

# 中欧磐固债券型证券投资基金

## 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 01 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中欧磐固债券
基金主代码	019417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	1,515,748,895.68 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。</p> <p>战略资产配置策略（SAA）是决定基金长期收益率和波动率的关键，也是基金力争实现将基金投资组合长期波动率控制在合适水平这一投资目标的核心。本基金的战略资产配置策略（SAA）将从国内股票和债券市场的风险收益特征出发，通过综合分析宏观政策、经济周期、行业发展趋势、市场流动性水平，投资人风险收益偏好等因素，以分散投资的方式，锚定长期目标波动率，进行有效的长期资产配置。</p> <p>本基金的战术资产配置策略（TAA）是指会更多着眼于在充分研究分析诸如细分经济周期、各项经济指标、货币政策变化、利率水平、信用利差变化、突发事件性因素等中短期市场变化的基础上，根据具体不同市场形势的具体转变而对基金各类资产组合既定长期投资比例所进行的动态调整，力争使基金投资组合的长期波动率与目标值不发生重大偏离。通过战术资产配置，本基金将在</p>

	战略资产配置层面实现对长期资产配置的优化，力争获取超额回报。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率 $\times$ 12% + 中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 3% + 中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 85%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
下属分级基金的交易代码	019417	019418
报告期末下属分级基金的份额总额	651,804,638.17 份	863,944,257.51 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日)	
	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
1. 本期已实现收益	19,406,151.77	16,822,937.37
2. 本期利润	13,832,769.74	16,546,992.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0311
4. 期末基金资产净值	706,492,352.58	932,028,946.07
5. 期末基金份额净值	1.0839	1.0788

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
 2. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧磐固债券 A

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

过去三个月	2.57%	0.31%	2.24%	0.24%	0.33%	0.07%
过去六个月	4.29%	0.27%	5.39%	0.22%	-1.10%	0.05%
过去一年	7.50%	0.21%	8.82%	0.18%	-1.32%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.39%	0.19%	9.61%	0.18%	-1.22%	0.01%

## 中欧磐固债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.47%	0.31%	2.24%	0.24%	0.23%	0.07%
过去六个月	4.08%	0.27%	5.39%	0.22%	-1.31%	0.05%
过去一年	7.07%	0.21%	8.82%	0.18%	-1.75%	0.03%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.19%	9.61%	0.18%	-1.73%	0.01%

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



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 11 月 2 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。



注：本基金基金合同生效日期为 2023 年 11 月 2 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
华李成	多资产投 决会委员 /多资产 公募组组 长/基金 经理	2023-11-02	-	10 年	历任浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资经理。 2016-05-09 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规

和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。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 6 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年四季度，股票在经历 9 月末快速上涨后转为震荡，但受益于成交量维持高位，市场结构性机会较多，赚钱效应回暖。四季度，中证 800 指数下跌 1.62%，中债新综合财富（1 至 3 年）指数上涨 1.33%。

股票层面，国庆假期过后，市场高涨情绪在 10 月 8 日开盘时达到高点，但客观来说，如此高的波动率和换手率是难以持续的，市场也迅速回归理性，指数走势转为震荡。尽管事后看指数层面机会不大，但受益于风险偏好和成交量维持高位，小盘成长风格表现较好，AI、机器人、新零售等结构性机会层出不穷，赚钱效应相较于前期明显回暖。转债作为同样具有小盘成长风格暴露的品种，并受益于自身估值优势，在期间也取得较好的表现。

债券层面，10-11 月，市场博弈政策效果，收益率保持区间震荡。进入 12 月后，货币政策宽松预期显著升温，市场开始提前定价。

四季度组合坚持资产配置理念，适时调整组合股债配置，利用股债相关性特征较好地实现了组合分散化，优化了组合风险收益特征。股票方面，组合采用多策略管理框架，充分发挥不同策略间的分散化效果来平滑组合波动，通过策略配置权重调整来更好地契合市场节奏，并积极参与 ETF 交易，灵活调整仓位和结构，把握结构性机会，力求实现收益增厚；债券方面，组合在坚持高等级信用债配置策略的基础上，组合也积极根据市场情况调节债券久期；转债方面，组合根据市场走势和投资判断，积极参与转债投资，较好把握了市场机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准收益率为 2.24%；基金 C 类份额净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准收益率为 2.24%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	90,847,481.95	4.85
	其中：股票	90,847,481.95	4.85
2	基金投资	130,473,150.82	6.97
3	固定收益投资	1,616,814,008.06	86.39
	其中：债券	1,616,814,008.06	86.39
	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	13,276,623.60	0.71
8	其他资产	20,062,007.69	1.07
9	合计	1,871,473,272.12	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,774,071.00	0.11
B	采矿业	2,674,258.00	0.16
C	制造业	58,165,104.22	3.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,119,057.00	0.25
E	建筑业	72,316.00	0.00
F	批发和零售业	621,240.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,411,613.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,516,846.25	0.09

