

中欧双利债券型证券投资基金 2026 年中期报告

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

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 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贵金属投资明细	50

7.9 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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧双利债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	4,268,361,332.01 份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张立学
	联系电话	021-68609600	010-68858126
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95580
传真		021-50190017	010-86353609
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、	北京市西城区金融大街 3 号 A 座

	10、16 层	
邮政编码	200120	100808
法定代表人	窦玉明	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C
本期已实现收益	218,726,105.39	10,881,607.32
本期利润	59,823,244.56	2,974,874.16
加权平均基金份 额本期利润	0.0106	0.0095
本期加权平均净 值利润率	0.87%	0.80%
本期基金份额净 值增长率	0.88%	0.69%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	536,416,457.14	22,400,959.50
期末可供分配基 金份额利润	0.1336	0.0883
期末基金资产净 值	4,906,824,928.98	298,412,804.14
期末基金份额净 值	1.2223	1.1756

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	49.87%	44.31%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧双利债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡闾洋	基金经理 / 基金经理助理	2021-07-30	—	10 年	历任中诚宝捷思货币经纪有限公司经纪人，上海光大证券资产管理有限公司交易员。2020-11-13 加入中欧基金管理有限公司。
黄华	多资产投资决策会主席 / 投资总监 / 基金	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。

	经理				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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中胡闽洋担任本基金的基金经理助理。

4.1.3 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	2018-04-16
	私募资产管理计划	2	1,147,968,097.75	2024-02-19
	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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 9 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金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偏高分位，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。

4.4.2 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 0.88%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%；基金 C 类份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧双利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧双利债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,203,385.02	12,592,536.44
结算备付金		22,119,615.00	12,844,701.11
存出保证金		948,181.71	356,699.79
交易性金融资产	6.4.7.2	6,540,199,291.95	7,647,929,036.39
其中：股票投资		945,566,310.84	1,110,230,017.05
基金投资		—	—
债券投资		5,594,632,981.11	6,537,699,019.34
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		10,602,338.72	—
应收股利		—	—
应收申购款		214,206.88	10,657,955.06
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		6,580,287,019.28	7,684,380,928.79
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,352,114,547.97	1,116,159,658.50
应付清算款		14,924,504.53	10,535,046.87
应付赎回款		883,980.26	5,918,269.56
应付管理人报酬		2,910,713.09	3,029,535.05
应付托管费		485,118.84	504,922.51
应付销售服务费		102,821.51	194,960.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		210,545.93	192,649.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,417,054.03	543,377.07
负债合计		1,375,049,286.16	1,137,078,419.97
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	4,268,361,332.01	5,421,681,894.48
未分配利润	6.4.7.8	936,876,401.11	1,125,620,614.34
净资产合计		5,205,237,733.12	6,547,302,508.82
负债和净资产总计		6,580,287,019.28	7,684,380,928.79

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,268,361,332.01 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.2223 元，基金份额总额 4,014,526,646.45 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.1756 元，基金份额总额 253,834,685.56 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧双利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,891,796.59	73,740,578.15
1. 利息收入		288,243.73	160,547.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	288,243.73	139,647.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-

买入返售金融资 产收入		-	20,899.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		265,759,388.29	92,720,002.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	112,406,645.69	-21,155,875.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	140,678,098.74	102,652,764.04
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	12,674,643.86	11,223,113.65
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-166,809,593.99	-19,219,165.84
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	653,758.56	79,194.12
减：二、营业总支出		37,093,677.87	23,980,606.29
1. 管理人报酬		21,684,278.15	12,034,677.86
2. 托管费		3,614,046.36	2,005,779.60
3. 销售服务费		744,307.15	1,133,861.18
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,777,841.88	8,607,366.66
其中：卖出回购金融资产 支出		10,777,841.88	8,607,366.66
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		160,384.78	85,286.54
8. 其他费用	6.4.7.18	112,819.55	113,634.45
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		62,798,118.72	49,759,971.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		62,798,118.72	49,759,971.86
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		62,798,118.72	49,759,971.86

