

中欧丰利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：招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。

基金托管人招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	中欧丰利债券	
基金主代码	014000	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 9 日	
报告期末基金份额总额	26,691,654,019.55 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	中债新综合财富指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*3%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧丰利债券 A	中欧丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	014000	014001
报告期末下属分级基金的份额总额	25,030,225,656.71 份	1,661,428,362.84 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）	
	中欧丰利债券 A	中欧丰利债券 C
1. 本期已实现收益	699,632,877.24	52,221,912.28
2. 本期利润	122,798,314.87	8,976,872.21
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0041
4. 期末基金资产净值	28,727,107,936.74	1,875,676,267.75
5. 期末基金份额净值	1.1477	1.1290

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

中欧丰利债券 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	0.32%	0.28%	0.16%	0.13%	0.16%	0.15%
过去六个月	0.43%	0.27%	0.42%	0.13%	0.01%	0.14%
过去一年	6.12%	0.28%	3.52%	0.12%	2.60%	0.16%
过去三年	15.23%	0.29%	13.90%	0.13%	1.33%	0.16%
自基金合同生效起至今	14.77%	0.29%	16.04%	0.14%	-1.27%	0.15%

中欧丰利债券 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	0.23%	0.28%	0.16%	0.13%	0.07%	0.15%
过去六个月	0.23%	0.27%	0.42%	0.13%	-0.19%	0.14%
过去一年	5.70%	0.28%	3.52%	0.12%	2.18%	0.16%
过去三年	13.94%	0.29%	13.90%	0.13%	0.04%	0.16%
自基金合同生效起至今	12.90%	0.29%	16.04%	0.14%	-3.14%	0.15%

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



§ 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		
袁田	基金经理 /基金经 理助理	2026-03-16	-	8 年	历任上海光大证券资产管理有限公司信用研究员。2020-08-21 加入中欧基金管理有限公司, 历任研究员、投资经理助理。
华李成	多资产投 决会委员 /多资产 多元配置 组组长/ 基金经理	2021-12-09	-	11 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、多资产公募组组长。

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，其中袁田自 2023 年 12 月 13 日至 2026 年 3 月 16 日担任本基金的基金经理助理，自 2026 年 3 月 16 日起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 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 年一季度股票市场先扬后抑，整体走势偏区间震荡，债券市场则重回低波动状态，中短端品种表现亮眼。一季度中证 800 指数下跌 2.28%，中债综合财富（1-5 年）指数上涨 0.42%。

股票层面，春季躁动行情提前启动，但美伊冲突意外爆发打乱行情节奏，市场中期慢牛趋势仍在。开年市场延续前期涨势录得幅度可观的开门红，春季躁动行情提前启动，有色、商业航天、AI 应用等方向表现亮眼。1 月末市场情绪开始降温，指数转为区间震荡，赚钱效应有所下降。3 月初美伊冲突意外爆发，油价受此影响快速上涨，油价上涨初期市场反应并不明显，但随着油价向上突破 100 美元，高油价对流动性预期和风险偏好形成明显压制，市场因此出现大幅调整。在市场调整期间，光模块表现相对坚挺，成为阶段性市场亮点。

债券层面，市场表现好于预期，不同期限债券分化明显。受前期走势影响，年初投资者对债券市场表现并未抱有太高的预期。但在稳定的资金面和回暖的机构行为共同作用下，市场表现好于预期，风险收益特征改善明显。中短端债券作为最受益于资金面和机构行为的品种表现亮眼，长端和超长端债券则受到通胀预期影响整体呈震荡走势，曲线形态在中短端带动下进一步陡峭化。转债受自身估值持续维持高位影响，配置价值并不突出，更多体现为交易价值。

一季度组合坚持资产配置理念，适时调整组合股债配置，力求控制组合波动。股票方面，组合根据市场判断做好策略和行业配置调整，精选细分结构和个股，积极参与港股投资；债券方面，组合在坚持高等级信用债配置策略的基础上，也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动态调整转债仓位。

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 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.16%；基金 C 类份额净值增长率为 0.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.16%。

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	5,622,012,028.98	15.96
	其中：股票	5,622,012,028.98	15.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,322,462,577.95	83.25
	其中：债券	29,322,462,577.95	83.25
	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	141,249,203.63	0.40
8	其他资产	134,483,256.97	0.38
9	合计	35,220,207,067.53	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 2,233,118,077.00 元，占基金资产净值比例 7.30%。

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	62,599,994.69	0.20
B	采矿业	279,328,682.36	0.91
C	制造业	1,975,591,275.53	6.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	451,150,000.00	1.47
J	金融业	549,843,999.40	1.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	70,380,000.00	0.23
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	3,388,893,951.98	11.07

