

中欧可转债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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	2,027,162,210.59 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	487,188,159.02 份	285,025,128.08 份	1,254,948,923.49 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	57,426,007.10	33,441,296.19	94,946,373.73
2. 本期利润	51,535,303.68	49,042,494.48	94,917,007.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0666	0.0951	0.0618
4. 期末基金资产净值	789,407,240.54	446,748,334.68	2,033,310,311.25
5. 期末基金份额净值	1.6203	1.5674	1.6202

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	3.17%	0.96%	3.92%	0.69%	-0.75%	0.27%
过去六个月	2.32%	1.05%	2.80%	0.75%	-0.48%	0.30%
过去一年	14.87%	0.94%	12.07%	0.64%	2.80%	0.30%
过去三年	23.38%	0.95%	21.23%	0.54%	2.15%	0.41%
过去五年	12.85%	0.97%	23.54%	0.52%	-10.69%	0.45%
过去七年	46.58%	0.96%	46.58%	0.53%	0.00%	0.43%
自基金合同生效起至今	62.03%	0.92%	53.38%	0.55%	8.65%	0.37%

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	3.06%	0.96%	3.92%	0.69%	-0.86%	0.27%
过去六个月	2.11%	1.05%	2.80%	0.75%	-0.69%	0.30%
过去一年	14.41%	0.94%	12.07%	0.64%	2.34%	0.30%
过去三年	21.91%	0.95%	21.23%	0.54%	0.68%	0.41%
过去五年	10.61%	0.97%	23.54%	0.52%	-12.93%	0.45%
过去七年	42.62%	0.96%	46.58%	0.53%	-3.96%	0.43%
自基金合同 生效起至今	56.74%	0.92%	53.38%	0.55%	3.36%	0.37%

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	3.17%	0.96%	3.92%	0.69%	-0.75%	0.27%
过去六个月	2.32%	1.06%	2.80%	0.75%	-0.48%	0.31%
过去一年	14.87%	0.94%	12.07%	0.64%	2.80%	0.30%
自基金份额 起始运作日 至今	23.03%	0.89%	16.73%	0.59%	6.30%	0.30%

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 06 月 30 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 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

2026 年二季度权益市场先跌后涨，指数经历美伊冲突的扰动后，整体上呈现触底反弹。但二季度市场的风格出现了比较大的变化，在二季度的反弹行情中，科技板块几乎一枝独秀，而非科技方向持续下跌，市场的分化到了比较极致的水平。我们认为，二季度市场的抱团本质上是在“避险”。战争导致油价上行，演绎到通胀加剧、美国加息、全球衰退，成为资本市场一条“隐含”的交易线索。科技作为为数不多景气度持续的方向，则成为了资金避险的选择。而基本面传导到股价，动量效应加持下，资金不断抱团，造成了风格的剧烈分化。

展望三季度，我们整体上认为市场的风格会有再平衡的趋势。首先，三季度全球宏观层面已经在发生变化。随着海峡的放开，油价目前已经大幅回落，市场围绕高油价的定价机制则还没有完全转变，这是三季度潜在的预期差。一旦市场打破通胀、加息、衰退的链条后，前期受压制的资产会有估值修复的动力。其次，国内层面，上半年财政支出偏紧，下半年可能也会有回补的动力。因此，无论是海外还是国内，宏观层面都在发生一些边际变化。

而从交易角度来说，科技的边际夏普走弱，风格有再平衡的可能。我们认为市场近两年的主线其实是追逐每个阶段边际夏普最高的资产，对于持仓体验有很强的敏感性。科技从 6 月下旬开始波动明显上升，板块内部轮动也在加速，持仓体验有所下降。7 月季报期+科技龙头股上市，预计波动会进一步加大。而随着科技边际夏普的走弱，资金会有做再平衡的动力。前期超跌的行业可能会有修复性行情。

转债方面，二季度整体表现不佳，核心也是受制于权益的风格。转债作为偏小盘风格的资产，

比较吃市场的“宽度”，对微观流动性和风险偏好比较敏感。而二季度以来市场不断缩圈，科技抱团、个股普跌，对于转债是不太友好的环境。三季度我们认为市场风格有再平衡的趋势，而对于转债来说，风格再平衡的影响可能会比股票更早。毕竟转债是区间性更强的资产，自带左侧基因。低价券向下有债底保护，高价券向上有溢价率的约束，分化的斜率到了后期会明显放缓。因此，我们整体看好三季度转债的表现，其左侧的价值可能很快就要开始体现。