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧双利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,421,681,894.48	-	1,125,620,614.34	6,547,302,508.82
二、本期期初净资产	5,421,681,894.48	-	1,125,620,614.34	6,547,302,508.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,153,320,562.47	-	-188,744,213.23	-1,342,064,775.70
(一)、综合收益总额	-	-	62,798,118.72	62,798,118.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,153,320,562.47	-	-251,542,331.95	-1,404,862,894.42
其中：1. 基金申购款	4,057,247,033.86	-	890,513,926.12	4,947,760,959.98
2. 基金赎回款	-5,210,567,596.33	-	-1,142,056,258.07	-6,352,623,854.40
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,268,361,332.01	-	936,876,401.11	5,205,237,733.12
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,542,505,290.	-	604,634,070.41	4,147,139,360.9

	52			3
二、本期期初净资产	3,542,505,290.52	-	604,634,070.41	4,147,139,360.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-761,207,328.16	-	-179,619,776.17	-940,827,104.33
(一)、综合收益总额	-	-	49,759,971.86	49,759,971.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-761,207,328.16	-	-131,636,182.35	-892,843,510.51
其中：1. 基金申购款	784,550,457.96	-	121,434,195.84	905,984,653.80
2. 基金赎回款	-1,545,757,786.12	-	-253,070,378.19	-1,798,828,164.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-97,743,565.68	-97,743,565.68
四、本期期末净资产	2,781,297,962.36	-	425,014,294.24	3,206,312,256.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1064 号文《关于准予中欧双利债券型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧双利债券型证

券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,025,874.56 元，经向中国证监会备案，《中欧双利债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,025,874.56 份基金份额，本基金募集期间未产生利息折份额，其中双利 A 的基金份额总额为 200,023,784.56 份，双利 C 的基金份额总额为 2,090.00 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优

惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,203,385.02
等于：本金	6,174,484.03
加：应计利息	28,900.99
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,203,385.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		986, 532, 814. 09	—	945, 566, 310. 84	−40, 966, 503. 25
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	696, 045, 677. 15	6, 403, 520. 47	706, 289, 120. 77	3, 839, 923. 15
	银行间市场	4, 808, 819, 855. 52	46, 525, 660. 34	4, 888, 343, 860. 34	32, 998, 344. 48
	合计	5, 504, 865, 532. 67	52, 929, 180. 81	5, 594, 632, 981. 11	36, 838, 267. 63
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		6, 491, 398, 346. 76	52, 929, 180. 81	6, 540, 199, 291. 95	−4, 128, 235. 62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,322,830.71
其中：交易所市场	3,183,658.37
银行间市场	139,172.34
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	34,712.18
应付补差费	3.77
合计	3,417,054.03

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧双利债券 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,926,667,004.95	4,926,667,004.95
本期申购	3,943,764,444.87	3,943,764,444.87
本期赎回（以“-”号填列）	-4,855,904,803.37	-4,855,904,803.37
本期末	4,014,526,646.45	4,014,526,646.45

中欧双利债券 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	495,014,889.53	495,014,889.53
本期申购	113,482,588.99	113,482,588.99
本期赎回（以“-”号填列）	-354,662,792.96	-354,662,792.96
本期末	253,834,685.56	253,834,685.56

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧双利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	465,913,043.45	576,756,757.94	1,042,669,801.39
本期期初	465,913,043.45	576,756,757.94	1,042,669,801.39
本期利润	218,726,105.39	-158,902,860.83	59,823,244.56
本期基金份额交易产生的变动数	-148,222,691.70	-61,972,071.72	-210,194,763.42
其中：基金申购款	412,241,067.59	458,221,807.98	870,462,875.57
基金赎回款	-560,463,759.29	-520,193,879.70	-1,080,657,638.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	536,416,457.14	355,881,825.39	892,298,282.53

