

中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

§ 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	12
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中欧睿达 6 个月持有混合	
基金主代码	000894	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 1 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	35,898,583.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧睿达 6 个月持有混合 A	中欧睿达 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	000894	009648
报告期末下属分级基金的份额总额	35,122,172.66 份	776,410.51 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超额收益。
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	沪深 300 指数收益率*17%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%+中债综合财富（总值）指数收益率*80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。

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	招商银行股份有限公司
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	400-61-95555
传真	021-33830351	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	窦玉明	缪建民

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：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：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)	
	中欧睿达 6 个月持有混合 A	中欧睿达 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	1,798,531.73	34,164.13
本期利润	2,060,702.00	37,501.87
加权平均基金份额本期利润	0.0538	0.0489
本期加权平均净值利润率	3.38%	3.12%
本期基金份额净值增长率	3.35%	3.20%
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	21,433,188.32	451,464.55
期末可供分配基	0.6102	0.5815

金份额利润		
期末基金资产净值	56,555,360.98	1,227,875.06
期末基金份额净值	1.6102	1.5815
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	61.02%	21.09%

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

中欧睿达 6 个月持有混合 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	-0.12%	0.11%	0.07%	0.09%	-0.19%	0.02%
过去三个月	1.10%	0.13%	1.29%	0.14%	-0.19%	-0.01%
过去六个月	3.35%	0.15%	3.44%	0.17%	-0.09%	-0.02%
过去一年	2.99%	0.12%	2.66%	0.16%	0.33%	-0.04%
过去三年	5.38%	0.29%	11.34%	0.09%	-5.96%	0.20%
自基金合同生效起至今	61.02%	0.30%	40.67%	0.05%	20.35%	0.25%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*17%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。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。

中欧睿达 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-0.14%	0.11%	0.07%	0.09%	-0.21%	0.02%
过去三个月	1.03%	0.13%	1.29%	0.14%	-0.26%	-0.01%
过去六个月	3.20%	0.15%	3.44%	0.17%	-0.24%	-0.02%
过去一年	2.76%	0.12%	2.66%	0.16%	0.10%	-0.04%
过去三年	4.11%	0.30%	11.34%	0.09%	-7.23%	0.21%
自基金份额起始运 作日至今	21.09%	0.33%	15.94%	0.08%	5.15%	0.25%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*17%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。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

中欧睿达6个月持有混合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：2023 年 8 月 14 日起组合业绩比较基准变更为中债综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*17%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。

中欧睿达6个月持有混合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：2023 年 8 月 14 日起组合业绩比较基准变更为中债综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*17%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%。本基金于 2020 年 6 月 5 日新增 C 份额，图示日期为 2020 年 6 月 9 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		
胡闾洋	基金经理 / 基金经理助理	2022-07-01	-	8 年	历任中诚宝捷思货币经纪有限公司经纪人，上海光大证券资产管理有限公司交易员。2020-11-13 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，其中胡闯洋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

债券上半年经历了顺畅的收益率下行行情，久期策略明显占优。一季度受到权益市场大幅回撤的影响，债券市场的避险功能得到强化。此外，去年四季度地方债和特别国债的供给较高，今年年初的债券供给因此节奏相对放缓，而市场配置力量在每年年初均明显强劲。二者共同作用下，债券市场迎来收益率快速下行的行情。二季度以来，受到手工补息叫停的影响，多个期限国债收益率创历史新低。经济和金融数据显示宏观环境仍在修复的过程中，进一步点燃市场对货币政策的宽松预期。因此，尽管央行多次提示长端债券风险，市场在资产荒和宽松资金的逻辑加成下，

仍然处在震荡下行的趋势中，收益率曲线走陡，中短久期利率债表现更优。而信用债方面，在绝对收益驱使下，市场对长久期资产偏好迅速增加，期限利差显著收窄。长久期信用利差收窄，而短久期信用利差则适度走阔。

A 股市场上，上半年经历了开年的大幅杀跌和节后的快速反弹，而二季度随宏观经济数据走缓，市场再次遭遇震荡回调。整体市场风险偏好集中在分红率较高、公司治理较好的红利价值风格上。七月份以来市场结构发生较大变化，资金持续涌入以银行为代表的大盘价值板块。小盘风格大幅跑输、大盘价值显著跑赢，市场结构明显分化。

