

中欧聚瑞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：招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。

基金托管人招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	中欧聚瑞债券		
基金主代码	005419		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 8 月 2 日		
报告期末基金份额总额	419,788,509.23 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	本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。		
业绩比较基准	中债综合指数收益率		
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	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
下属分级基金的交易代码	005419	005420	019474
报告期末下属分级基金的份额总额	307,154,344.17 份	794,738.25 份	111,839,426.81 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）		
	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
1. 本期已实现收益	359, 503. 12	4, 066. 31	-132, 507. 90
2. 本期利润	-1, 606, 388. 51	-3, 837. 29	-893, 022. 24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0059	-0. 0042	-0. 0106
4. 期末基金资产净值	328, 440, 549. 64	820, 395. 28	119, 266, 789. 79
5. 期末基金份额净值	1. 0693	1. 0323	1. 0664

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

中欧聚瑞债券 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. 46%	0. 16%	0. 62%	0. 04%	-1. 08%	0. 12%
过去六个月	-0. 02%	0. 12%	0. 91%	0. 04%	-0. 93%	0. 08%
过去一年	0. 15%	0. 09%	-0. 56%	0. 06%	0. 71%	0. 03%
过去三年	6. 91%	0. 07%	5. 12%	0. 08%	1. 79%	-0. 01%
过去五年	13. 83%	0. 06%	8. 48%	0. 07%	5. 35%	-0. 01%
过去七年	17. 88%	0. 06%	10. 29%	0. 07%	7. 59%	-0. 01%
自基金合同生效起至今	17. 50%	0. 06%	12. 44%	0. 07%	5. 06%	-0. 01%

中欧聚瑞债券 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. 58%	0. 16%	0. 62%	0. 04%	-1. 20%	0. 12%

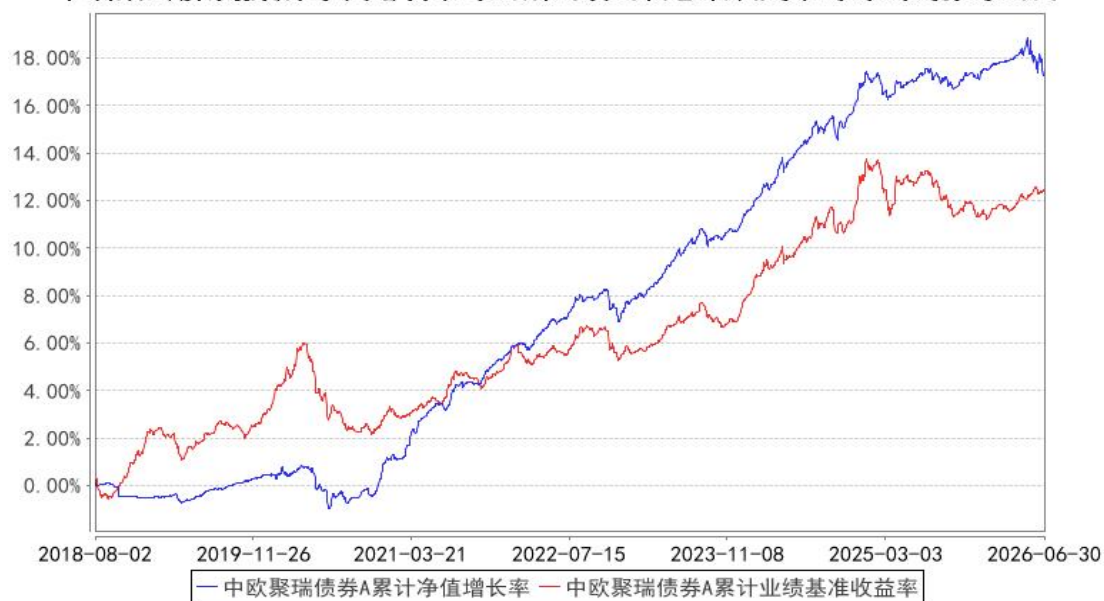
过去六个月	-0.33%	0.12%	0.91%	0.04%	-1.24%	0.08%
过去一年	-0.44%	0.09%	-0.56%	0.06%	0.12%	0.03%
过去三年	5.25%	0.07%	5.12%	0.08%	0.13%	-0.01%
过去五年	10.97%	0.06%	8.48%	0.07%	2.49%	-0.01%
过去七年	14.16%	0.06%	10.29%	0.07%	3.87%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	13.67%	0.06%	12.44%	0.07%	1.23%	-0.01%