J	金融业	16,296,156.00	0.99
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	1,196,820.48	0.07
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	90,847,481.95	5.54

### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	13,900	1,946,556.00	0.12
2	300750	宁德时代	7,300	1,941,800.00	0.12
3	600519	贵州茅台	1,200	1,828,800.00	0.11
4	605333	沪光股份	52,700	1,719,601.00	0.10
5	002273	水晶光电	73,800	1,639,836.00	0.10
6	000333	美的集团	21,500	1,617,230.00	0.10
7	600008	首创环保	438,100	1,436,968.00	0.09
8	601919	中远海控	88,000	1,364,000.00	0.08
9	002970	锐明技术	27,900	1,328,877.00	0.08
10	601319	中国人保	162,000	1,234,440.00	0.08

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	264,198,974.99	16.12
2	央行票据	—	—
3	金融债券	514,104,245.22	31.38
	其中：政策性金融债	145,671,474.85	8.89
4	企业债券	157,159,869.04	9.59
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	380,635,407.13	23.23
7	可转债(可交换债)	72,332,618.37	4.41
8	同业存单	197,000,788.91	12.02
9	其他	31,382,104.40	1.92
10	合计	1,616,814,008.06	98.68

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112406409	24 交通银行 CD409	1,000,000	98,485,366.58	6.01
2	2400006	24 特别国债 06	600,000	64,123,723.76	3.91
3	240011	24 附息国债 11	600,000	63,277,209.94	3.86
4	240203	24 国开 03	500,000	52,661,612.02	3.21
5	102282050	22 国新控股 MTN002(能源保供特别债)	500,000	51,579,780.82	3.15

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
TL2503	30 年期国债	20	23,764,000.00	324,400.00	套保

	2503				
公允价值变动总额合计 (元)				324,400.00	
国债期货投资本期收益 (元)				-61.40	
国债期货投资本期公允价值变动 (元)				324,400.00	

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以力争相应债券组合的超额收益。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。兴业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福建监管局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	951,562.17
2	应收证券清算款	4,137,623.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,972,821.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,062,007.69

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	---------------

1	118013	道通转债	1, 182, 288. 14	0.07
2	127043	川恒转债	1, 166, 908. 57	0.07
3	123228	震裕转债	1, 153, 342. 02	0.07
4	123178	花园转债	1, 114, 359. 56	0.07
5	128144	利民转债	1, 112, 894. 52	0.07
6	128132	交建转债	1, 110, 208. 08	0.07
7	123146	中环转 2	1, 086, 169. 22	0.07
8	127076	中宠转 2	1, 059, 622. 46	0.06
9	113667	春 23 转债	1, 044, 214. 20	0.06
10	123225	翔丰转债	995, 745. 12	0.06
11	123078	飞凯转债	974, 581. 79	0.06
12	113629	泉峰转债	930, 690. 27	0.06
13	118037	上声转债	921, 250. 08	0.06
14	127099	盛航转债	917, 203. 33	0.06
15	127051	博杰转债	906, 854. 59	0.06
16	127072	博实转债	898, 899. 79	0.05
17	123221	力诺转债	880, 078. 28	0.05
18	113069	博 23 转债	851, 825. 22	0.05
19	123190	道氏转 02	803, 739. 60	0.05
20	111008	沿浦转债	788, 548. 59	0.05
21	118030	睿创转债	781, 896. 49	0.05
22	123227	雅创转债	774, 540. 00	0.05
23	123220	易瑞转债	764, 331. 49	0.05
24	110090	爱迪转债	758, 904. 95	0.05
25	128081	海亮转债	758, 427. 35	0.05
26	110087	天业转债	744, 946. 15	0.05
27	113056	重银转债	743, 163. 53	0.05
28	113042	上银转债	741, 925. 76	0.05
29	123237	佳禾转债	740, 771. 96	0.05
30	113655	欧 22 转债	740, 429. 56	0.05
31	118024	冠宇转债	739, 320. 09	0.05
32	113052	兴业转债	739, 209. 67	0.05
33	128129	青农转债	738, 803. 59	0.05
34	110086	精工转债	736, 573. 80	0.04
35	113037	紫银转债	734, 438. 01	0.04
36	127049	希望转 2	733, 230. 64	0.04
37	123107	温氏转债	731, 391. 27	0.04
38	127103	东南转债	723, 984. 34	0.04
39	123216	科顺转债	721, 998. 42	0.04
40	123158	宙邦转债	720, 118. 29	0.04
41	113044	大秦转债	715, 492. 50	0.04
42	123119	康泰转 2	709, 307. 02	0.04