转债市场表现出和 A 股相对同频的特征，受风险偏好和流动性影响，转债大幅杀跌后又随 A 股市场一起经历了急速的反弹行情。二季度以来，光伏大盘转债异常下跌以及个别主体信用评级下调，引发市场对信用资质的担忧，低价转债整体表现较差。叠加权益市场回调，转债因流动性较弱而受到更多冲击。

账户操作上，组合配置思路上较为均衡，持续持有高股息和低估值的蓝筹股，作为组合的风险防御资产。持仓结构上仍然偏向资源类和公共事业。债券方面，组合今年更加注重了债券策略的运用。上半年通过增配长久期信用债拉长久期，提高组合杠杆，达到了增厚收益的目标。受利率债波动增大影响，组合也在波段交易上操作更为灵活。

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 3.35%，同期业绩比较基准收益率为 3.44%；基金 C 类份额净值增长率为 3.20%，同期业绩比较基准收益率为 3.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，组合更加关注债券市场供需结构变化以及货币政策和银行间流动性走势。三季度政府债券发行或将提速，叠加人民币汇率的压力，可能对银行间资金面形成一定程度的扰动。央行对于利率走廊的刻画也更加精准和有效，组合也将对此给予更多关注。不过，鉴于目前收益率处在历史低位区间，部分投资者的止盈意愿或相对较强。下半年债券市场的波动率或将会显著增大，如何在快速波动的行情中控制回撤，提高持有人的持有体验，或是组合面临的主要考量。操作上，在保持信用债底仓的基础上，通过灵活的利率和类利率品种交易，增厚组合收益。权益层面，随经济环境的逐渐企稳，市场情绪或将迎来平稳期，组合将积极抓住反弹过程中的交易行情。行业配置上仍以均衡为主，适度增配偏稳定类风格的标的。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	540,980.03	239,517.81
结算备付金		169,101.59	202,220.14
存出保证金		2,498.02	10,593.46
交易性金融资产	6.4.7.2	72,189,438.20	82,515,564.39
其中：股票投资		4,213,288.80	6,850,029.00
基金投资		-	-
债券投资		67,976,149.40	75,665,535.39
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	6.4.7.5	-	-
应收清算款		480.00	334.40
应收股利		-	-
应收申购款		9.99	16,028.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		72,902,507.83	82,984,258.75
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		15,003,832.30	15,215,008.70
应付清算款		1,030.48	103.57
应付赎回款		-	231,071.70
应付管理人报酬		28,584.37	35,153.43
应付托管费		7,146.09	8,788.36
应付销售服务费		301.97	297.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,151.31	2,914.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	75,225.27	60,346.19
负债合计		15,119,271.79	15,553,683.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	35,898,583.17	43,292,891.99
未分配利润	6.4.7.9	21,884,652.87	24,137,683.63
净资产合计		57,783,236.04	67,430,575.62
负债和净资产总计		72,902,507.83	82,984,258.75

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 35,898,583.17 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.6102 元，基金份额总额 35,122,172.66 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.5815 元，基金份额总额 776,410.51 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		2,586,939.76	3,295,887.15
1. 利息收入		3,891.26	72,291.58
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,891.26	17,587.00
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		-	54,704.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,317,540.49	5,608,527.79
其中：股票投资收益	6.4.7.11	990,408.91	4,798,300.16
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.12	1,177,832.98	718,597.89
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	149,298.60	91,629.74
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	265,508.01	-2,385,008.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	75.95
减：二、营业总支出		488,735.89	459,128.77
1. 管理人报酬		185,605.38	295,320.63
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		46,401.32	63,282.98
3. 销售服务费		1,790.01	16,121.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		169,550.01	-
其中：卖出回购金融资产支出		169,550.01	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,992.37	277.00
8. 其他费用	6.4.7.19	83,396.80	84,126.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,098,203.87	2,836,758.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,098,203.87	2,836,758.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,098,203.87	2,836,758.38

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金

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、上期期末净资产	43,292,891.99	-	24,137,683.63	67,430,575.62