中欧聚瑞债券 D

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	-0.50%	0.16%	0.62%	0.04%	-1.12%	0.12%
过去六个月	-0.08%	0.12%	0.91%	0.04%	-0.99%	0.08%
过去一年	0.07%	0.09%	-0.56%	0.06%	0.63%	0.03%
自基金份额 起始运作日 至今	6.27%	0.07%	4.92%	0.08%	1.35%	-0.01%

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

中欧聚瑞债券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



中欧聚瑞债券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 2023 年 9 月 9 日新增 D 类份额，图示日期为 2023 年 9 月 14 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		
苏佳	基金经理 /基金经 理助理	2025-05-21	-	9 年	历任广发银行股份有限公司总行金融机 构部行员，易方达基金管理有限公司投资 支持专员，易方达基金管理有限公司投资 经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管 理有限公司。
李波	基金经理 /基金经 理助理	2026-02-09	-	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。
雷志强	固收投决 会委员/ 利率组组 长/指数 组组长/ 基金经理	2025-08-13	-	14 年	历任交通银行股份有限公司总行资产负 债管理部高级定价管理经理，兴业基金管 理有限公司固定收益投资部货币与利率 团队副总监、基金经理。2024-01-25 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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中苏佳担任本基金的基金经理；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。

操作层面，二季度随着转债市场的下跌，组合整体增加了转债的仓位，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。

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-0.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%；基金 C 类份额净值增长率为-0.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%；基金 D 类份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

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	429,897,207.66	94.12
	其中：债券	429,897,207.66	94.12
	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	7,544,679.50	1.65
8	其他资产	19,322,529.12	4.23
9	合计	456,764,416.28	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

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	130,338,833.56	29.06
2	央行票据	—	—
3	金融债券	60,872,734.25	13.57
	其中：政策性金融债	60,872,734.25	13.57
4	企业债券	45,639,565.21	10.18
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	81,236,739.73	18.11
7	可转债（可交换债）	101,511,246.51	22.63
8	同业存单	—	—
9	其他	10,298,088.40	2.30
10	合计	429,897,207.66	95.85

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	220208	22 国开 08	400,000	40,568,219.18	9.04
2	019832	26 国债 06	402,000	40,393,642.85	9.01
3	019829	26 国债 03	290,000	29,345,799.18	6.54
4	019827	26 国债 01	249,000	25,061,399.75	5.59
5	102482884	24 张家国资 MTN001	200,000	20,808,942.47	4.64

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，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。上海证券有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到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。

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	35,676.86
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	19,286,852.26
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	19,322,529.12

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	123216	科顺转债	1,180,443.18	0.26
2	127103	东南转债	1,168,345.49	0.26
3	113046	金田转债	1,163,097.49	0.26
4	110084	贵燃转债	1,148,280.35	0.26
5	127067	恒逸转 2	1,144,869.63	0.26
6	127046	百润转债	1,142,864.73	0.25
7	123247	万凯转债	1,101,128.19	0.25
8	123251	华医转债	1,094,709.35	0.24
9	113048	晶科转债	1,079,562.46	0.24
10	127064	杭氧转债	1,064,504.61	0.24
11	127084	柳工转 2	1,061,543.36	0.24
12	123188	水羊转债	1,050,979.32	0.23
13	123183	海顺转债	1,047,190.51	0.23
14	113691	和邦转债	1,032,665.01	0.23
15	128136	立讯转债	1,025,084.94	0.23
16	113673	岱美转债	1,011,806.90	0.23
17	113066	平煤转债	1,006,350.94	0.22
18	113043	财通转债	1,002,403.93	0.22
19	113688	国检转债	998,115.54	0.22
20	123252	银邦转债	947,737.95	0.21
21	111002	特纸转债	944,045.82	0.21
22	123225	翔丰转债	931,766.63	0.21