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	42,482,545.00	0.14
消费者非必需品	521,664,672.00	1.70
消费者常用品	143,665,000.00	0.47
能源	818,214,920.00	2.67
金融	152,018,280.00	0.50
医疗保健	75,755,000.00	0.25
工业	74,933,920.00	0.24
信息技术	-	-
电信服务	277,093,740.00	0.91
公用事业	-	-
地产业	127,290,000.00	0.42
合计	2,233,118,077.00	7.30

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	20,110,000	497,119,200.00	1.62
2	688777	中控技术	7,000,000	451,150,000.00	1.47
3	601318	中国平安	6,999,930	397,456,025.40	1.30
4	09988	阿里巴巴-W	3,759,600	395,021,172.00	1.29
5	300750	宁德时代	881,319	354,025,842.30	1.16
6	01138	中远海能	20,284,000	321,095,720.00	1.05
7	000688	国城矿业	7,186,228	279,328,682.36	0.91
8	00700	腾讯控股	648,400	277,093,740.00	0.91
9	600801	华新建材	7,873,102	166,909,762.40	0.55
9	06655	华新建材	3,002,300	42,482,545.00	0.14
10	600519	贵州茅台	135,000	195,750,000.00	0.64

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	1,620,382,085.77	5.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,109,253,182.46	55.91
	其中：政策性金融债	6,157,126,293.15	20.12

4	企业债券	2,472,596,834.69	8.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	6,158,216,348.93	20.12
7	可转债（可交换债）	661,433,396.29	2.16
8	同业存单	196,996,621.37	0.64
9	其他	1,103,584,108.44	3.61
10	合计	29,322,462,577.95	95.82

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	250423	25 农发 23	8,900,000	900,906,035.62	2.94
2	250208	25 国开 08	6,700,000	675,574,400.00	2.21
3	09250207	25 国开清发 07	5,500,000	558,226,493.15	1.82
4	230208	23 国开 08	5,100,000	531,558,608.22	1.74
5	019785	25 国债 13	4,400,000	444,184,219.16	1.45

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。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

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
TL2606	30 年期国债 2606	-300	-334,740,000.00	-1,909,800.00	套保
公允价值变动总额合计(元)					-1,909,800.00
国债期货投资本期收益(元)					-920.18
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-1,909,800.00

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，以争取回避市场风险。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，中国农业发展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的处罚。国家开发银行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、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

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	13,066,819.84
2	应收证券清算款	119,711,353.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,705,083.75
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	134,483,256.97

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	123149	通裕转债	9,595,453.68	0.03
2	110087	天业转债	9,594,912.58	0.03
3	113632	鹤 21 转债	9,475,743.95	0.03
4	123215	铭利转债	9,471,535.61	0.03
5	128141	旺能转债	9,470,399.45	0.03
6	113054	绿动转债	9,365,526.06	0.03
7	123247	万凯转债	9,320,359.09	0.03
8	113048	晶科转债	9,245,204.85	0.03
9	111000	起帆转债	9,166,865.53	0.03
10	110095	双良转债	9,136,880.38	0.03
11	113043	财通转债	9,072,406.88	0.03
12	127067	恒逸转 2	9,063,098.91	0.03
13	113051	节能转债	8,957,742.46	0.03
14	123114	三角转债	8,851,317.92	0.03
15	113640	苏利转债	8,432,916.74	0.03
16	118030	睿创转债	8,169,823.87	0.03
17	123071	天能转债	7,927,614.42	0.03
18	111015	东亚转债	7,821,628.21	0.03
19	111004	明新转债	7,765,981.02	0.03
20	118041	星球转债	7,762,342.92	0.03
21	123188	水羊转债	7,672,594.99	0.03
22	118003	华兴转债	7,640,958.77	0.02
23	127026	超声转债	7,612,714.56	0.02
24	127064	杭氧转债	7,220,408.23	0.02
25	127084	柳工转 2	6,956,376.43	0.02
26	123236	家联转债	6,879,874.03	0.02
27	113631	皖天转债	6,416,750.77	0.02
28	113654	永 02 转债	6,355,279.36	0.02
29	113649	丰山转债	6,346,550.29	0.02
30	123076	强力转债	6,339,232.97	0.02
31	123225	翔丰转债	6,298,320.85	0.02
32	127088	赫达转债	6,272,699.97	0.02
33	118011	银微转债	6,241,810.93	0.02
34	128137	洁美转债	6,186,176.95	0.02
35	123091	长海转债	5,954,569.10	0.02
36	111023	利柏转债	5,521,558.33	0.02
37	123085	万顺转 2	5,441,014.64	0.02

