

中欧双利债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 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 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧双利债券	
基金主代码	002961	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
报告期末基金份额总额	4,268,361,332.01 份	
投资目标	在有效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	中债综合指数收益率×90%+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。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C
下属分级基金的交易代码	002961	002962
报告期末下属分级基金的份额总额	4,014,526,646.45 份	253,834,685.56 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C
1. 本期已实现收益	173,594,698.17	8,809,879.43
2. 本期利润	70,233,084.16	3,267,332.23
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0111
4. 期末基金资产净值	4,906,824,928.98	298,412,804.14
5. 期末基金份额净值	1.2223	1.1756

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

中欧双利债券 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	0.85%	0.24%	1.74%	0.14%	-0.89%	0.10%
过去六个月	0.88%	0.24%	1.62%	0.12%	-0.74%	0.12%
过去一年	5.71%	0.22%	1.98%	0.11%	3.73%	0.11%
过去三年	14.42%	0.23%	7.80%	0.11%	6.62%	0.12%
过去五年	12.84%	0.24%	7.84%	0.11%	5.00%	0.13%
过去七年	35.15%	0.25%	13.34%	0.12%	21.81%	0.13%
自基金合同生效起至今	49.87%	0.23%	14.60%	0.12%	35.27%	0.11%

中欧双利债券 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	0.75%	0.24%	1.74%	0.14%	-0.99%	0.10%
过去六个月	0.69%	0.24%	1.62%	0.12%	-0.93%	0.12%
过去一年	5.30%	0.22%	1.98%	0.11%	3.32%	0.11%
过去三年	13.07%	0.23%	7.80%	0.11%	5.27%	0.12%
过去五年	10.60%	0.24%	7.84%	0.11%	2.76%	0.13%
过去七年	31.50%	0.25%	13.34%	0.12%	18.16%	0.13%
自基金合同生效起至今	44.31%	0.23%	14.60%	0.12%	29.71%	0.11%

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		
黄华	多资产投决会主席/投资总监/基金经理	2017-04-05	—	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。
许文星	权益专户投决会委员/多资产投决会委员/解决方案组组长/基金经理/投资经理	2026-05-19	—	12 年	历任光大保德信基金管理有限公司研究部行业研究员, 光大保德信基金管理有限公司投资经理。2018-02-05 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
许文星	公募基金	6	8,088,863,585.45	2018 年 4 月 16 日
	私募资产管理计划	2	1,147,968,097.75	2024 年 2 月 19 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	9,236,831,683.20	-

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 8 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

在 AI 投资热潮与地缘扰动交织的背景下，二季度 A 股呈现极致的结构性分化行情。全球方面，美国经济韧性尚可但通胀压力有所回升，美联储连续维持利率不变，6 月点阵图传递偏鹰信号；欧央行则于 6 月率先降息，海外流动性环境边际趋紧。国内方面，经济延续“外需强、内需弱，新动能强、传统弱”的分化格局：一季度实现强劲开局后，二季度增长动能边际放缓。出口与高

技术制造构成核心支撑，AI 产业链景气度维持高位，而消费复苏仍处进程中，地产仍在调整，物价温和低位修复。政策面上，财政政策“更加积极”、靠前发力，货币政策保持“适度宽松”，通过定向降息与结构性工具精准滴灌，MLF 超额续作，资金面全季保持合理充裕偏松，形成“内松外紧”的政策组合。经济基本面利好权益市场中新动能方向，宽松资金面则为债市持续提供支撑。

受此宏观环境影响，资金高度集中抱团科技成长主线，赚钱效应主要集中于 AI 及 TMT 产业链。受内需偏弱拖累，消费、中游制造、金融地产等多数板块承压，申万一级行业跌多涨少，个股上涨比例偏低。权益上行带动转债市场收涨，但涨幅明显落后于正股。当前转债估值仍处历史极高分位，配置价值逐步弱化，叠加权益市场分化，转债更多体现为结构性的交易机会。