23	127034	绿茵转债	929,538.30	0.21
24	118040	宏微转债	896,533.17	0.20
25	123258	胜蓝转 02	883,498.33	0.20
26	113058	友发转债	881,453.64	0.20
27	123149	通裕转债	869,862.25	0.19
28	113658	密卫转债	858,494.78	0.19
29	113631	皖天转债	818,417.18	0.18
30	123122	富瀚转债	814,545.86	0.18
31	127078	优彩转债	802,347.90	0.18
32	113643	风语转债	788,386.35	0.18
33	118012	微芯转债	778,239.70	0.17
34	123243	严牌转债	777,007.81	0.17
35	113624	正川转债	775,058.90	0.17
36	127096	泰坦转债	763,566.04	0.17
37	123213	天源转债	759,158.02	0.17
38	127109	电化转债	758,660.82	0.17
39	123091	长海转债	750,360.04	0.17
40	123076	强力转债	717,732.88	0.16
41	118060	瑞可转债	713,235.48	0.16
42	127044	蒙娜转债	708,329.73	0.16
43	118053	正帆转债	703,565.24	0.16
44	113680	丽岛转债	689,131.29	0.15
45	123224	宇邦转债	683,720.93	0.15
46	123241	欧通转债	676,078.58	0.15
47	113605	大参转债	660,174.99	0.15
48	123245	集智转债	651,243.85	0.15
49	118016	京源转债	601,101.20	0.13
50	123178	花园转债	543,642.48	0.12
51	118031	天 23 转债	541,148.30	0.12
52	113042	上银转债	529,111.09	0.12
53	110077	洪城转债	527,927.47	0.12
54	113049	长汽转债	527,040.51	0.12
55	113627	太平转债	525,870.42	0.12
56	127049	希望转 2	525,600.53	0.12
57	123113	仙乐转债	524,134.40	0.12
58	113056	重银转债	519,448.33	0.12
59	123253	永贵转债	513,906.12	0.11
60	127040	国泰转债	512,044.52	0.11
61	111004	明新转债	507,155.88	0.11
62	127030	盛虹转债	506,969.23	0.11
63	111015	东亚转债	506,674.24	0.11
64	113647	禾丰转债	506,267.40	0.11

65	123119	康泰转 2	505,378.26	0.11
66	123107	温氏转债	504,040.13	0.11
67	123215	铭利转债	500,071.42	0.11
68	127105	龙星转债	497,153.72	0.11
69	113062	常银转债	493,265.32	0.11
70	127031	洋丰转债	493,004.76	0.11
71	111018	华康转债	492,189.14	0.11
72	113054	绿动转债	492,136.45	0.11
73	123104	卫宁转债	489,652.28	0.11
74	123117	健帆转债	489,374.75	0.11
75	110086	精工转债	488,504.12	0.11
76	113052	兴业转债	485,669.86	0.11
77	110095	双良转债	483,507.39	0.11
78	113636	甬金转债	481,311.56	0.11
79	110093	神马转债	480,580.83	0.11
80	118022	锂科转债	475,893.86	0.11
81	113665	汇通转债	475,208.05	0.11
82	123154	火星转债	474,524.12	0.11
83	123112	万讯转债	471,622.71	0.11
84	113650	博 22 转债	471,578.10	0.11
85	123187	超达转债	469,528.48	0.10
86	113625	江山转债	469,374.18	0.10
87	123151	康医转债	463,259.30	0.10
88	127083	山路转债	461,131.87	0.10
89	113655	欧 22 转债	460,369.03	0.10
90	113670	金 23 转债	458,233.45	0.10
91	127062	垒知转债	457,852.40	0.10
92	110097	天润转债	453,999.21	0.10
93	118024	冠宇转债	452,093.47	0.10
94	111009	盛泰转债	451,386.38	0.10
95	127095	广泰转债	449,148.42	0.10
96	127054	双箭转债	447,422.97	0.10
97	123133	佩蒂转债	446,975.41	0.10
98	127085	韵达转债	446,877.50	0.10
99	113656	嘉诚转债	446,200.23	0.10
100	127045	牧原转债	445,963.32	0.10
101	110085	通 22 转债	445,565.14	0.10
102	113682	益丰转债	444,393.97	0.10
103	123144	裕兴转债	443,171.56	0.10
104	113633	科沃转债	443,042.04	0.10
105	123192	科思转债	442,693.31	0.10
106	110087	天业转债	442,311.99	0.10