二、本期期初净资产	43,292,891.99	-	24,137,683.63	67,430,575.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,394,308.82	-	-2,253,030.76	-9,647,339.58
(一)、综合收益总额	-	-	2,098,203.87	2,098,203.87
(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)	-7,394,308.82	-	-4,351,234.63	-11,745,543.45
其中：1. 基金申购款	364,824.03	-	213,181.40	578,005.43
2. 基金赎回款	-7,759,132.85	-	-4,564,416.03	-12,323,548.88
(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	35,898,583.17	-	21,884,652.87	57,783,236.04
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	50,739,763.61	-	25,761,414.15	76,501,177.76
二、本期期初净资产	50,739,763.61	-	25,761,414.15	76,501,177.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	50,626,109.38	-	30,037,222.17	80,663,331.55
(一)、综合收益总额	-	-	2,836,758.38	2,836,758.38
(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)	50,626,109.38	-	27,200,463.79	77,826,573.17
其中：1. 基金申购款	53,623,036.70	-	28,886,816.17	82,509,852.87
2. 基金赎回款	-2,996,927.32	-	-1,686,352.38	-4,683,279.70

回款				
(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	101,365,872.99	-	55,798,636.32	157,164,509.31

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

中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金(原名为中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 1175 号《关于准予中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,684,766,516.69 份基金份额,包含认购资金利息折合 374,827.80 份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金管理人中欧基金管理有限公司 2020 年 6 月 1 日发布《中欧基金管理有限公司关于增加中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金 C 类份额、调低管理费及托管费率并修订基金合同及托管协议的公告》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 5 日起对本基金增加 C 类份额、调低管理费及托管费率并相应修改基金合同。本基金原份额转为 A 类份额,新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额。新增 C 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司,只接受场外申赎,不参与上市交易。A 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。

经 2023 年 5 月 18 日中国证监会证监许可[2023]第 1118 号《关于准予中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册，并经中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会审议通过，中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金于 2023 年 8 月 14 日变更为中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金。

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》、《中欧睿达 6 个月持有期混合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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金

融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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	540,980.03
等于：本金	540,877.59
加：应计利息	102.44
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	540,980.03

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	4,467,119.77	-	4,213,288.80	-253,830.97	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,081,815.35	280,083.82	18,438,434.22	76,535.05
	银行间市场	48,495,408.13	447,315.18	49,537,715.18	594,991.87
	合计	66,577,223.48	727,399.00	67,976,149.40	671,526.92
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	71,044,343.25	727,399.00	72,189,438.20	417,695.95	

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 其他权益工具投资

6.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 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	15,552.93
其中：交易所市场	11,907.43
银行间市场	3,645.50
应付利息	-
预提费用-审计费	19,890.78
预提费用-信息披露费	39,781.56
合计	75,225.27

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

中欧睿达 6 个月持有混合 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	42,528,095.96	42,528,095.96
本期申购	353,209.55	353,209.55
本期赎回（以“-”号填列）	-7,759,132.85	-7,759,132.85
本期末	35,122,172.66	35,122,172.66

中欧睿达 6 个月持有混合 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	764,796.03	764,796.03
本期申购	11,614.48	11,614.48
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	776,410.51	776,410.51

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。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

中欧睿达 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,276,296.63	-4,545,822.70	23,730,473.93
本期期初	28,276,296.63	-4,545,822.70	23,730,473.93
本期利润	1,798,531.73	262,170.27	2,060,702.00
本期基金份额交易产生的变动数	-5,047,647.48	689,659.87	-4,357,987.61
其中：基金申购款	238,942.15	-32,513.73	206,428.42
基金赎回款	-5,286,589.63	722,173.60	-4,564,416.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,027,180.88	-3,593,992.56	21,433,188.32

中欧睿达 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	487,601.60	-80,391.90	407,209.70
本期期初	487,601.60	-80,391.90	407,209.70
本期利润	34,164.13	3,337.74	37,501.87
本期基金份额交易产生的变动数	7,814.93	-1,061.95	6,752.98
其中：基金申购款	7,814.93	-1,061.95	6,752.98
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	529,580.66	-78,116.11	451,464.55

6.4.7.10 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	1,512.86
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	2,344.93	
其他	33.47	
合计	3,891.26	