债券市场二季度震荡走强，利率整体下行。短端在充裕流动性支撑下下行更为顺畅，长端则在基本面偏弱与供给扰动之间震荡下移，收益率曲线趋于陡峭化。信用债与利率债呈同向下行，低等级、长久期品种表现更优。6 月以来，受资金面收紧及基金赎回压力影响，市场在绝对收益低位经历小幅快速回调，债券资产波动率有所抬升，性价比相应降低。

组合操作层面，权益方面仍较多暴露于高股息等偏价值板块，在二季度极端行情下形成一定拖累。配置思路，组合以大盘风格为底仓，同时关注科技相关成长板块。债券方面，较好把握了资本利得带来的收益机会：关注长久期利率债及二永债的配置机会以抬升组合久期，同时减仓绝对收益已处极低位置的短端信用债，兑现收益。

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 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%；基金 C 类份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

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	945,566,310.84	14.37
	其中：股票	945,566,310.84	14.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,594,632,981.11	85.02
	其中：债券	5,594,632,981.11	85.02

	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	28,323,000.02	0.43
8	其他资产	11,764,727.31	0.18
9	合计	6,580,287,019.28	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	12,905,312.00	0.25
B	采矿业	45,901,115.00	0.88
C	制造业	647,895,600.49	12.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,322,850.00	0.37
E	建筑业	2,518,952.00	0.05
F	批发和零售业	19,067,046.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	31,102,786.00	0.60
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,648,509.17	0.90
J	金融业	84,581,256.00	1.62
K	房地产业	1,598,116.00	0.03
L	租赁和商务服务业	12,104,760.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	3,550,442.18	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	14,029,478.00	0.27
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	4,340,088.00	0.08
S	综合	—	—
	合计	945,566,310.84	18.17

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	300308	中际旭创	20,700	26,289,000.00	0.51
2	603986	兆易创新	22,300	18,174,500.00	0.35
3	300750	宁德时代	32,000	12,576,320.00	0.24
4	002493	荣盛石化	1,104,200	11,870,150.00	0.23
5	300502	新易盛	19,400	11,775,800.00	0.23
6	000703	恒逸石化	724,600	9,832,822.00	0.19
7	600000	浦发银行	1,079,100	9,291,051.00	0.18
8	600320	振华重工	2,186,000	9,028,180.00	0.17
9	688002	睿创微纳	56,339	8,715,079.91	0.17
10	600623	华谊集团	1,064,800	8,592,936.00	0.17

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	2,127,092,099.27	40.86
	其中：政策性金融债	861,812,580.82	16.56
4	企业债券	288,509,661.92	5.54
5	企业短期融资券	30,256,882.19	0.58
6	中期票据	2,864,578,807.65	55.03
7	可转债（可交换债）	284,195,530.08	5.46
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,594,632,981.11	107.48

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	260205	26 国开 05	2,000,000	203,710,904.11	3.91
2	232480098	24 浦发银行二级资本债 02A	1,000,000	102,676,602.74	1.97
3	102583392	25 湖交投 MTN001	1,000,000	102,226,334.25	1.96
4	260203	26 国开 03	1,000,000	101,228,575.34	1.94
5	240215	24 国开 15	800,000	84,878,838.36	1.63

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, 以力争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, 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。上海浦东发展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、中国人民银行、中国人民银行上海市分行(国家外汇管理局上海市分局)的处罚。中国建设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、中国人民银行的处罚。中国黄金集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到内蒙古自治区人民政府事故调查组的处罚。中国工商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、中国人民银行、中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、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	948,181.71
2	应收证券清算款	10,602,338.72
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	214,206.88
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	11,764,727.31