107	111020	合顺转债	440,320.80	0.10
108	118032	建龙转债	440,198.92	0.10
109	123155	中陆转债	435,846.77	0.10
110	123150	九强转债	435,483.39	0.10
111	113648	巨星转债	432,806.31	0.10
112	123165	回天转债	431,322.61	0.10
113	113659	莱克转债	430,444.55	0.10
114	127108	太能转债	429,915.84	0.10
115	123168	惠云转债	428,478.77	0.10
116	111014	李子转债	427,446.25	0.10
117	118042	奥维转债	426,798.75	0.10
118	113661	福 22 转债	426,654.05	0.10
119	113638	台 21 转债	425,654.67	0.09
120	113674	华设转债	425,618.07	0.09
121	113649	丰山转债	423,934.09	0.09
122	113698	凯众转债	423,660.84	0.09
123	123179	立高转债	419,293.38	0.09
124	127059	永东转 2	419,188.30	0.09
125	127060	湘佳转债	417,444.48	0.09
126	127110	广核转债	413,526.99	0.09
127	127069	小熊转债	413,474.64	0.09
128	113059	福莱转债	413,400.87	0.09
129	123172	漱玉转债	413,097.98	0.09
130	113678	中贝转债	412,419.38	0.09
131	113692	保隆转债	412,236.28	0.09
132	123193	海能转债	411,961.69	0.09
133	123194	百洋转债	411,598.06	0.09
134	113634	珀莱转债	409,318.71	0.09
135	111003	聚合转债	408,230.36	0.09
136	123214	东宝转债	406,705.42	0.09
137	127099	盛航转债	406,571.39	0.09
138	118044	赛特转债	405,373.70	0.09
139	113696	伯 25 转债	403,000.00	0.09
140	123235	亿田转债	402,535.65	0.09
141	118039	煜邦转债	402,533.99	0.09
142	127102	浙建转债	401,637.82	0.09
143	123109	昌红转债	400,779.13	0.09
144	113660	寿 22 转债	400,242.27	0.09
145	123092	天壕转债	399,816.23	0.09
146	113679	芯能转债	396,218.79	0.09
147	127050	麒麟转债	395,742.45	0.09
148	123114	三角转债	393,978.53	0.09

149	113652	伟 22 转债	392,202.42	0.09
150	127056	中特转债	392,113.70	0.09
151	127082	亚科转债	390,560.88	0.09
152	123196	正元转 02	388,922.19	0.09
153	127072	博实转债	388,818.80	0.09
154	113640	苏利转债	388,667.47	0.09
155	113070	渝水转债	387,499.23	0.09
156	111017	蓝天转债	386,441.62	0.09
157	110098	南药转债	381,956.34	0.09
158	127111	金威转债	381,365.08	0.09
159	113686	泰瑞转债	380,031.17	0.08
160	118005	天奈转债	377,945.21	0.08
161	123180	浙矿转债	377,514.48	0.08
162	113067	燃 23 转债	376,242.04	0.08
163	127068	顺博转债	376,143.68	0.08
164	113671	武进转债	375,870.82	0.08
165	113694	清源转债	373,666.61	0.08
166	113695	华辰转债	370,735.21	0.08
167	110090	爱迪转债	367,161.80	0.08
168	113053	隆 22 转债	363,226.67	0.08
169	113666	爱玛转债	363,219.17	0.08
170	123263	鼎捷转债	357,783.49	0.08
171	127098	欧晶转债	348,137.44	0.08
172	118037	上声转债	347,840.37	0.08
173	111021	奥锐转债	347,365.36	0.08
174	118051	皓元转债	324,784.33	0.07
175	127055	精装转债	279,090.76	0.06
176	123211	阳谷转债	273,553.31	0.06
177	123222	博俊转债	266,199.78	0.06
178	123160	泰福转债	265,367.65	0.06

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	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
报告期期初基金份额总额	244,400,034.36	1,029,691.18	148,702.75
报告期期间基金总申购份额	278,399,107.54	45,812.31	111,709,630.82
减:报告期期间基金总赎回份额	215,644,797.73	280,765.24	18,906.76
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	307,154,344.17	794,738.25	111,839,426.81

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

单位：份

项目	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	151,607.03	140,884.76
报告期期间买入/申购总份额	139,242.01	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	139,242.01	151,607.03	140,884.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.05	19.08	0.13

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2026-04-28	139,242.01	149,880.10	0.0008
合计			139,242.01	149,880.10	

注：本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用的费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

§ 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		比例达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2026 年 04 月 01 日至 2026 年 04 月 20 日	196,433,942.00	0.00	196,433,942.00	0.00	0.00%
	2	2026 年 04 月 21 日至 2026 年 04 月 21 日	0.00	27,875,662.11	18,583,774.74	9,291,887.37	2.21%
	3	2026 年 04 月 21 日至 2026 年 06 月 30 日	46,937,701.23	111,829,487.73	0.00	158,767,188.96	37.82%
	4	2026 年 04 月 22 日至 2026 年 06 月 30 日	0.00	185,717,336.80	0.00	185,717,336.80	44.24%
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