

中欧优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：中国银行股份有限公司

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	中欧优利债券	
基金主代码	025305	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 24 日	
报告期末基金份额总额	731,123,598.04 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	中债综合指数收益率*88%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*2%	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧优利债券 A	中欧优利债券 C
下属分级基金的交易代码	025305	025306
报告期末下属分级基金的份额总额	482,014,255.26 份	249,109,342.78 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）	
	中欧优利债券 A	中欧优利债券 C
1. 本期已实现收益	4,641,407.82	2,080,853.83
2. 本期利润	3,288,354.93	1,600,846.81
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0040	0.0036
4. 期末基金资产净值	481,728,638.02	248,532,388.54
5. 期末基金份额净值	0.9994	0.9977

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

中欧优利债券 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	-0.20%	0.18%	-0.24%	0.12%	0.04%	0.06%
自基金合同生效起至今	-0.06%	0.13%	-0.41%	0.11%	0.35%	0.02%

中欧优利债券 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	-0.30%	0.18%	-0.24%	0.12%	-0.06%	0.06%
自基金合同生效起至今	-0.23%	0.13%	-0.41%	0.11%	0.18%	0.02%

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率变动的比较



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 10 月 24 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。



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 10 月 24 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		
黄华	多资产投资决策会主席/投资总监/基金经理	2025-10-24	-	17 年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理,中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理,中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016-11-10 加入中欧基金管理有限公司,历任基金经理助理、固收投决会委员。

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。

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位置震荡，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，组合一季度权益和转债仓位都略有下降，在市场高波动的阶段尽量降低风险敞口。板块上则更加均衡化，一季度主要减仓了周期（有色、化工等），加仓了医药、新能源等方向。二季度我们认为市场有望出现新的窗口期，因此在合适的时点或会考虑重新提高权益敞口。

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-0.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%；基金 C 类份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

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	66,714,104.28	8.26
	其中：股票	66,714,104.28	8.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	720,353,615.01	89.15
	其中：债券	720,353,615.01	89.15
	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	19,099,314.18	2.36
8	其他资产	1,839,175.53	0.23
9	合计	808,006,209.00	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 1,343,048.20 元，占基金资产净值比例 0.18%。

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	1,117,558.00	0.15
B	采矿业	2,780,694.00	0.38
C	制造业	41,509,985.78	5.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,468,220.00	0.20
E	建筑业	557,507.00	0.08
F	批发和零售业	2,055,806.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	2,018,266.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,019,854.91	0.69
J	金融业	3,383,896.00	0.46
K	房地产业	589,878.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,662,352.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	791,524.39	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	149,857.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	121,555.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,977,452.00	0.27

S	综合	166,650.00	0.02
	合计	65,371,056.08	8.95

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	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	263,807.81	0.04
金融	482,717.59	0.07
医疗保健	-	-
工业	523,202.63	0.07
信息技术	73,320.17	0.01
电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	1,343,048.20	0.18

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	000338	潍柴动力	42,700	1,035,048.00	0.14
2	688321	微芯生物	34,730	992,236.10	0.14
3	002850	科达利	5,500	984,500.00	0.13
4	000680	山推股份	84,200	978,404.00	0.13
5	603799	华友钴业	16,300	957,299.00	0.13
6	300866	安克创新	8,800	952,072.00	0.13
7	300775	三角防务	24,600	914,874.00	0.13
8	002772	众兴菌业	56,700	903,798.00	0.12
9	600549	厦门钨业	16,000	889,920.00	0.12
10	688777	中控技术	12,761	822,446.45	0.11

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	50,377,589.04	6.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	146,681,292.05	20.09
	其中：政策性金融债	21,837,194.52	2.99
4	企业债券	101,404,245.48	13.89
5	企业短期融资券	40,383,089.86	5.53
6	中期票据	365,945,244.38	50.11

7	可转债（可交换债）	15,562,154.20	2.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	720,353,615.01	98.64

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	019792	25 国债 19	500,000	50,377,589.04	6.90
2	242280004	22 重庆银行永续债 01	300,000	31,884,221.92	4.37
3	102484805	24 大唐集 MTN014	300,000	30,606,011.51	4.19
4	102281382	22 雨花城投 MTN002	300,000	30,586,229.59	4.19
5	184544	22 国惠 03	300,000	30,531,720.00	4.18

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，参与国债期货的交易。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

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，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。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。南京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江苏监管局的处罚。

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	120,425.79
2	应收证券清算款	1,717,924.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	824.78
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,839,175.53