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	123178	花园转债	18,202,078.29	0.35
2	118040	宏微转债	18,100,723.96	0.35
3	123251	华医转债	17,406,230.65	0.33
4	127067	恒逸转 2	17,255,440.41	0.33
5	123253	永贵转债	17,058,100.83	0.33
6	113624	正川转债	17,057,090.57	0.33
7	113658	密卫转债	17,019,307.19	0.33
8	123216	科顺转债	16,917,984.11	0.33
9	118031	天 23 转债	16,917,557.60	0.33
10	127105	龙星转债	16,749,862.98	0.32
11	127034	绿茵转债	977,238.29	0.02
12	123188	水羊转债	975,710.25	0.02
13	123117	健帆转债	952,992.93	0.02
14	123225	翔丰转债	950,066.47	0.02
15	123213	天源转债	941,232.51	0.02
16	113042	上银转债	934,608.89	0.02
17	113049	长汽转债	926,605.77	0.02
18	113056	重银转债	910,591.68	0.02
19	123113	仙乐转债	907,068.80	0.02
20	113627	太平转债	903,768.65	0.02
21	127030	盛虹转债	898,455.72	0.02
22	111004	明新转债	898,113.75	0.02

23	127040	国泰转债	894,550.33	0.02
24	123183	海顺转债	889,431.94	0.02
25	111015	东亚转债	883,273.19	0.02
26	123245	集智转债	882,797.21	0.02
27	127044	蒙娜转债	881,530.08	0.02
28	113647	禾丰转债	880,766.57	0.02
29	113655	欧 22 转债	879,842.33	0.02
30	113636	甬金转债	879,774.41	0.02
31	123243	严牌转债	875,708.80	0.02
32	127103	东南转债	873,017.71	0.02
33	123122	富瀚转债	872,917.22	0.02
34	118022	锂科转债	871,884.56	0.02
35	123119	康泰转 2	868,581.56	0.02
36	110086	精工转债	867,271.81	0.02
37	127046	百润转债	863,133.78	0.02
38	113046	金田转债	861,652.50	0.02
39	123192	科思转债	858,408.08	0.02
40	123144	裕兴转债	857,904.30	0.02
41	127031	洋丰转债	857,804.98	0.02
42	113054	绿动转债	851,455.35	0.02
43	127096	泰坦转债	850,830.73	0.02
44	123258	胜蓝转 02	844,932.93	0.02
45	111018	华康转债	844,784.30	0.02
46	110077	洪城转债	844,302.78	0.02
47	113062	常银转债	843,242.77	0.02
48	123247	万凯转债	842,171.66	0.02
49	111009	盛泰转债	841,004.10	0.02
50	123165	回天转债	839,793.68	0.02
51	123104	卫宁转债	836,699.64	0.02
52	113633	科沃转债	836,595.33	0.02
53	110097	天润转债	831,673.91	0.02
54	113650	博 22 转债	828,757.20	0.02
55	110084	贵燃转债	828,747.79	0.02
56	123215	铭利转债	826,899.43	0.02
57	127095	广泰转债	826,489.41	0.02
58	123168	惠云转债	826,264.23	0.02
59	127049	希望转 2	825,323.15	0.02
60	127062	垒知转债	824,374.66	0.02
61	113058	友发转债	823,967.53	0.02
62	123154	火星转债	823,438.92	0.02
63	113665	汇通转债	821,566.16	0.02
64	123187	超达转债	820,617.34	0.02