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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	14,258,885.42
减：卖出股票成本总额	13,241,063.93
减：交易费用	27,412.58
买卖股票差价收入	990,408.91

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	996,908.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	180,924.49
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	1,177,832.98

6.4.7.12.2 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	57,366,995.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,647,354.67
减：应计利息总额	535,007.32
减：交易费用	3,708.99
买卖债券差价收入	180,924.49

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 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	149,298.60
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	149,298.60

6.4.7.16 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	265,508.01
股票投资	-175,948.51
债券投资	441,456.52
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	265,508.01

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 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	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,124.46
账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	83,396.80

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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	3,364,762.00	13.44	21,325,002.93	84.25

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	7,252,180.82	16.59	20,987,100.35	100.00

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	132,400,000.00	41.65	5,500,000.00	100.00

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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国都证券	2,510.13	13.44	-	-
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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国都证券	15,594.72	84.25	14,125.70	87.75

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	185,605.38	295,320.63
其中：应支付销售机构的客户维护	90,996.51	140,138.31

费		
应支付基金管理人的净管理费	94,608.87	155,182.32

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 根据《中欧基金管理有限公司关于中欧睿达定期开放混合型发起式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 2023 年 8 月 14 日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	46,401.32	63,282.98

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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		
	中欧睿达 6 个月持有 混合 A	中欧睿达 6 个月持有 混合 C	合计
中欧财富	0.00	1,783.79	1,783.79
中欧基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	1,783.79	1,783.79
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		
	中欧睿达 6 个月持有 混合 A	中欧睿达 6 个月持有 混合 C	合计
中欧财富	0.00	1,972.52	1,972.52
中欧基金	0.00	8,395.67	8,395.67
合计	0.00	10,368.19	10,368.19

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 0.50%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

中欧睿达 6 个月持有混合 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	764,796.03		114,854.52
报告期内申购/买入总份额	0.00		649,941.51	
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	764,796.03		764,796.03	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	98.5%		1.42%	

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固有资金投资本基金 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
招商银行股份有限公司	540,980.03	1,512.86	2,980,364.49	17,441.77

注：本基金的银行存款由基金托管人招商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

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 10,003,832.30 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
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 2 日	102.20	100,000	10,219,545.21
240205	24 国开 05	2024 年 7 月 2 日	103.94	6,000	623,625.08
合计				106,000	10,843,170.29

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 5,000,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超额收益。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和反馈。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	3,133,265.12	4,056,789.04

合计	3,133,265.12	4,056,789.04
----	--------------	--------------

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。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	27,525,618.04	39,808,641.55
AAA 以下	6,629,820.70	6,231,514.64
未评级	30,687,445.54	25,568,590.16
合计	64,842,884.28	71,608,746.35

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于约定开放日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于开放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%。在开放期，本基金的基金管理人管理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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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	540,980.03	-	-	-	540,980.03
结算备付金	169,101.59	-	-	-	169,101.59
存出保证金	2,498.02	-	-	-	2,498.02
交易性金融资产	22,795,263.29	38,902,450.98	6,278,435.13	4,213,288.80	72,189,438.20
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
应收清算款	-	-	-	480.00	480.00
资产总计	23,507,842.93	38,902,450.98	6,278,435.13	4,213,778.79	72,902,507.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	28,584.37	28,584.37
应付托管费	-	-	-	7,146.09	7,146.09
应付清算款	-	-	-	1,030.48	1,030.48
卖出回购金融资产款	15,003,832.30	-	-	-	15,003,832.30
应付销售服务费	-	-	-	301.97	301.97
应交税费	-	-	-	3,151.31	3,151.31
其他负债	-	-	-	75,225.27	75,225.27
负债总计	15,003,832.30	-	-	115,439.49	15,119,271.79
利率敏感度缺口	8,504,010.63	38,902,450.98	6,278,435.13	4,098,339.30	57,783,236.04
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	239,517.81	-	-	-	239,517.81
结算备付金	202,220.14	-	-	-	202,220.14
存出保证金	10,593.46	-	-	-	10,593.46
交易性金融资产	9,623,803.52	64,957,830.05	1,083,901.82	6,850,029.00	82,515,564.39
应收申购款	-	-	-	16,028.55	16,028.55
应收清算款	-	-	-	334.40	334.40
资产总计	10,076,134.93	64,957,830.05	1,083,901.82	6,866,391.95	82,984,258.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	231,071.70	231,071.70
应付管理人报酬	-	-	-	35,153.43	35,153.43
应付托管费	-	-	-	8,788.36	8,788.36
应付清算款	-	-	-	103.57	103.57
卖出回购金融资产款	15,215,008.70	-	-	-	15,215,008.70
应付销售服务费	-	-	-	297.16	297.16
应交税费	-	-	-	2,914.02	2,914.02
其他负债	-	-	-	60,346.19	60,346.19
负债总计	15,215,008.70	-	-	338,674.43	15,553,683.13
利率敏感度缺口	-5,138,873.77	64,957,830.05	1,083,901.82	6,527,717.52	67,430,575.62

