

# 中欧可转债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	中欧可转债债券		
基金主代码	004993		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 11 月 10 日		
报告期末基金份额总额	3,256,107,146.79 份		
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。		
业绩比较基准	中证可转换债券指数×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%		
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，属于较低风险/收益的产品。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧可转债债券 A	中欧可转债债券 C	中欧可转债债券 E
下属分级基金的交易代码	004993	004994	023928
报告期末下属分级基金的份额总额	838,856,087.95 份	743,338,329.39 份	1,673,912,729.45 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（2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日）		
	中欧可转债债券 A	中欧可转债债券 C	中欧可转债债券 E
1. 本期已实现收益	124,565,464.34	66,003,003.23	219,862,353.51
2. 本期利润	22,640,539.89	-14,902,614.08	61,235,346.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0177	-0.0182	0.0267
4. 期末基金资产净值	1,317,443,102.53	1,130,463,228.30	2,628,780,575.38
5. 期末基金份额净值	1.5705	1.5208	1.5704

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

中欧可转债债券 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	-0.83%	1.16%	-1.08%	0.81%	0.25%	0.35%
过去六个月	-1.09%	0.95%	-0.15%	0.65%	-0.94%	0.30%
过去一年	17.77%	0.95%	11.08%	0.60%	6.69%	0.35%
过去三年	18.02%	0.93%	16.15%	0.51%	1.87%	0.42%
过去五年	15.69%	0.96%	23.11%	0.50%	-7.42%	0.46%
自基金合同生效起至今	57.05%	0.92%	47.59%	0.54%	9.46%	0.38%

中欧可转债债券 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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-0.93%	1.16%	-1.08%	0.81%	0.15%	0.35%
过去六个月	-1.29%	0.95%	-0.15%	0.65%	-1.14%	0.30%
过去一年	17.31%	0.95%	11.08%	0.60%	6.23%	0.35%
过去三年	16.62%	0.93%	16.15%	0.51%	0.47%	0.42%
过去五年	13.40%	0.96%	23.11%	0.50%	-9.71%	0.46%
自基金合同生效起至今	52.08%	0.92%	47.59%	0.54%	4.49%	0.38%

中欧可转债债券 E

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	-0.83%	1.16%	-1.08%	0.81%	0.25%	0.35%
过去六个月	-1.09%	0.95%	-0.15%	0.65%	-0.94%	0.30%
自基金份额起始运作日至今	19.25%	0.87%	12.32%	0.56%	6.93%	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

中欧可转债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中欧可转债债券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：本基金于 2025 年 4 月 8 日新增 E 类份额，图示日期为 2025 年 4 月 15 日至 2026 年 03 月 31 日。

## § 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		
李波	基金经理 /基金经 理助理	2024-02-19	-	8 年	历任海通证券股份有限公司研究所固定收益分析师。2020-04-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。

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，其中李波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 1 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

2026 年一季度权益市场先涨后跌，指数整体收平，波动相比去年四季度有所增加。今年一季度市场的走势分为两段，1-2 月依然沿着景气方向来演绎，其中以科技和有色为代表，市场对于有边际变化，或者景气趋势持续的方向会更加青睐，整体还是趋势思维。但从 3 月开始，海外地缘局势的变化逐渐成为新的影响因素，一定程度打破了此前市场的逻辑演绎。一方面，全球的风险偏好受到压制，高估值的板块普遍受到影响；另一方面，油价和通胀预期的上行，对于很多行业都有直接或间接的影响，也会改变行业内部景气度的排序。

展望二季度，我们认为海外地缘局势对市场边际影响最大的阶段，可能已经过去了。市场有望带来修复性交易机会。但如果视角看长一些，我们需要思考的是，如果能源价格长期在偏高位震荡，全球能源格局、甚至供应链格局也相应重塑，那么对于资本市场会有哪些深远的影响。其中会有一些行业是深度受益的，这可能会是下一轮的主线；也会有一些行业是相对脱敏、有独立逻辑的，也值得关注；而那些最终会受损的板块则是需要规避的。因此二季度除了关注市场的交易机会外，对于地缘局势变革下，很多行业变化的思考是更重要的。

转债方面，一季度估值先上后下，整体回到四季度末的水平。今年我们观察到转债市场有两点变化，一是小节奏上相比正股体现出一些领先性，可能是估值高位后，转债的交易资金越来越多，开始对权益的二阶导体现出敏感性。二是转债  $\Delta$  有一定的放大，尤其在某些阶段，转债的波动率甚至会高于正股。这两点都指向转债资产越来越偏向交易属性，其原有的一些优势，例如低波、高夏普等在逐渐丧失，配置价值也在让位于交易价值。