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 3.17%，同期业绩比较基准收益率为 3.92%；基金 C 类份额净值增长率为 3.06%，同期业绩比较基准收益率为 3.92%；基金 E 类份额净值增长率为 3.17%，同期业绩比较基准收益率为 3.92%。

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	3,508,912,878.44	96.16
	其中：债券	3,508,912,878.44	96.16
	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	111,722,370.90	3.06
8	其他资产	28,425,620.16	0.78
9	合计	3,649,060,869.50	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	270,966,557.51	8.29
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）	3,237,946,320.93	99.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,508,912,878.44	107.32

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	986,000	99,634,543.62	3.05
2	019785	25 国债 13	866,000	87,693,366.52	2.68
3	019827	26 国债 01	831,000	83,638,647.37	2.56
4	110084	贵燃转债	283,290	36,063,895.83	1.10
5	113042	上银转债	308,910	35,687,272.07	1.09

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, 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。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。武汉华康世纪洁净科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到扬州市邗江区税务局邗上税务分局的处罚。

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

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	598,941.00
2	应收证券清算款	27,254,897.46
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	571,781.70
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	28,425,620.16

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	110084	贵燃转债	36,063,895.83	1.10
2	113042	上银转债	35,687,272.07	1.09
3	113056	重银转债	35,470,722.40	1.08
4	113062	常银转债	35,238,671.71	1.08
5	127095	广泰转债	35,157,479.51	1.08
6	123216	科顺转债	35,135,093.80	1.07
7	123251	华医转债	34,991,275.56	1.07
8	113658	密卫转债	34,078,020.69	1.04
9	127067	恒逸转 2	33,597,008.88	1.03
10	123149	通裕转债	33,560,348.11	1.03
11	113058	友发转债	33,557,834.24	1.03
12	113052	兴业转债	33,526,181.53	1.03
13	127084	柳工转 2	32,994,472.66	1.01
14	111002	特纸转债	32,985,991.78	1.01
15	128136	立讯转债	31,213,624.87	0.95
16	127034	绿茵转债	30,969,525.43	0.95
17	123225	翔丰转债	30,702,549.21	0.94
18	123258	胜蓝转 02	30,270,335.63	0.93
19	113631	皖天转债	29,807,200.27	0.91
20	123252	银邦转债	29,510,013.45	0.90
21	123122	富瀚转债	29,509,377.94	0.90
22	127030	盛虹转债	28,861,446.31	0.88
23	113688	国检转债	28,839,368.08	0.88
24	118031	天 23 转债	28,680,859.68	0.88
25	123107	温氏转债	28,617,488.93	0.88
26	113046	金田转债	27,907,670.63	0.85
27	127031	洋丰转债	27,588,453.22	0.84
28	127040	国泰转债	27,547,750.63	0.84
29	123119	康泰转 2	27,380,032.38	0.84
30	118022	锂科转债	27,375,060.06	0.84

31	110098	南药转债	26,596,848.76	0.81
32	127078	优彩转债	26,501,120.17	0.81
33	113643	风语转债	26,335,543.38	0.81
34	110093	神马转债	26,260,393.40	0.80
35	123091	长海转债	26,008,898.00	0.80
36	110086	精工转债	25,806,941.11	0.79
37	127046	百润转债	25,760,448.20	0.79
38	127102	浙建转债	25,535,753.43	0.78
39	113048	晶科转债	25,488,545.47	0.78
40	113691	和邦转债	25,381,146.97	0.78
41	127103	东南转债	25,138,876.37	0.77
42	113067	燃 23 转债	24,915,311.75	0.76
43	113043	财通转债	24,872,635.73	0.76
44	127083	山路转债	24,837,873.61	0.76
45	113627	太平转债	24,672,656.52	0.75
46	113054	绿动转债	24,004,399.95	0.73
47	127096	泰坦转债	23,997,789.86	0.73
48	123076	强力转债	23,582,863.69	0.72
49	123194	百洋转债	23,510,379.57	0.72
50	123192	科思转债	23,294,742.76	0.71
51	123247	万凯转债	23,014,254.72	0.70
52	127025	冀东转债	22,880,562.08	0.70
53	123183	海顺转债	22,802,913.28	0.70
54	110077	洪城转债	22,754,245.71	0.70
55	118040	宏微转债	22,745,195.05	0.70
56	113680	丽岛转债	22,548,145.15	0.69
57	123117	健帆转债	22,532,627.62	0.69
58	128129	青农转债	22,511,028.66	0.69
59	111009	盛泰转债	22,115,557.08	0.68
60	113624	正川转债	21,377,138.48	0.65
61	113650	博 22 转债	21,251,520.90	0.65
62	123213	天源转债	21,231,736.55	0.65
63	123241	欧通转债	20,995,995.89	0.64
64	113605	大参转债	20,741,620.23	0.63
65	127044	蒙娜转债	20,521,255.83	0.63
66	123178	花园转债	19,289,363.24	0.59
67	123188	水羊转债	19,097,437.27	0.58
68	127099	盛航转债	18,796,006.65	0.57
69	123245	集智转债	18,629,192.03	0.57
70	113636	甬金转债	18,472,632.43	0.57
71	113066	平煤转债	17,946,120.69	0.55
72	127064	杭氧转债	17,862,052.33	0.55