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	利率上升 25BP	-409,606.57	-391,133.36
	利率下降 25BP	415,168.19	395,197.79

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	4,213,288.80	7.29	6,850,029.00	10.16
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	4,213,288.80	7.29	6,850,029.00	10.16

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

7.29%（2023 年 12 月 31 日：10.16%），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	9,155,183.10	11,733,159.97
第二层次	63,034,255.10	70,782,404.42
第三层次	-	-
合计	72,189,438.20	82,515,564.39

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

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	4,213,288.80	5.78
	其中：股票	4,213,288.80	5.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,976,149.40	93.24
	其中：债券	67,976,149.40	93.24
	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	710,081.62	0.97
8	其他各项资产	2,988.01	0.00
9	合计	72,902,507.83	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	-	-
B	采矿业	304,954.00	0.53
C	制造业	1,902,487.00	3.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,816.00	0.04
E	建筑业	11,280.00	0.02

F	批发和零售业	118,695.60	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	606,111.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,441.00	0.24
J	金融业	845,170.20	1.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	264,334.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	4,213,288.80	7.29

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	601919	中远海控	24,300	376,407.00	0.65
2	600801	华新水泥	26,200	360,250.00	0.62
3	600887	伊利股份	12,300	317,832.00	0.55
4	601598	中国外运	40,800	229,704.00	0.40
5	601369	陕鼓动力	25,700	206,114.00	0.36
6	000719	中原传媒	19,400	196,134.00	0.34
7	600938	中国海油	4,300	141,900.00	0.25
8	002966	苏州银行	16,800	126,000.00	0.22
9	601318	中国平安	3,000	124,080.00	0.21
10	603855	华荣股份	5,600	123,816.00	0.21
11	600919	江苏银行	16,200	120,366.00	0.21
12	601229	上海银行	16,500	119,790.00	0.21
13	600015	华夏银行	18,600	119,040.00	0.21
14	601636	旗滨集团	17,800	114,810.00	0.20
15	002304	洋河股份	1,400	113,036.00	0.20
16	002601	龙佰集团	6,000	111,420.00	0.19
17	601717	郑煤机	7,300	108,040.00	0.19
18	300770	新媒股份	3,200	106,816.00	0.18
19	600926	杭州银行	7,900	103,095.00	0.18
20	601128	常熟银行	13,560	102,649.20	0.18