65	110095	双良转债	820,066.45	0.02
66	113625	江山转债	818,542.77	0.02
67	113688	国检转债	812,981.21	0.02
68	113649	丰山转债	810,948.99	0.02
69	113670	金 23 转债	809,900.98	0.02
70	118016	京源转债	809,016.34	0.02
71	123150	九强转债	808,569.16	0.02
72	123107	温氏转债	807,130.34	0.02
73	113680	丽岛转债	804,467.07	0.02
74	123155	中陆转债	802,673.81	0.02
75	123133	佩蒂转债	800,724.52	0.02
76	110093	神马转债	796,659.66	0.02
77	127108	太能转债	796,278.91	0.02
78	123076	强力转债	793,361.76	0.02
79	127060	湘佳转债	790,648.92	0.02
80	123112	万讯转债	788,139.55	0.02
81	118024	冠宇转债	787,266.22	0.02
82	123151	康医转债	786,490.60	0.02
83	110087	天业转债	783,285.66	0.02
84	111020	合顺转债	780,506.34	0.01
85	127059	永东转 2	779,914.13	0.01
86	127083	山路转债	777,369.44	0.01
87	127054	双箭转债	776,911.08	0.01
88	113052	兴业转债	774,539.84	0.01
89	123224	宇邦转债	774,445.44	0.01
90	113682	益丰转债	774,304.17	0.01
91	110085	通 22 转债	773,581.69	0.01
92	123149	通裕转债	770,259.70	0.01
93	113634	珀莱转债	768,089.02	0.01
94	127102	浙建转债	767,732.47	0.01
95	113659	莱克转债	766,927.76	0.01
96	111014	李子转债	764,903.82	0.01
97	123172	漱玉转债	763,137.39	0.01
98	113656	嘉诚转债	760,278.84	0.01
99	127085	韵达转债	759,571.95	0.01
100	113692	保隆转债	759,316.67	0.01
101	123252	银邦转债	758,190.36	0.01
102	113674	华设转债	757,776.99	0.01
103	113638	台 21 转债	754,460.94	0.01
104	123214	东宝转债	754,206.88	0.01
105	113631	皖天转债	754,047.29	0.01
106	123109	昌红转债	752,814.86	0.01

107	118042	奥维转债	751,480.01	0.01
108	113698	凯众转债	750,721.49	0.01
109	118032	建龙转债	749,196.48	0.01
110	123194	百洋转债	748,244.62	0.01
111	127110	广核转债	748,036.08	0.01
112	127069	小熊转债	747,044.68	0.01
113	113696	伯 25 转债	746,200.00	0.01
114	111002	特纸转债	746,013.22	0.01
115	123193	海能转债	743,024.56	0.01
116	127078	优彩转债	742,554.21	0.01
117	110098	南药转债	741,444.65	0.01
118	111003	聚合转债	739,410.62	0.01
119	127099	盛航转债	739,220.71	0.01
120	118044	赛特转债	738,909.01	0.01
121	113070	渝水转债	737,857.96	0.01
122	123092	天壕转债	735,944.92	0.01
123	113059	福莱转债	732,684.55	0.01
124	118012	微芯转债	731,950.35	0.01
125	127084	柳工转 2	731,529.88	0.01
126	110090	爱迪转债	730,303.58	0.01
127	111017	蓝天转债	726,223.12	0.01
128	123241	欧通转债	726,158.47	0.01
129	113679	芯能转债	723,009.51	0.01
130	127045	牧原转债	720,582.83	0.01
131	113661	福 22 转债	720,415.86	0.01
132	127082	亚科转债	717,752.61	0.01
133	113067	燃 23 转债	714,492.22	0.01
134	113048	晶科转债	712,966.31	0.01
135	123196	正元转 02	712,621.40	0.01
136	123179	立高转债	712,438.32	0.01
137	127056	中特转债	710,043.73	0.01
138	113652	伟 22 转债	709,822.09	0.01
139	123263	鼎捷转债	708,411.32	0.01
140	113686	泰瑞转债	704,088.76	0.01
141	113648	巨星转债	698,605.84	0.01
142	127050	麒麟转债	696,658.44	0.01
143	113660	寿 22 转债	691,436.49	0.01
144	113643	风语转债	686,531.07	0.01
145	127068	顺博转债	682,864.87	0.01
146	113053	隆 22 转债	681,198.87	0.01
147	113640	苏利转债	655,797.22	0.01
148	113066	平煤转债	648,757.14	0.01

149	113043	财通转债	627,478.82	0.01
-----	--------	------	------------	------

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	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C
报告期期初基金份额总额	6,095,452,245.94	333,054,525.20
报告期期间基金总申购份额	995,090,795.95	27,185,290.18
减:报告期期间基金总赎回份额	3,076,016,395.44	106,405,129.82
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	4,014,526,646.45	253,834,685.56

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 7 月 21 日