

中欧融恒平衡混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称 | 中欧融恒平衡混合 | |
| 基金主代码 | 017998 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 21 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 219,698,911.85 份 | |
| 投资目标 | 在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*45%+中债综合财富(总值)指数收益率*50%+中证港股通综合指数收益率*5% | |
| 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。本基金如投资港股通标的股票，还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 | 江苏银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧融恒平衡混合 A | 中欧融恒平衡混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017998 | 017999 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 179,613,708.48 份 | 40,085,203.37 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 中欧融恒平衡混合 A | 中欧融恒平衡混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -45,054.64 | 199,712.64 |
| 2. 本期利润 | 13,810,781.25 | 4,490,162.31 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0598 | 0.0690 |
| 4. 期末基金资产净值 | 183,728,434.63 | 40,871,256.23 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0229 | 1.0196 |

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

中欧融恒平衡混合 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 | 5.07% | 0.76% | -1.91% | 0.43% | 6.98% | 0.33% |
| 过去六个月 | 2.32% | 0.75% | -3.46% | 0.41% | 5.78% | 0.34% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.29% | 0.72% | -1.92% | 0.41% | 4.21% | 0.31% |

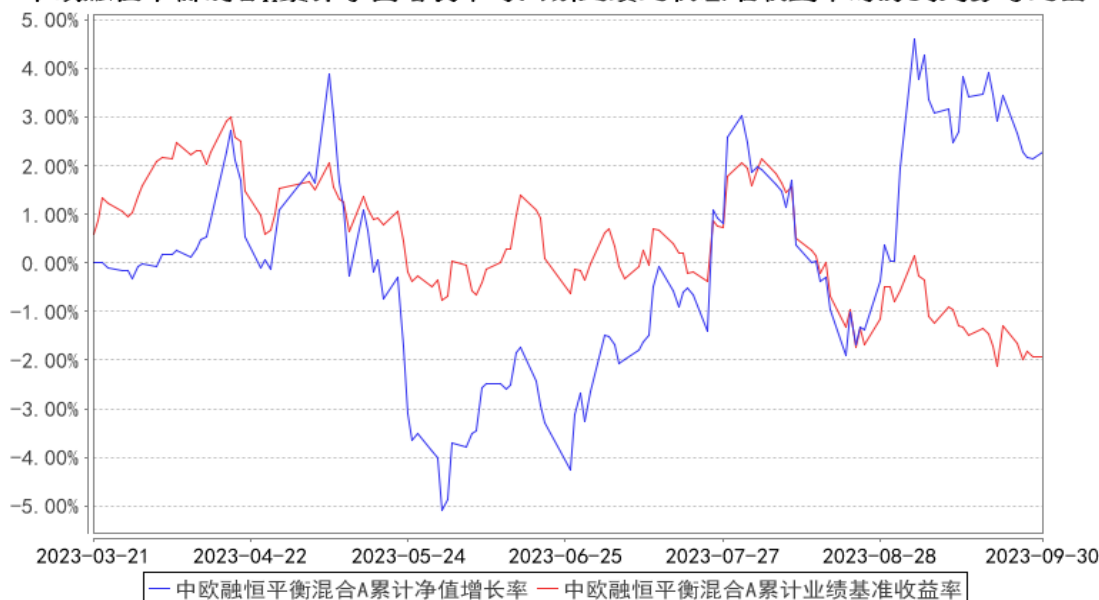
中欧融恒平衡混合 C

| 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 | 4.91% | 0.76% | -1.91% | 0.43% | 6.82% | 0.33% |
| 过去六个月 | 2.01% | 0.75% | -3.46% | 0.41% | 5.47% | 0.34% |