73	111015	东亚转债	17,837,658.72	0.55
74	110075	南航转债	17,676,889.79	0.54
75	118011	银微转债	17,228,232.02	0.53
76	113673	岱美转债	16,863,448.36	0.52
77	123092	天壕转债	16,754,540.83	0.51
78	127027	能化转债	16,359,521.87	0.50
79	127109	电化转债	15,784,618.80	0.48
80	118056	路维转债	15,696,218.57	0.48
81	123215	铭利转债	15,661,573.45	0.48
82	118053	正帆转债	15,582,989.80	0.48
83	123224	宇邦转债	15,020,822.93	0.46
84	118016	京源转债	14,712,569.44	0.45
85	118059	顾中转债	14,634,762.97	0.45
86	128142	新乳转债	14,627,359.04	0.45
87	127111	金威转债	13,473,227.01	0.41
88	113694	清源转债	13,400,542.36	0.41
89	113677	华懋转债	12,940,987.81	0.40
90	113678	中贝转债	12,779,002.06	0.39
91	113667	春 23 转债	12,254,942.23	0.37
92	113049	长汽转债	12,246,193.30	0.37
93	118034	晶能转债	12,028,740.60	0.37
94	111004	明新转债	11,815,884.68	0.36
95	118060	瑞可转债	11,803,794.30	0.36
96	123113	仙乐转债	11,796,412.80	0.36
97	123243	严牌转债	11,795,818.50	0.36
98	127105	龙星转债	11,766,823.47	0.36
99	113647	禾丰转债	11,749,333.61	0.36
100	113655	欧 22 转债	11,699,682.99	0.36
101	111018	华康转债	11,444,300.13	0.35
102	123253	永贵转债	11,421,666.74	0.35
103	110095	双良转债	11,236,806.46	0.34
104	123165	回天转债	11,154,402.48	0.34
105	123144	裕兴转债	11,153,940.80	0.34
106	123168	惠云转债	11,148,796.71	0.34
107	127049	希望转 2	11,104,940.11	0.34
108	123104	卫宁转债	11,000,770.41	0.34
109	123187	超达转债	10,928,169.61	0.33
110	113625	江山转债	10,892,915.38	0.33
111	123154	火星转债	10,879,163.29	0.33
112	127062	垒知转债	10,858,672.60	0.33
113	123133	佩蒂转债	10,818,082.02	0.33
114	113670	金 23 转债	10,808,152.20	0.33