操作方面，组合依然保持高仓位转债的运作方式，在转债资产整体估值较高、波动加剧的背景下，我们也在努力做好风险和收益的平衡，对策略也在不断地优化和改进。

#### 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-0.83%，同期业绩比较基准收益率为-1.08%；基金 C 类份额净值增长率为-0.93%，同期业绩比较基准收益率为-1.08%；基金 E 类份额净值增长率为-0.83%，同期业绩比较基准收益率为-1.08%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,454,327,303.15	95.91
	其中：债券	5,454,327,303.15	95.91
	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	194,303,197.32	3.42
8	其他资产	38,164,422.90	0.67
9	合计	5,686,794,923.37	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

##### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	375,920,059.50	7.40
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）	5,078,407,243.65	100.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,454,327,303.15	107.44

#### 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	019773	25 国债 08	2,349,000	238,018,184.87	4.69
2	019785	25 国债 13	866,000	87,423,530.41	1.72
3	113062	常银转债	459,590	59,353,278.37	1.17
4	113056	重银转债	463,420	58,779,875.39	1.16
5	113042	上银转债	469,730	58,081,471.04	1.14

#### 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，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，重庆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重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、中国人民银行的处罚。

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

截止本报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	754,508.11
2	应收证券清算款	36,241,015.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,168,898.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,164,422.90

### 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	113062	常银转债	59,353,278.37	1.17
2	113056	重银转债	58,779,875.39	1.16
3	113042	上银转债	58,081,471.04	1.14
4	111000	起帆转债	55,989,189.70	1.10
5	111015	东亚转债	55,399,707.21	1.09
6	128141	旺能转债	55,367,925.28	1.09
7	123247	万凯转债	54,192,866.27	1.07
8	113054	绿动转债	54,144,369.23	1.07
9	123215	铭利转债	53,801,305.42	1.06
10	110095	双良转债	53,795,033.55	1.06
11	127067	恒逸转 2	53,630,796.29	1.06
12	113052	兴业转债	53,623,912.05	1.06
13	127025	冀东转债	51,996,085.53	1.02
14	123071	天能转债	51,174,074.48	1.01
15	118041	星球转债	50,336,417.61	0.99
16	113048	晶科转债	49,977,083.62	0.98
17	113632	鹤 21 转债	49,935,944.55	0.98
18	113658	密卫转债	49,807,732.30	0.98
19	111004	明新转债	49,669,011.33	0.98
20	127061	美锦转债	48,338,037.68	0.95
21	113636	甬金转债	46,073,911.66	0.91
22	110086	精工转债	45,852,127.26	0.90
23	123194	百洋转债	45,788,773.61	0.90
24	118031	天 23 转债	44,289,431.28	0.87
25	113605	大参转债	43,723,199.60	0.86
26	123114	三角转债	43,710,851.91	0.86
27	127083	山路转债	43,427,874.70	0.86
28	118003	华兴转债	42,582,118.52	0.84
29	110075	南航转债	42,280,772.24	0.83
30	118022	锂科转债	42,251,152.96	0.83
31	127108	太能转债	42,159,885.12	0.83
32	113616	韦尔转债	42,048,630.42	0.83
33	111010	立昂转债	41,911,829.90	0.83
34	127040	国泰转债	41,739,303.42	0.82
35	113067	燃 23 转债	41,164,819.16	0.81
36	123172	漱玉转债	41,024,567.62	0.81
37	110077	洪城转债	40,958,357.46	0.81
38	127030	盛虹转债	40,847,928.66	0.80
39	113640	苏利转债	39,795,755.88	0.78
40	123236	家联转债	39,676,839.43	0.78
41	123119	康泰转 2	39,559,240.81	0.78