38	123251	华医转债	5,202,428.15	0.02
39	118044	赛特转债	5,196,342.07	0.02
40	123243	严牌转债	5,129,955.56	0.02
41	123155	中陆转债	5,080,874.77	0.02
42	123187	超达转债	5,075,817.35	0.02
43	123092	天壕转债	5,056,144.35	0.02
44	123126	瑞丰转债	4,926,867.19	0.02
45	113680	丽岛转债	4,894,757.69	0.02
46	111013	新港转债	4,891,206.64	0.02
47	110074	精达转债	4,782,014.98	0.02
48	118052	浩瀚转债	4,749,225.86	0.02
49	123088	威唐转债	4,709,642.35	0.02
50	113686	泰瑞转债	4,678,694.45	0.02
51	127079	华亚转债	4,607,794.20	0.02
52	113671	武进转债	4,522,418.45	0.01
53	123224	宇邦转债	4,521,097.60	0.01
54	111005	富春转债	4,377,367.92	0.01
55	118040	宏微转债	4,358,296.80	0.01
56	113618	美诺转债	4,340,841.67	0.01
57	113678	中贝转债	4,304,647.35	0.01
58	123235	亿田转债	4,296,903.38	0.01
59	113695	华辰转债	4,248,704.29	0.01
60	118004	博瑞转债	4,238,618.83	0.01
61	118006	阿拉转债	4,058,613.04	0.01
62	113039	嘉泽转债	3,850,690.39	0.01
63	123059	银信转债	3,673,799.39	0.01
64	123129	锦鸡转债	3,186,528.87	0.01
65	123199	山河转债	2,852,284.27	0.01
66	127096	泰坦转债	2,833,659.84	0.01
67	123256	恒帅转债	2,698,668.66	0.01
68	123160	泰福转债	2,444,418.49	0.01
69	127025	冀东转债	2,291,181.12	0.01
70	128135	洽洽转债	2,271,263.40	0.01
71	127061	美锦转债	2,258,969.76	0.01
72	113062	常银转债	2,243,230.80	0.01
73	113056	重银转债	2,234,908.73	0.01
74	113042	上银转债	2,221,965.88	0.01
75	123090	三诺转债	2,211,864.68	0.01
76	118022	锂科转债	2,198,438.01	0.01
77	110075	南航转债	2,198,397.08	0.01
78	123194	百洋转债	2,168,628.29	0.01
79	113643	风语转债	2,160,858.26	0.01

80	127069	小熊转债	2,160,327.25	0.01
81	127030	盛虹转债	2,160,101.12	0.01
82	127105	龙星转债	2,157,144.48	0.01
83	110086	精工转债	2,156,036.49	0.01
84	110077	洪城转债	2,155,037.79	0.01
85	127024	盈峰转债	2,154,805.83	0.01
86	113679	芯能转债	2,145,104.53	0.01
87	118034	晶能转债	2,138,519.34	0.01
88	127099	盛航转债	2,131,804.50	0.01
89	127089	晶澳转债	2,114,392.12	0.01
90	123178	花园转债	2,113,246.21	0.01
91	123165	回天转债	2,109,250.12	0.01
92	113625	江山转债	2,108,029.98	0.01
93	111018	华康转债	2,101,464.53	0.01
94	127103	东南转债	2,094,293.44	0.01
95	113633	科沃转债	2,093,562.58	0.01
96	127040	国泰转债	2,091,037.75	0.01
97	127108	太能转债	2,090,399.84	0.01
98	127095	广泰转债	2,084,322.33	0.01
99	128138	侨银转债	2,081,291.39	0.01
100	111017	蓝天转债	2,074,009.09	0.01
101	113661	福 22 转债	2,067,178.14	0.01
102	113605	大参转债	2,064,287.16	0.01
103	113052	兴业转债	2,054,033.19	0.01
104	113049	长汽转债	2,051,492.01	0.01
105	113627	太平转债	2,046,868.27	0.01
106	113636	甬金转债	2,034,448.63	0.01
107	113616	韦尔转债	2,025,534.13	0.01
108	118031	天 23 转债	2,022,007.78	0.01
109	110084	贵燃转债	2,016,608.98	0.01
110	123183	海顺转债	2,005,740.98	0.01
111	127027	能化转债	1,998,772.05	0.01
112	128134	鸿路转债	1,992,631.25	0.01
113	123119	康泰转 2	1,992,272.91	0.01
114	127034	绿茵转债	1,989,916.27	0.01
115	127044	蒙娜转债	1,983,030.27	0.01
116	127031	洋丰转债	1,974,716.39	0.01
117	128142	新乳转债	1,971,865.08	0.01
118	118033	华特转债	1,971,709.19	0.01
119	123193	海能转债	1,965,174.37	0.01
120	123113	仙乐转债	1,963,477.08	0.01
121	113067	燃 23 转债	1,955,218.48	0.01