21	002128	电投能源	4,300	90,730.00	0.16
22	605599	莱百股份	7,000	89,110.00	0.15
23	600219	南山铝业	22,500	85,725.00	0.15
24	600566	济川药业	2,600	82,446.00	0.14
25	000923	河钢资源	4,200	72,324.00	0.13
26	603317	天味食品	5,800	66,178.00	0.11
27	000651	格力电器	1,000	39,220.00	0.07
28	002555	三七互娱	2,500	32,625.00	0.06
29	002839	张家港行	7,500	30,150.00	0.05
30	600694	大商股份	1,760	29,585.60	0.05
31	601019	山东出版	2,500	29,550.00	0.05
32	002236	大华股份	1,700	26,282.00	0.05
33	603299	苏盐井神	2,600	24,700.00	0.04
34	601098	中南传媒	1,700	21,114.00	0.04
35	002034	旺能环境	1,600	20,816.00	0.04
36	603558	健盛集团	2,000	19,900.00	0.03
37	000589	贵州轮胎	3,800	19,266.00	0.03
38	603088	宁波精达	2,400	18,072.00	0.03
39	601928	凤凰传媒	1,600	17,536.00	0.03
40	603676	卫信康	2,000	16,020.00	0.03
41	300841	康华生物	300	15,192.00	0.03
42	002043	兔宝宝	1,400	14,518.00	0.03
43	000700	模塑科技	2,200	11,550.00	0.02
44	000928	中钢国际	1,800	9,990.00	0.02
45	000877	天山股份	1,500	8,100.00	0.01
46	600502	安徽建工	300	1,290.00	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	000719	中原传媒	399,494.00	0.59
2	600801	华新水泥	393,932.00	0.58
3	601919	中远海控	373,532.00	0.55
4	600887	伊利股份	356,699.00	0.53
5	000651	格力电器	274,785.00	0.41
6	002555	三七互娱	270,583.00	0.40
7	601019	山东出版	263,883.00	0.39
8	601288	农业银行	260,078.00	0.39
9	601098	中南传媒	259,939.00	0.39
10	002236	大华股份	257,984.00	0.38
11	601928	凤凰传媒	254,118.00	0.38
12	600019	宝钢股份	249,480.00	0.37

13	000877	天山股份	248,163.00	0.37
14	601598	中国外运	244,416.00	0.36
15	000830	鲁西化工	238,800.00	0.35
16	600066	宇通客车	230,293.00	0.34
17	601369	陕鼓动力	230,272.00	0.34
18	000928	中钢国际	226,946.00	0.34
19	002601	龙佰集团	224,359.00	0.33
20	600908	无锡银行	223,771.00	0.33

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	600019	宝钢股份	543,488.00	0.81
2	600066	宇通客车	490,981.00	0.73
3	601838	成都银行	355,842.00	0.53
4	601857	中国石油	354,123.00	0.53
5	002818	富森美	346,790.00	0.51
6	600398	海澜之家	337,924.00	0.50
7	601717	郑煤机	335,926.00	0.50
8	601998	中信银行	324,592.00	0.48
9	600028	中国石化	309,237.00	0.46
10	601577	长沙银行	308,309.00	0.46
11	601636	旗滨集团	302,429.00	0.45
12	000651	格力电器	300,238.00	0.45
13	001965	招商公路	294,971.00	0.44
14	601000	唐山港	294,111.00	0.44
15	600377	宁沪高速	293,920.32	0.44
16	002027	分众传媒	293,721.00	0.44
17	600461	洪城环境	289,614.00	0.43
18	600926	杭州银行	289,493.00	0.43
19	000157	中联重科	289,264.00	0.43
20	601288	农业银行	283,176.00	0.42

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	10,780,272.24
卖出股票收入（成交）总额	14,258,885.42

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	3,133,265.12	5.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,168,765.81	52.21
	其中：政策性金融债	15,416,420.89	26.68
4	企业债券	10,363,274.80	17.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,368,949.37	33.52
7	可转债（可交换债）	4,941,894.30	8.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,976,149.40	117.64

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	230208	23 国开 08	100,000	10,219,545.21	17.69
2	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	50,000	5,285,483.61	9.15
3	2023014	20 中国人寿财险	50,000	5,277,795.08	9.13
4	137943	22 电建 Y2	50,000	5,206,233.70	9.01
5	240205	24 国开 05	50,000	5,196,875.68	8.99

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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，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。中信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。中国人寿财产保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到原浙江银保监局的处罚。

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	2,498.02
2	应收清算款	480.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,988.01

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	111015	东亚转债	75,737.22	0.13
2	123184	天阳转债	74,758.60	0.13
3	113651	松霖转债	74,566.93	0.13
4	128087	孚日转债	74,523.69	0.13
5	113069	博 23 转债	74,414.10	0.13
6	123178	花园转债	74,278.93	0.13
7	127095	广泰转债	73,958.76	0.13
8	113658	密卫转债	73,095.37	0.13
9	127075	百川转 2	72,419.61	0.13