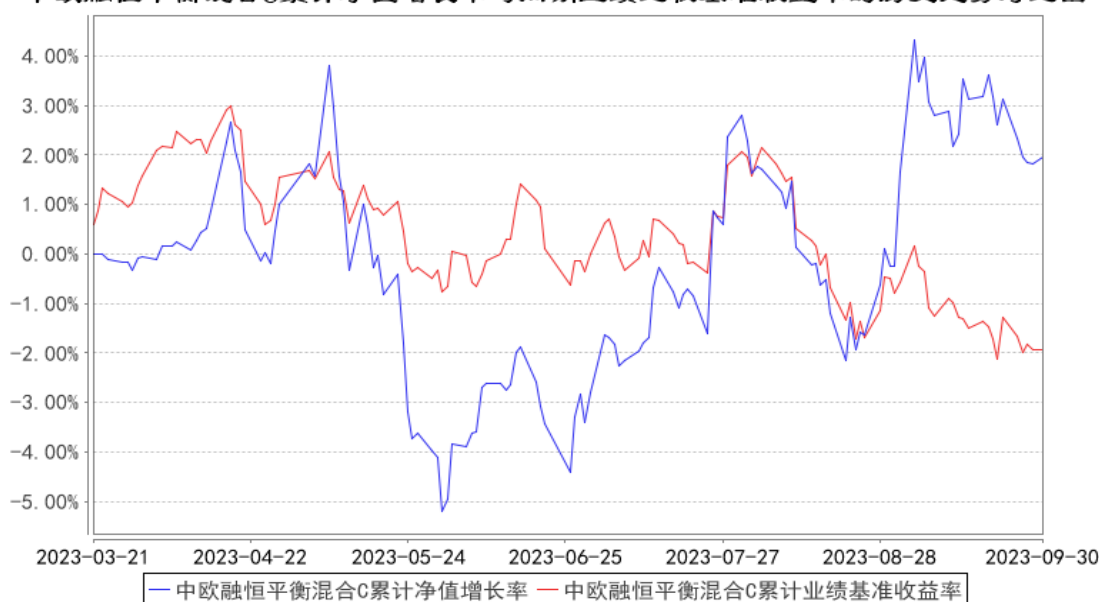
| | | | | | | |
|----------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 自基金合同 生效起至今 | 1.96% | 0.72% | -1.92% | 0.41% | 3.88% | 0.31% |
|----------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|

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

中欧融恒平衡混合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



中欧融恒平衡混合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：本基金基金合同生效日期为 2023 年 3 月 21 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，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应当符合基金合同约定。

§ 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 | | |
| 蓝小康 | 权益投决 会委员/ 基金经理 /投资经 理 | 2023-03-21 | - | 12 年 | 历任日信证券研究所行业研究员,新华基金管理有限公司行业研究员,毕盛资产管理有限公司投资经理,北京新华汇嘉投资管理有限公司研究总监。2016-12-12 加入中欧基金管理有限公司。 |

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|-----|----------|---------|-------------------|-----------------|
| 蓝小康 | 公募基金 | 4 | 8,362,608,001.76 | 2017 年 5 月 11 日 |
| | 私募资产管理计划 | 3 | 9,326,571,108.57 | 2022 年 6 月 21 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 7 | 17,689,179,110.33 | - |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 35 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

三季度市场走势跟基本面的情况出现背离。三季度以来，无论是政策面还是经济基本面都利好资本市场，但市场仍在持续下跌。

7 月会议分析研究当前经济形势，部署下半年经济工作。从会议对经济形势定调来看，会议认为今年以来国民经济持续恢复、总体回升向好，但是边际上也指出“国内需求不足”，要求“加大宏观政策调控力度”，“加强逆周期调节和政策储备”。具体来看，会议对房地产、地方政府债务、资本市场等领域有了新提法。后续各相关部门也做出了迅速响应。然而政策面的友好、基本面数据的再次转好并未带来资本市场的回应，三季度各主要指数仍呈现下跌态势，悲观情绪甚浓。

从二季度开始一直延续到三季度，通缩在被市场讨论，即中国是否会如日本一样进入资产负债表衰退。投资者对于未来的担心主要集中在两方面：第一，房地产和地方债务爆发风险引发资产负债表持续衰退，重蹈日本九十年代覆辙；第二，美国跟中国经济脱钩。