122	127102	浙建转债	1,953,971.49	0.01
123	127054	双箭转债	1,951,142.26	0.01
124	113046	金田转债	1,931,466.76	0.01
125	113656	嘉诚转债	1,929,490.27	0.01
126	123168	惠云转债	1,929,045.35	0.01
127	123198	金埔转债	1,925,596.54	0.01
128	113059	福莱转债	1,923,564.71	0.01
129	113644	艾迪转债	1,918,122.25	0.01
130	123172	漱玉转债	1,917,146.55	0.01
131	118024	冠宇转债	1,916,030.65	0.01
132	113647	禾丰转债	1,908,310.91	0.01
133	123192	科思转债	1,898,820.52	0.01
134	123144	裕兴转债	1,892,271.96	0.01
135	123104	卫宁转债	1,887,590.20	0.01
136	113670	金 23 转债	1,884,889.60	0.01
137	127049	希望转 2	1,872,954.73	0.01
138	113650	博 22 转债	1,863,503.84	0.01
139	110097	天润转债	1,859,885.77	0.01
140	127083	山路转债	1,855,775.53	0.01
141	111002	特纸转债	1,854,862.95	0.01
142	123179	立高转债	1,851,993.27	0.01
143	113666	爱玛转债	1,848,073.82	0.01
144	113658	密卫转债	1,835,325.79	0.01
145	118032	建龙转债	1,827,731.99	0.01
146	123109	昌红转债	1,827,530.00	0.01
147	123112	万讯转债	1,822,640.73	0.01
148	123133	佩蒂转债	1,816,296.67	0.01
149	127046	百润转债	1,800,660.31	0.01
150	113655	欧 22 转债	1,796,506.82	0.01
151	123117	健帆转债	1,796,374.10	0.01
152	123216	科顺转债	1,795,079.41	0.01
153	123220	易瑞转债	1,792,168.78	0.01
154	113674	华设转债	1,790,697.30	0.01
155	110098	南药转债	1,788,386.81	0.01
156	113688	国检转债	1,784,263.27	0.01
157	127098	欧晶转债	1,776,775.38	0.01
158	113659	莱克转债	1,773,195.65	0.01
159	123180	浙矿转债	1,772,295.27	0.01
160	118025	奕瑞转债	1,770,937.04	0.01
161	113652	伟 22 转债	1,768,248.15	0.01
162	127090	兴瑞转债	1,751,401.37	0.01
163	113665	汇通转债	1,749,952.92	0.01

164	110093	神马转债	1,747,511.68	0.01
165	127062	垒知转债	1,745,087.67	0.01
166	123196	正元转 02	1,743,346.45	0.01
167	123154	火星转债	1,739,272.47	0.01
168	127056	中特转债	1,734,189.92	0.01
169	111010	立昂转债	1,729,272.60	0.01
170	118037	上声转债	1,728,963.53	0.01
171	123121	帝尔转债	1,726,480.37	0.01
172	123151	康医转债	1,705,348.52	0.01
173	127038	国微转债	1,703,688.32	0.01
174	123122	富瀚转债	1,702,795.70	0.01
175	111014	李子转债	1,698,445.16	0.01
176	110090	爱迪转债	1,675,513.10	0.01
177	111001	山玻转债	1,672,648.33	0.01
178	127068	顺博转债	1,667,801.70	0.01
179	127078	优彩转债	1,661,476.75	0.01
180	113698	凯众转债	1,656,501.09	0.01
181	110076	华海转债	1,614,648.46	0.01
182	118016	京源转债	1,422,181.81	0.00
183	123245	集智转债	1,408,974.60	0.00
184	123213	天源转债	1,077,954.66	0.00
185	113687	振华转债	1,038,070.55	0.00

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	中欧丰利债券 A	中欧丰利债券 C
报告期期初基金份额总额	27,595,559,154.85	2,306,994,910.22
报告期期间基金总申购份额	3,739,173,237.45	712,952,885.43
减：报告期期间基金总赎回份额	6,304,506,735.59	1,358,519,432.81
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	25,030,225,656.71	1,661,428,362.84

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、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)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