10	123194	百洋转债	72,331.04	0.13
11	127035	濮耐转债	72,161.69	0.12
12	127084	柳工转 2	67,276.87	0.12
13	113673	岱美转债	66,797.36	0.12
14	123205	大叶转债	60,584.40	0.10
15	118046	诺泰转债	59,218.17	0.10
16	128066	亚泰转债	59,083.10	0.10
17	113532	海环转债	59,033.80	0.10
18	113662	豪能转债	58,915.03	0.10
19	123222	博俊转债	57,595.89	0.10
20	111011	冠盛转债	57,324.51	0.10
21	111013	新港转债	52,305.45	0.09
22	123218	宏昌转债	52,039.66	0.09
23	123201	纽泰转债	51,490.32	0.09
24	123223	九典转 02	47,941.21	0.08
25	123190	道氏转 02	47,074.61	0.08
26	113530	大丰转债	45,252.21	0.08
27	127060	湘佳转债	44,514.00	0.08
28	128105	长集转债	44,164.20	0.08
29	113050	南银转债	43,894.23	0.08
30	111005	富春转债	43,823.89	0.08
31	113046	金田转债	43,735.46	0.08
32	123228	震裕转债	43,729.68	0.08
33	118022	锂科转债	43,651.62	0.08
34	127078	优彩转债	43,528.56	0.08
35	113065	齐鲁转债	43,319.09	0.07
36	127042	嘉美转债	43,301.95	0.07
37	113653	永 22 转债	43,278.69	0.07
38	127067	恒逸转 2	43,278.31	0.07
39	118030	睿创转债	43,177.11	0.07
40	113068	金铜转债	43,168.38	0.07
41	128130	景兴转债	43,135.78	0.07
42	123121	帝尔转债	43,131.25	0.07
43	123117	健帆转债	43,109.59	0.07
44	110084	贵燃转债	43,041.24	0.07
45	113657	再 22 转债	43,017.79	0.07
46	113652	伟 22 转债	42,982.40	0.07
47	118043	福立转债	42,962.82	0.07
48	127034	绿茵转债	42,945.69	0.07
49	123133	佩蒂转债	42,939.48	0.07
50	123179	立高转债	42,924.71	0.07
51	123216	科顺转债	42,915.44	0.07
52	113037	紫银转债	42,823.25	0.07

53	113047	旗滨转债	42,764.25	0.07
54	111002	特纸转债	42,742.55	0.07
55	113059	福莱转债	42,724.82	0.07
56	118028	会通转债	42,652.43	0.07
57	113638	台 21 转债	42,595.45	0.07
58	128129	青农转债	42,570.14	0.07
59	113661	福 22 转债	42,542.13	0.07
60	111004	明新转债	42,505.53	0.07
61	113632	鹤 21 转债	42,481.92	0.07
62	113584	家悦转债	42,481.03	0.07
63	127070	大中转债	42,443.46	0.07
64	110076	华海转债	42,354.91	0.07
65	113606	荣泰转债	42,340.43	0.07
66	113056	重银转债	42,299.08	0.07
67	118013	道通转债	42,254.86	0.07
68	128116	瑞达转债	42,163.33	0.07
69	113042	上银转债	42,059.20	0.07
70	128135	洽洽转债	42,004.28	0.07
71	110059	浦发转债	41,904.64	0.07
72	127068	顺博转债	41,802.65	0.07
73	127077	华宏转债	41,711.05	0.07
74	113545	金能转债	38,871.27	0.07
75	111012	福新转债	38,369.97	0.07
76	123127	耐普转债	37,502.67	0.06
77	123061	航新转债	37,149.52	0.06
78	123209	聚隆转债	36,829.40	0.06
79	113546	迪贝转债	36,660.48	0.06
80	128138	侨银转债	36,547.42	0.06
81	127053	豪美转债	34,430.63	0.06
82	113527	维格转债	33,772.17	0.06
83	113602	景 20 转债	31,765.87	0.05
84	123220	易瑞转债	31,699.14	0.05
85	113667	春 23 转债	31,461.54	0.05
86	127032	苏行转债	31,425.75	0.05
87	113672	福蓉转债	31,006.03	0.05
88	113669	景 23 转债	30,435.08	0.05
89	123204	金丹转债	30,291.23	0.05
90	123180	浙矿转债	30,249.88	0.05
91	128117	道恩转债	29,971.81	0.05
92	113648	巨星转债	29,945.28	0.05
93	127059	永东转 2	29,795.95	0.05
94	123170	南电转债	29,440.46	0.05
95	123191	智尚转债	29,134.05	0.05