43	128109	楚江转债	700,521.60	0.04
44	118042	奥维转债	687,920.64	0.04
45	118028	会通转债	687,010.58	0.04
46	127019	国城转债	684,242.62	0.04
47	127068	顺博转债	677,033.32	0.04
48	113046	金田转债	676,791.58	0.04
49	113068	金铜转债	672,940.10	0.04
50	113679	芯能转债	662,816.96	0.04
51	113658	密卫转债	658,564.84	0.04
52	127015	希望转债	658,530.28	0.04
53	113640	苏利转债	655,210.03	0.04
54	113647	禾丰转债	655,187.33	0.04
55	127052	西子转债	652,496.07	0.04
56	113033	利群转债	651,305.46	0.04
57	127102	浙建转债	646,035.36	0.04
58	113648	巨星转债	642,845.63	0.04
59	123194	百洋转债	641,496.75	0.04
60	127092	运机转债	640,797.93	0.04
61	113549	白电转债	637,281.02	0.04
62	127026	超声转债	624,019.16	0.04
63	127105	龙星转债	619,457.30	0.04
64	123133	佩蒂转债	613,514.38	0.04
65	111014	李子转债	604,688.91	0.04
66	118041	星球转债	602,472.07	0.04
67	111009	盛泰转债	599,035.69	0.04
68	113676	荣 23 转债	597,600.24	0.04
69	127088	赫达转债	597,499.62	0.04
70	118003	华兴转债	597,009.95	0.04
71	127060	湘佳转债	596,383.84	0.04
72	113638	台 21 转债	596,058.48	0.04
73	128116	瑞达转债	593,528.89	0.04
74	123076	强力转债	590,884.59	0.04
75	123091	长海转债	584,341.26	0.04
76	123222	博俊转债	578,285.40	0.04
77	123132	回盛转债	567,631.34	0.03
78	123112	万讯转债	560,369.15	0.03
79	118039	煜邦转债	535,844.49	0.03
80	128138	侨银转债	527,685.50	0.03
81	111011	冠盛转债	526,200.76	0.03
82	123089	九洲转 2	521,126.04	0.03
83	123157	科蓝转债	510,177.90	0.03
84	113054	绿动转债	494,060.00	0.03

85	113641	华友转债	491,077.03	0.03
86	123184	天阳转债	485,380.51	0.03
87	123092	天壕转债	477,744.42	0.03
88	123223	九典转 02	470,266.51	0.03
89	123196	正元转 02	460,465.04	0.03
90	123141	宏丰转债	456,919.00	0.03
91	123189	晓鸣转债	445,972.21	0.03
92	123200	海泰转债	444,381.81	0.03
93	123211	阳谷转债	441,600.95	0.03
94	113609	永安转债	398,842.36	0.02
95	123152	润禾转债	358,163.69	0.02
96	113030	东风转债	352,357.08	0.02
97	123209	聚隆转债	346,620.74	0.02
98	118021	新致转债	345,242.93	0.02
99	113668	鹿山转债	334,636.76	0.02
100	123067	斯莱转债	307,273.94	0.02

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## §6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	513690	博时恒生高股息 ETF	交易型开放式	30,340,400.00	27,397,381.20	1.67	否
2	515180	易方达中证红利 ETF	交易型开放式	13,500,000.00	18,630,000.00	1.14	否
3	159792	富国中证港股通互联互通 ETF	交易型开放式	25,000,000.00	17,375,000.00	1.06	否
4	159998	天弘中证计算机主	交易型开放式	12,725,400.00	11,211,077.40	0.68	否

		题 ETF					
5	516310	易方达中证银行 ETF	交易型开放式	9,000,000.00	10,917,000.00	0.67	否
6	513600	南方恒生指数 ETF	交易型开放式	4,000,000.00	9,244,000.00	0.56	否
7	560050	汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF	交易型开放式	10,895,700.00	9,010,743.90	0.55	否
8	512070	易方达沪深 300 非银 ETF	交易型开放式	10,000,000.00	8,130,000.00	0.50	否
9	512200	南方中证全指房地产 ETF	交易型开放式	5,000,000.00	7,310,000.00	0.45	否
10	159735	港股消费	交易型开放式	9,999,924.00	6,799,948.32	0.42	否

注：本基金为债券型基金，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金，本基金管理人根据基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期投资基金的情况。

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024 年 10 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	—	—
当期交易基金产生的赎回费(元)	—	—
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	—	—
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	83,552.43	—
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	17,153.90	—
当期交易所交易基金产生的交易费(元)	10,862.18	—

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧磐固债券 A	中欧磐固债券 C
报告期期初基金份额总额	567,769,311.42	404,920,076.51
报告期期间基金总申购份额	338,630,676.25	814,223,765.71
减:报告期期间基金总赎回份额	254,595,349.50	355,199,584.71
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	651,804,638.17	863,944,257.51

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。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新;
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

### 10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 10.3 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

2025 年 1 月 22 日