459.68	20.36	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
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 (%)
开源证券	109,210,829.29	10.73	-	-	-	-
兴业证券	64,219,592.72	6.31	4,482,494,000.00	51.16	-	-
国都证券	745,733,891.21	73.29	4,279,056,000.00	48.84	-	-
广发证券	98,342,490.57	9.67	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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	中欧鼎利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	2024-01-17
2	中欧鼎利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	2024-01-19
3	中欧鼎利债券型证券投资基金更新招募说明书（2024年1月）	中国证监会指定媒介	2024-01-19
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
5	中欧鼎利债券型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
7	中欧鼎利债券型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
8	中欧鼎利债券型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
10	中欧鼎利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	2024-04-27
11	中欧鼎利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	2024-04-30

12	中欧鼎利债券型证券投资基金更新招募说明书（2024 年 4 月）	中国证监会指定媒介	2024-04-30
13	中欧鼎利债券型证券投资基金更新招募说明书（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
14	中欧鼎利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	2024-06-25

## § 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	2024 年 01 月 24 日至 2024 年 06 月 30 日	0.00	412,162,483.97	0.00	412,162,483.97	63.13%
	2	2024 年 01 月 11 日至 2024 年 01 月 23 日	98,303,927.92	0.00	0.00	98,303,927.92	15.06%
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。

### 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鼎利分级债券型证券投资基金变更注册的相关批复文件
- 2、《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧鼎利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧鼎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

## 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](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 8 月 31 日