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	123188	水羊转债	123,241.16	0.02
2	123243	严牌转债	122,551.33	0.02
3	127096	泰坦转债	117,588.81	0.02
4	123160	泰福转债	115,554.33	0.02
5	123247	万凯转债	114,487.94	0.02

6	118022	锂科转债	111,532.93	0.02
7	113640	苏利转债	110,306.30	0.02
8	127025	冀东转债	109,807.76	0.02
9	123187	超达转债	109,563.60	0.02
10	113056	重银转债	109,081.81	0.01
11	128135	洽洽转债	108,864.79	0.01
12	128141	旺能转债	108,464.63	0.01
13	127061	美锦转债	107,965.47	0.01
14	113632	鹤 21 转债	107,786.08	0.01
15	110075	南航转债	107,440.46	0.01
16	113062	常银转债	107,189.50	0.01
17	123215	铭利转债	107,122.59	0.01
18	113042	上银转债	106,337.82	0.01
19	113616	韦尔转债	105,947.51	0.01
20	127030	盛虹转债	105,922.31	0.01
21	118034	晶能转债	105,831.16	0.01
22	127024	盈峰转债	105,143.38	0.01
23	127088	赫达转债	104,853.39	0.01
24	113605	大参转债	104,836.83	0.01
25	123090	三诺转债	104,247.72	0.01
26	123129	锦鸡转债	104,117.02	0.01
27	123252	银邦转债	103,976.56	0.01
28	127103	东南转债	103,594.73	0.01
29	111000	起帆转债	103,426.63	0.01
30	110077	洪城转债	103,222.73	0.01
31	113051	节能转债	102,757.83	0.01
32	113054	绿动转债	102,752.63	0.01
33	127105	龙星转债	102,658.49	0.01
34	123178	花园转债	102,558.56	0.01
35	127089	晶澳转债	102,531.14	0.01
36	123180	浙矿转债	102,169.21	0.01
37	123071	天能转债	102,088.52	0.01
38	113048	晶科转债	102,078.43	0.01
39	113643	风语转债	102,036.94	0.01
40	123165	回天转债	101,920.16	0.01
41	110087	天业转债	101,876.48	0.01
42	123149	通裕转债	101,412.11	0.01
43	113633	科沃转债	101,397.62	0.01
44	113625	江山转债	101,205.19	0.01
45	123113	仙乐转债	101,061.32	0.01
46	111004	明新转债	100,892.31	0.01
47	123126	瑞丰转债	100,882.17	0.01

48	111015	东亚转债	100,848.19	0.01
49	123194	百洋转债	100,191.95	0.01
50	127040	国泰转债	100,145.49	0.01
51	111017	蓝天转债	100,124.58	0.01
52	118038	金宏转债	100,028.60	0.01
53	123216	科顺转债	99,432.02	0.01
54	113631	皖天转债	99,242.12	0.01
55	110086	精工转债	99,027.26	0.01
56	113649	丰山转债	99,012.32	0.01
57	123088	威唐转债	99,009.53	0.01
58	123172	漱玉转债	98,686.34	0.01
59	113627	太平转债	98,658.58	0.01
60	110084	贵燃转债	97,456.94	0.01
61	118031	天 23 转债	97,369.98	0.01
62	127099	盛航转债	97,135.68	0.01
63	127067	恒逸转 2	97,134.80	0.01
64	123155	中陆转债	96,816.46	0.01
65	113661	福 22 转债	96,813.75	0.01
66	111013	新港转债	96,768.48	0.01
67	127027	能化转债	96,714.78	0.01
68	123183	海顺转债	96,710.10	0.01
69	128138	侨银转债	96,650.30	0.01
70	110095	双良转债	96,636.15	0.01
71	113059	福莱转债	96,300.13	0.01
72	123119	康泰转 2	96,239.03	0.01
73	127069	小熊转债	96,187.86	0.01
74	113049	长汽转债	96,075.38	0.01
75	111018	华康转债	95,874.46	0.01
76	113650	博 22 转债	95,596.13	0.01
77	113046	金田转债	94,093.84	0.01
78	123059	银信转债	94,062.16	0.01
79	113658	密卫转债	94,050.37	0.01
80	127034	绿茵转债	93,800.77	0.01
81	123225	翔丰转债	93,757.84	0.01
82	123114	三角转债	93,596.17	0.01
83	113067	燃 23 转债	93,538.69	0.01
84	113636	甬金转债	93,380.45	0.01
85	127031	洋丰转债	93,243.40	0.01
86	123076	强力转债	93,055.30	0.01
87	123085	万顺转 2	92,912.54	0.01
88	127108	太能转债	92,877.59	0.01
89	128142	新乳转债	92,733.04	0.01