42	118030	睿创转债	39,115,812.82	0.77
43	110087	天业转债	38,850,663.68	0.77
44	128129	青农转债	38,573,493.51	0.76
45	113051	节能转债	38,367,033.05	0.76
46	113655	欧 22 转债	38,310,905.32	0.75
47	113649	丰山转债	38,065,356.36	0.75
48	123149	通裕转债	37,682,204.62	0.74
49	127095	广泰转债	37,333,770.82	0.74
50	110090	爱迪转债	36,948,844.73	0.73
51	123085	万顺转 2	36,655,404.69	0.72
52	118011	银微转债	36,176,176.85	0.71
53	113654	永 02 转债	36,152,366.12	0.71
54	123188	水羊转债	36,093,005.99	0.71
55	127024	盈峰转债	35,606,867.86	0.70
56	123187	超达转债	35,530,721.47	0.70
57	118034	晶能转债	34,971,724.99	0.69
58	113631	皖天转债	34,829,905.68	0.69
59	110073	国投转债	34,755,319.85	0.68
60	123160	泰福转债	34,050,749.61	0.67
61	127069	小熊转债	33,691,746.28	0.66
62	113647	禾丰转债	33,426,734.79	0.66
63	123155	中陆转债	33,278,337.18	0.66
64	123113	仙乐转债	32,411,809.23	0.64
65	110098	南药转债	32,242,588.76	0.64
66	128137	洁美转债	32,036,405.70	0.63
67	127103	东南转债	31,691,307.44	0.62
68	123165	回天转债	31,137,851.47	0.61
69	110093	神马转债	29,559,517.82	0.58
70	123243	严牌转债	29,081,214.99	0.57
71	128142	新乳转债	29,029,305.74	0.57
72	127026	超声转债	28,900,143.61	0.57
73	123088	威唐转债	28,736,846.10	0.57
74	110097	天润转债	27,978,721.67	0.55
75	111013	新港转债	26,766,747.13	0.53
76	110074	精达转债	26,644,813.30	0.52
77	123126	瑞丰转债	26,315,251.05	0.52
78	123091	长海转债	26,135,326.31	0.51
79	123224	宇邦转债	25,891,060.06	0.51
80	127088	赫达转债	25,786,224.57	0.51
81	127079	华亚转债	25,700,423.00	0.51
82	123251	华医转债	25,530,020.15	0.50
83	118051	皓元转债	25,479,916.73	0.50

84	123092	天壕转债	25,054,585.33	0.49
85	113686	泰瑞转债	24,753,408.48	0.49
86	127084	柳工转 2	24,516,147.71	0.48
87	113680	丽岛转债	23,559,429.27	0.46
88	123107	温氏转债	22,819,825.17	0.45
89	118052	浩瀚转债	22,721,259.10	0.45
90	113698	凯众转债	22,547,370.54	0.44
91	127018	本钢转债	21,805,591.64	0.43
92	127070	大中转债	20,169,430.45	0.40
93	113694	清源转债	19,878,927.88	0.39
94	127060	湘佳转债	19,722,056.66	0.39
95	118040	宏微转债	18,777,854.74	0.37
96	118058	微导转债	18,751,356.07	0.37
97	128135	洽洽转债	18,316,788.16	0.36
98	111023	利柏转债	17,999,397.24	0.35
99	127092	运机转债	17,401,602.23	0.34
100	123090	三诺转债	17,374,242.38	0.34
101	113679	芯能转债	16,930,445.73	0.33
102	127099	盛航转债	16,882,182.04	0.33
103	127105	龙星转债	16,855,734.80	0.33
104	113643	风语转债	16,787,014.22	0.33
105	113633	科沃转债	16,765,201.42	0.33
106	113625	江山转债	16,758,097.80	0.33
107	123178	花园转债	16,728,921.20	0.33
108	127089	晶澳转债	16,695,070.10	0.33
109	128138	侨银转债	16,607,963.88	0.33
110	111018	华康转债	16,607,011.34	0.33
111	113627	太平转债	16,296,494.79	0.32
112	111017	蓝天转债	16,289,098.34	0.32
113	113661	福 22 转债	16,226,530.27	0.32
114	110084	贵燃转债	16,185,348.68	0.32
115	113049	长汽转债	16,168,921.90	0.32
116	127027	能化转债	16,163,307.81	0.32
117	128134	鸿路转债	15,958,323.56	0.31
118	123131	奥飞转债	15,932,108.19	0.31
119	123183	海顺转债	15,879,003.54	0.31
120	123076	强力转债	15,711,048.94	0.31
121	127034	绿茵转债	15,683,488.26	0.31
122	127102	浙建转债	15,662,866.34	0.31
123	113046	金田转债	15,561,086.40	0.31
124	123225	翔丰转债	15,536,225.79	0.31
125	127044	蒙娜转债	15,527,319.56	0.31