首先，我们相信决策层的智慧和能力。在新中国发展历史中，我们经历了诸多考验，最后都能面对挑战，解决问题。2018 年贸易摩擦发生后，我们努力转型，在新能源、新能源车、半导体等方向都取得跨越式发展，最终让美国在贸易摩擦中未能获得其预期的效果，甚至美国政府的这种做法还加剧其社会的通胀。从资本市场 2019 年到 2021 年的表现来看，对于转型，投资者选择了相信决策层，那么当决策层认知到房地产和地方政府债对于系统稳定的重要性后，我们同样相信他们能处理好这两个重要问题。

至于众多投资者拿日本作为研究参考，我们认可这种借鉴有一定合理性，但需要指出的是中国是独立主权国家，具有独立货币主权，且我们在资本项有管制；中国的内循环具有相当大的经济体量；从全球视角来看，我们的平价购买力全球第一，可贸易品占比世界第一，是世界实体经济的火车头；且我国是贸易顺差大国，从这个意义上来讲，人民币汇率的持续贬值缺乏基础。

综上，我们认为决策层有能力解决房地产和地方债务问题，不会陷入资产负债表持续衰退。

投资者第二个关心的问题是美国与中国的脱钩。从过去五年多中美贸易摩擦中能看到，中国的竞争力无法随意被撼动。投资者对中国的形象和竞争力认知存在偏差。中国不再是一个纯粹的

低附加值加工制造业国家。新能源、汽车、半导体、机械等众多制造业环节其科技含量已经较高，中国已从过往的靠低廉劳动力获胜的时代走出来，更依赖工程师红利和高效的客户服务能力，依靠完善的基础设施、高效的物流运输参与全球竞争，甚至在重卡、挖掘机、乘用车等领域逐渐构建品牌竞争力。这与印度、越南、墨西哥等国家有根本差别。诸多产业环节这些国家难以在短期对中国形成替代。因此美国想摆脱中国的供应链并不容易，在电子、汽车、医药、新能源等重要领域双方仍将保持长期合作。

另外，中国广阔的市场也是美国企业不想失去的。中国不仅是供应链大国，也是世界最重要的市场之一，中国有十四亿人口，近四亿的中产。中国广阔的市场是我们最重要的资源之一。

因此，我们认为市场对于中美脱钩担心似已过度，基于此看空中国资产恐要犯错。

展望后市，我们能清晰看到政策面持续向好，企业家、投资者的各项关切监管层都给予了快速反馈。经济基本面来看，固定资产投资增速、社零增速、工业增加值、PPI 指数都转头向上，宏观经济企稳态势明确；资产市场层面，决策层把活跃资本市场放在较高位置，无论是印花税下调，还是减持、分红等政策的修订，对资本市场都非常有利，支持资本市场长期走强。因此，我们坚定看好资本市场的表现，在这个位置进行投资，投资者在未来取得稳健投资回报的可能性较高。从结构来看，我们认为投资者对于传统低估值行业的认知偏见较大，随着房地产、地方债的风险下降，相关传统行业潜在的投资回报更为可观。

具体到行业上，我们重点关注有色、石油煤炭、建筑、工程机械与重卡、造船、非银、银行、化工等行业的投资机会，成长方向我们重点关注电子和半导体、新材料以及医药等行业的投资机会。

与本人管理的其他产品不同，从长期来讲本产品对波动的关注度更高，更加关注波动与收益的平衡。但由于当前市场投资者处于情绪的低迷期，市场的估值也处在相对较低的位置，正是逆向价值投资、争取长期投资收益的好时点，因此本产品目前的仓位处于合同规定范围内的较高水平，提请投资者注意。

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 5.07%，同期业绩比较基准收益率为-1.91%；基金 C 类份额净值增长率为 4.91%，同期业绩比较基准收益率为-1.91%。