115	113649	丰山转债	10,805,863.51	0.33
116	113633	科沃转债	10,796,793.03	0.33
117	113665	汇通转债	10,734,737.18	0.33
118	118024	冠宇转债	10,733,322.65	0.33
119	110097	天润转债	10,699,905.91	0.33
120	123155	中陆转债	10,667,381.59	0.33
121	127108	太能转债	10,664,405.16	0.33
122	110085	通 22 转债	10,403,610.25	0.32
123	123150	九强转债	10,402,203.19	0.32
124	127054	双箭转债	10,396,504.93	0.32
125	127060	湘佳转债	10,373,722.20	0.32
126	123151	康医转债	10,371,290.51	0.32
127	110087	天业转债	10,318,626.16	0.32
128	123071	天能转债	10,279,094.73	0.31
129	127059	永东转 2	10,271,979.14	0.31
130	123172	漱玉转债	10,182,028.67	0.31
131	111020	合顺转债	10,171,273.33	0.31
132	118042	奥维转债	10,131,888.20	0.31
133	113634	珀莱转债	10,108,446.02	0.31
134	113659	莱克转债	10,022,120.53	0.31
135	128134	鸿路转债	10,015,357.87	0.31
136	111014	李子转债	9,956,774.36	0.30
137	113656	嘉诚转债	9,906,804.13	0.30
138	113674	华设转债	9,902,882.25	0.30
139	113638	台 21 转债	9,898,862.34	0.30
140	118032	建龙转债	9,868,303.25	0.30
141	127110	广核转债	9,804,803.92	0.30
142	127069	小熊转债	9,757,240.56	0.30
143	127045	牧原转债	9,753,687.14	0.30
144	113682	益丰转债	9,733,581.99	0.30
145	123193	海能转债	9,732,750.58	0.30
146	118062	天准转债	9,700,643.03	0.30
147	123214	东宝转债	9,616,781.30	0.29
148	113059	福莱转债	9,611,868.17	0.29
149	113692	保隆转债	9,577,915.25	0.29
150	111017	蓝天转债	9,571,309.59	0.29
151	127085	韵达转债	9,529,393.21	0.29
152	113698	凯众转债	9,494,418.85	0.29
153	113679	芯能转债	9,468,551.73	0.29
154	113696	伯 25 转债	9,374,300.00	0.29
155	123109	昌红转债	9,342,486.58	0.29
156	113661	福 22 转债	9,298,260.66	0.28

157	123179	立高转债	9,235,267.10	0.28
158	113648	巨星转债	9,225,360.64	0.28
159	127082	亚科转债	9,178,180.67	0.28
160	118044	赛特转债	9,167,945.18	0.28
161	110090	爱迪转债	9,121,424.76	0.28
162	113652	伟 22 转债	9,109,383.53	0.28
163	127056	中特转债	9,104,574.05	0.28
164	123196	正元转 02	9,076,864.07	0.28
165	118039	煜邦转债	9,058,994.37	0.28
166	113070	渝水转债	9,017,713.73	0.28
167	127050	麒麟转债	8,993,342.01	0.28
168	123263	鼎捷转债	8,948,880.73	0.27
169	118012	微芯转债	8,855,731.30	0.27
170	113053	隆 22 转债	8,854,394.46	0.27
171	118005	天奈转债	8,794,019.29	0.27
172	123222	博俊转债	8,744,662.80	0.27
173	113686	泰瑞转债	8,731,879.04	0.27
174	123114	三角转债	8,699,820.92	0.27
175	113640	苏利转债	8,657,029.77	0.26
176	127068	顺博转债	8,627,322.39	0.26
177	127072	博实转债	8,460,803.61	0.26
178	113666	爱玛转债	8,438,510.58	0.26
179	123176	精测转 2	8,435,261.59	0.26
180	118037	上声转债	8,292,311.36	0.25
181	111021	奥锐转债	8,204,690.47	0.25
182	123112	万讯转债	8,191,607.28	0.25
183	111003	聚合转债	7,891,552.49	0.24
184	113695	华辰转债	7,828,617.47	0.24
185	123235	亿田转债	7,765,706.05	0.24
186	118051	皓元转债	7,557,819.08	0.23
187	113632	鹤 21 转债	7,483,574.49	0.23
188	127098	欧晶转债	7,314,414.66	0.22
189	127089	晶澳转债	6,979,409.23	0.21
190	123160	泰福转债	5,920,110.95	0.18
191	123180	浙矿转债	5,776,471.55	0.18
192	118050	航宇转债	5,584,971.88	0.17
193	127055	精装转债	5,158,367.08	0.16
194	113671	武进转债	5,094,302.54	0.16
195	113660	寿 22 转债	4,330,765.12	0.13
196	113616	韦尔转债	2,764,603.41	0.08

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	838,856,087.95	743,338,329.39	1,673,912,729.45
报告期期间基金总申购份额	263,662,545.11	157,510,848.35	452,795,570.34
减：报告期期间基金总赎回份额	615,330,474.04	615,824,049.66	871,759,376.30
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	487,188,159.02	285,025,128.08	1,254,948,923.49

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 05 月 29 日至 2026 年 06 月 30 日	561,914,337.39	0.00	0.00	561,914,337.39	27.72%

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)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