126	123198	金埔转债	15,438,272.57	0.30
127	127054	双箭转债	15,422,518.24	0.30
128	127031	洋丰转债	15,396,018.11	0.30
129	118033	华特转债	15,332,559.64	0.30
130	113644	艾迪转债	15,331,479.61	0.30
131	118024	冠宇转债	15,303,914.66	0.30
132	123168	惠云转债	15,270,130.32	0.30
133	123193	海能转债	15,244,989.02	0.30
134	113059	福莱转债	15,199,574.35	0.30
135	118044	赛特转债	15,196,394.80	0.30
136	127049	希望转 2	15,017,836.65	0.30
137	123192	科思转债	14,998,911.03	0.30
138	113043	财通转债	14,973,081.06	0.29
139	113656	嘉诚转债	14,972,294.63	0.29
140	113670	金 23 转债	14,952,308.43	0.29
141	123144	裕兴转债	14,898,397.24	0.29
142	113650	博 22 转债	14,829,815.68	0.29
143	123109	昌红转债	14,718,030.00	0.29
144	113666	爱玛转债	14,702,624.71	0.29
145	123179	立高转债	14,652,463.23	0.29
146	111002	特纸转债	14,614,674.84	0.29
147	118032	建龙转债	14,500,748.61	0.29
148	113695	华辰转债	14,426,755.52	0.28
149	113688	国检转债	14,381,800.14	0.28
150	123133	佩蒂转债	14,365,255.51	0.28
151	123220	易瑞转债	14,319,859.08	0.28
152	118025	奕瑞转债	14,309,658.66	0.28
153	113674	华设转债	14,268,525.02	0.28
154	123117	健帆转债	14,189,576.81	0.28
155	123216	科顺转债	14,129,953.00	0.28
156	113659	莱克转债	14,069,838.15	0.28
157	127046	百润转债	14,066,230.12	0.28
158	113665	汇通转债	13,951,411.67	0.27
159	113652	伟 22 转债	13,932,126.26	0.27
160	123180	浙矿转债	13,930,431.54	0.27
161	118004	博瑞转债	13,878,007.55	0.27
162	127098	欧晶转债	13,845,255.13	0.27
163	123154	火星转债	13,831,066.26	0.27
164	127062	垒知转债	13,814,206.51	0.27
165	127056	中特转债	13,767,012.01	0.27
166	127090	兴瑞转债	13,693,410.72	0.27
167	123121	帝尔转债	13,640,823.70	0.27

168	127038	国微转债	13,618,265.20	0.27
169	118037	上声转债	13,606,981.95	0.27
170	123196	正元转 02	13,578,312.28	0.27
171	123151	康医转债	13,429,951.94	0.26
172	127068	顺博转债	13,427,217.10	0.26
173	111001	山玻转债	13,365,154.88	0.26
174	111014	李子转债	13,315,859.69	0.26
175	118038	金宏转债	13,214,737.24	0.26
176	127078	优彩转债	13,192,486.56	0.26
177	113678	中贝转债	13,180,303.59	0.26
178	123122	富瀚转债	13,171,553.49	0.26
179	123112	万讯转债	13,129,512.99	0.26
180	113671	武进转债	13,005,861.04	0.26
181	110076	华海转债	12,773,022.64	0.25
182	113618	美诺转债	12,507,509.90	0.25
183	123129	锦鸡转债	11,356,975.21	0.22
184	127096	泰坦转债	10,762,834.95	0.21
185	123211	阳谷转债	10,107,139.56	0.20
186	123158	宙邦转债	10,090,911.33	0.20
187	127064	杭氧转债	10,040,968.96	0.20
188	123199	山河转债	9,319,344.66	0.18
189	118006	阿拉转债	9,030,414.02	0.18
190	123059	银信转债	9,027,280.29	0.18
191	113687	振华转债	8,566,004.42	0.17
192	123104	卫宁转债	8,510,940.23	0.17
193	118016	京源转债	8,507,009.87	0.17
194	123213	天源转债	8,395,181.85	0.17
195	113039	嘉泽转债	8,035,555.41	0.16
196	118050	航宇转债	8,006,420.24	0.16
197	111005	富春转债	7,678,428.50	0.15
198	113673	岱美转债	7,621,114.72	0.15
199	123256	恒帅转债	7,070,848.69	0.14
200	123245	集智转债	5,571,637.72	0.11

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	中欧可转债债券 A	中欧可转债债券 C	中欧可转债债券 E
报告期期初基金份额总额	1,497,251,080.50	755,463,937.28	2,851,667,426.57
报告期期间基金总申购份额	488,885,925.34	540,782,846.05	2,270,519,435.42
减：报告期期间基金总赎回份额	1,147,280,917.89	552,908,453.94	3,448,274,132.54
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	838,856,087.95	743,338,329.39	1,673,912,729.45

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

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	2026 年 01 月 08 日至 2026 年 01 月 13 日	828,242,429.81	307,049,250.80	573,377,343.22	561,914,337.39	17.26%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的							

应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 4 月 22 日