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 | 147,629,725.87 | 64.78 |
| | 其中：股票 | 147,629,725.87 | 64.78 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 36,424,018.92 | 15.98 |
| | 其中：债券 | 36,424,018.92 | 15.98 |
| | 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 | 20,000,000.00 | 8.78 |
| | 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 | 21,177,793.26 | 9.29 |
| 8 | 其他资产 | 2,660,991.06 | 1.17 |
| 9 | 合计 | 227,892,529.11 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 43,144,319.83 元，占基金资产净值比例 19.21%。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 22,757,541.13 | 10.13 |
| C | 制造业 | 52,622,241.63 | 23.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 8,970,984.00 | 3.99 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 277,950.00 | 0.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 163,043.28 | 0.07 |
| J | 金融业 | 19,693,646.00 | 8.77 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 104,485,406.04 | 46.52 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 基础材料 | 5,877,530.27 | 2.62 |
| 消费者非必需品 | 6,685,485.13 | 2.98 |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | 29,036,933.14 | 12.93 |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | 154,161.84 | 0.07 |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 地产业 | 1,390,209.45 | 0.62 |
| 合计 | 43,144,319.83 | 19.21 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 00883 | 中国海洋石油 | 1,450,000 | 18,335,165.03 | 8.16 |
| 2 | 01171 | 兖矿能源 | 788,000 | 10,701,768.11 | 4.76 |
| 3 | 002318 | 久立特材 | 500,000 | 9,650,000.00 | 4.30 |
| 4 | 600970 | 中材国际 | 795,300 | 8,970,984.00 | 3.99 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 300,000 | 8,577,000.00 | 3.82 |
| 6 | 000933 | 神火股份 | 480,000 | 8,198,400.00 | 3.65 |
| 7 | 600031 | 三一重工 | 430,000 | 6,832,700.00 | 3.04 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 250,000 | 6,717,500.00 | 2.99 |
| 9 | 000425 | 徐工机械 | 1,000,000 | 6,370,000.00 | 2.84 |
| 10 | 600150 | 中国船舶 | 211,281 | 5,894,739.90 | 2.62 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 36,424,018.92 | 16.22 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 36,424,018.92 | 16.22 |

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 | 113044 | 大秦转债 | 152,520 | 17,957,370.51 | 8.00 |
| 2 | 113057 | 中银转债 | 55,000 | 7,342,359.86 | 3.27 |
| 3 | 113066 | 平煤转债 | 30,000 | 3,807,516.99 | 1.70 |
| 4 | 110043 | 无锡转债 | 35,000 | 3,796,192.05 | 1.69 |
| 5 | 132026 | G 三峡 EB2 | 20,000 | 2,240,534.79 | 1.00 |

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

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -371,420.20 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 584,460.00 |

5.9.2 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，以套期保值为目的，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。

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

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安铁路监督管理局的处罚。宁波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宁波市分局、宁波银保监局的处罚。兖矿能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局山东局的处罚。河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到永城市水利局的处罚。

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,865,681.14 |
| 3 | 应收股利 | 685,620.88 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 109,689.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,660,991.06 |

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 | 113044 | 大秦转债 | 17,957,370.51 | 8.00 |
| 2 | 113057 | 中银转债 | 7,342,359.86 | 3.27 |
| 3 | 113066 | 平煤转债 | 3,807,516.99 | 1.70 |
| 4 | 110043 | 无锡转债 | 3,796,192.05 | 1.69 |
| 5 | 113055 | 成银转债 | 623,129.32 | 0.28 |
| 6 | 110091 | 合力转债 | 163,698.00 | 0.07 |
| 7 | 113582 | 火炬转债 | 154,407.53 | 0.07 |
| 8 | 123158 | 宙邦转债 | 130,955.48 | 0.06 |
| 9 | 110045 | 海澜转债 | 127,805.62 | 0.06 |
| 10 | 127063 | 贵轮转债 | 80,048.77 | 0.04 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中欧融恒平衡混合 A | 中欧融恒平衡混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 283,254,029.96 | 105,706,249.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,665,634.15 | 1,818,759.43 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 107,305,955.63 | 67,439,805.29 |
| 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 | 179,613,708.48 | 40,085,203.37 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中欧融恒平衡混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧融恒平衡混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧融恒平衡混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧融恒平衡混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日