96	123219	宇瞳转债	29,031.30	0.05
97	123226	中富转债	28,440.08	0.05
98	128128	齐翔转 2	28,348.79	0.05
99	127092	运机转债	27,952.09	0.05
100	123203	明电转 02	24,718.75	0.04
101	113628	晨丰转债	23,294.01	0.04
102	128090	汽模转 2	22,667.72	0.04
103	123089	九洲转 2	22,258.31	0.04
104	113674	华设转债	21,858.06	0.04
105	123130	设研转债	21,668.13	0.04
106	128071	合兴转债	21,651.70	0.04
107	123227	雅创转债	21,147.49	0.04
108	123087	明电转债	20,830.55	0.04
109	123048	应急转债	20,500.90	0.04
110	110060	天路转债	19,533.08	0.03
111	123206	开能转债	15,595.78	0.03
112	123152	润禾转债	15,021.98	0.03
113	123177	测绘转债	14,904.73	0.03
114	123143	胜蓝转债	14,850.18	0.03
115	110052	贵广转债	14,452.68	0.03

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
中欧睿达 6 个月持有混合 A	424	82,835.31	0.00	0.00%	35,122,172.66	100.00%
中欧睿达 6 个月持有混合 C	44	17,645.69	764,796.03	98.50%	11,614.48	1.50%

合计	468	76,706.37	764,796.03	2.13%	35,133,787.14	97.87%
----	-----	-----------	------------	-------	---------------	--------

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	中欧睿达 6 个月持有混合 A	0.00	0.00%
	中欧睿达 6 个月持有混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

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	中欧睿达 6 个月持有混合 A	0
	中欧睿达 6 个月持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧睿达 6 个月持有混合 A	0
	中欧睿达 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧睿达 6 个月持有混合 A	中欧睿达 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 (2014 年 12 月 1 日) 基金份额总额	2,684,766,516.69	-
本报告期期初基金份额总额	42,528,095.96	764,796.03
本报告期基金总申购份额	353,209.55	11,614.48
减：本报告期基金总赎回份额	7,759,132.85	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	35,122,172.66	776,410.51

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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员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

报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

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 (%)	
太平洋证券	1	8,934,257.34	35.68	6,664.51	35.68	-
长江证券	2	5,789,735.00	23.12	4,318.66	23.12	-
国都证券	2	3,364,762.00	13.44	2,510.13	13.44	-
天风证券	1	2,671,269.32	10.67	1,992.48	10.67	-

开源证券	1	2,165,639.00	8.65	1,615.39	8.65	-
方正证券	1	1,227,404.00	4.90	915.47	4.90	-
摩根大通	2	465,797.00	1.86	347.54	1.86	-
华西证券	1	415,918.00	1.66	310.34	1.66	-
东吴证券	1	4,376.00	0.02	3.26	0.02	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

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 (%)
太平洋证券	10,384,451.66	23.76	71,900,000.00	22.62	-	-
长江证券	10,797,319.70	24.70	-	-	-	-
国都证券	7,252,180.82	16.59	132,400,000.00	41.65	-	-
天风证券	2,616,479.17	5.99	72,500,000.00	22.81	-	-
开源证券	5,176,177.84	11.84	-	-	-	-
方正证券	1,115,644.08	2.55	19,650,000.00	6.18	-	-
摩根大通	3,150,967.49	7.21	21,400,000.00	6.73	-	-

华西证 券	1,595,061.7 5	3.65	-	-	-	-
东吴证 券	1,623,657.1 5	3.71	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
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
2	中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
4	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
5	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	2024-04-16
6	中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-16
7	中欧睿达 6 个月持有期混合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
8	中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资	中国证监会指定媒介	2024-06-25

资基金基金产品资料概要更新		
---------------	--	--

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

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、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金变更注册文件
- 2、《中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧睿达 6 个月持有期混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 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

2024 年 8 月 31 日