90	123144	裕兴转债	92,697.84	0.01
91	127095	广泰转债	92,697.13	0.01
92	128134	鸿路转债	92,537.05	0.01
93	123193	海能转债	92,493.70	0.01
94	113679	芯能转债	92,416.52	0.01
95	127090	兴瑞转债	92,400.07	0.01
96	118052	浩瀚转债	92,011.83	0.01
97	111002	特纸转债	91,549.03	0.01
98	127044	蒙娜转债	91,450.43	0.01
99	110076	华海转债	91,304.53	0.01
100	118024	冠宇转债	91,239.55	0.01
101	113656	嘉诚转债	91,225.90	0.01
102	113647	禾丰转债	90,813.51	0.01
103	111010	立昂转债	90,806.55	0.01
104	123121	帝尔转债	89,581.53	0.01
105	118025	奕瑞转债	89,359.21	0.01
106	113698	凯众转债	89,120.04	0.01
107	118032	建龙转债	88,976.81	0.01
108	118041	星球转债	88,767.12	0.01
109	113655	欧 22 转债	88,765.45	0.01
110	113659	莱克转债	88,724.08	0.01
111	127038	国微转债	88,681.72	0.01
112	113052	兴业转债	88,577.19	0.01
113	123154	火星转债	88,002.54	0.01
114	123109	昌红转债	87,630.00	0.01
115	110090	爱迪转债	87,556.50	0.01
116	127054	双箭转债	87,518.25	0.01
117	113652	伟 22 转债	87,369.19	0.01
118	110074	精达转债	86,877.05	0.01
119	123179	立高转债	86,621.56	0.01
120	123092	天壕转债	86,463.93	0.01
121	127046	百润转债	86,350.42	0.01
122	123168	惠云转债	86,185.99	0.01
123	113670	金 23 转债	86,180.45	0.01
124	123192	科思转债	86,022.52	0.01
125	123198	金埔转债	85,760.74	0.01
126	123117	健帆转债	85,372.23	0.01
127	127056	中特转债	85,205.86	0.01
128	127068	顺博转债	84,803.48	0.01
129	111014	李子转债	84,363.97	0.01
130	113682	益丰转债	84,348.90	0.01
131	127083	山路转债	84,297.08	0.01

132	113674	华设转债	84,283.36	0.01
133	118033	华特转债	84,021.70	0.01
134	123112	万讯转债	83,955.22	0.01
135	127098	欧晶转债	83,741.46	0.01
136	127062	垒知转债	83,527.76	0.01
137	127102	浙建转债	83,332.97	0.01
138	123122	富瀚转债	83,302.24	0.01
139	118011	银微转债	83,277.87	0.01
140	127049	希望转 2	83,217.10	0.01
141	113043	财通转债	83,023.35	0.01
142	113671	武进转债	82,917.80	0.01
143	113691	和邦转债	82,910.63	0.01
144	127078	优彩转债	82,772.85	0.01
145	123151	康医转债	82,185.47	0.01
146	110098	南药转债	82,072.53	0.01
147	118037	上声转债	81,836.74	0.01
148	123224	宇邦转债	81,018.07	0.01
149	113666	爱玛转债	78,123.70	0.01
150	123220	易瑞转债	78,037.38	0.01
151	113053	隆 22 转债	77,982.95	0.01
152	113686	泰瑞转债	77,068.41	0.01
153	118042	奥维转债	74,052.17	0.01
154	118044	赛特转债	55,280.23	0.01
155	118030	睿创转债	54,327.52	0.01
156	118006	阿拉转债	54,026.99	0.01
157	113654	永 02 转债	52,340.84	0.01
158	118003	华兴转债	50,686.29	0.01
159	113687	振华转债	49,981.17	0.01
160	123236	家联转债	48,647.06	0.01
161	113644	艾迪转债	47,244.39	0.01
162	127026	超声转债	45,683.90	0.01
163	123213	天源转债	44,360.27	0.01
164	113039	嘉泽转债	44,172.51	0.01
165	123091	长海转债	42,908.33	0.01
166	118004	博瑞转债	42,575.41	0.01
167	123256	恒帅转债	35,785.78	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 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

本基金本报告期末未持有基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

无。

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	中欧优利债券 A	中欧优利债券 C
报告期期初基金份额总额	1,241,083,035.21	710,796,094.90
报告期期间基金总申购份额	261,647.92	1,032,246.28
减:报告期期间基金总赎回份额	759,330,427.87	462,718,998.40
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	482,014,255.26	249,109,342.78

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) 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