中欧双利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,226,712.97	56,724,099.98	82,950,812.95
本期期初	26,226,712.97	56,724,099.98	82,950,812.95
本期利润	10,881,607.32	-7,906,733.16	2,974,874.16
本期基金份额交易产生的变动数	-14,707,360.79	-26,640,207.74	-41,347,568.53
其中：基金申购款	6,838,854.67	13,212,195.88	20,051,050.55
基金赎回款	-21,546,215.46	-39,852,403.62	-61,398,619.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,400,959.50	22,177,159.08	44,578,118.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	214,818.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,807.96
其他	42,617.39
合计	288,243.73

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,141,639,752.72
减：卖出股票成本总额	4,023,069,353.88
减：交易费用	6,163,753.15
买卖股票差价收入	112,406,645.69

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	77,219,580.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,458,518.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	140,678,098.74
----	----------------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,695,666,157.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,557,448,960.67
减：应计利息总额	74,494,198.62
减：交易费用	264,480.11
买卖债券差价收入	63,458,518.09

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,674,643.86
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	12,674,643.86

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	-166,809,593.99
股票投资	-185,538,519.46
债券投资	18,728,925.47
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—

其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-166,809,593.99

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	574,365.93
基金转换费收入	79,392.63
合计	653,758.56

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	112,819.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国都证券	60,324,901.20	0.74	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
国都证券	233,624,649.82	4.47	10,244,445.48	0.64

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国都证券	26,295.39	0.74	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期	占当期佣金总量	期末应付佣金余	占期末应付佣金

	佣金	的比例（%）	额	总额的比例（%）
国都证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,684,278.15	12,034,677.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,558,529.48	1,221,593.11
应支付基金管理人的净管理费	18,125,748.67	10,813,084.75

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,614,046.36	2,005,779.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C	合计
国都证券	0.00	305.23	305.23
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	20,539.62	20,539.62
中欧财富	0.00	2,753.52	2,753.52
中欧基金	0.00	101,469.30	101,469.30
合计	0.00	125,067.67	125,067.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧双利债券 A	中欧双利债券 C	合计
国都证券	0.00	308.01	308.01
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	30,119.97	30,119.97
中欧财富	0.00	2,741.31	2,741.31
中欧基金	0.00	640,167.51	640,167.51
合计	0.00	673,336.80	673,336.80

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧双利债券 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	168,493.02	0.00%	5,267.69	0.00%

份额单位：份

中欧双利债券 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	55.47	0.00%	55.47	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	6,203,385.02	214,818.38	9,489,726.73	66,053.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	4,198	3,411,065.68	3,692,266.94	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,260,114,547.97 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102200224	22 华润控股 MTN003B	2026 年 7 月 1 日	104.66	253,000	26,479,125.56
102501693	25 临港经济 MTN002	2026 年 7 月 1 日	102.09	112,000	11,434,104.55
102584808	25 鲁高速 MTN010A	2026 年 7 月 1 日	101.88	500,000	50,941,410.96
102601813	26 广州高新 MTN001	2026 年 7 月 1 日	101.23	500,000	50,616,082.19
230210	23 国开 10	2026 年 7 月 1 日	107.87	463,000	49,943,366.03
240202	24 国开 02	2026 年 7 月 1 日	101.66	800,000	81,331,791.78
240210	24 国开 10	2026 年 7 月 1 日	105.02	700,000	73,514,383.56
240215	24 国开 15	2026 年 7 月 1 日	106.10	800,000	84,878,838.36
250205	25 国开 05	2026 年 7 月 1 日	99.32	500,000	49,659,972.60

250211	25 国开 11	2026 年 7 月 1 日	101.29	800,000	81,029,260.27
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.27	500,000	50,634,547.95
260203	26 国开 03	2026 年 7 月 1 日	101.23	1,000,000	101,228,575.34
260205	26 国开 05	2026 年 7 月 1 日	101.86	2,000,000	203,710,904.11
260301	26 进出 01	2026 年 7 月 1 日	100.53	600,000	60,315,978.08
272380008	23 人保集团资本补充债 01	2026 年 7 月 1 日	103.36	400,000	41,342,993.97
272380015	23 新华人寿资本补充债 01	2026 年 7 月 1 日	106.18	400,000	42,470,454.79
102580330	25 石交投集 MTN001A	2026 年 7 月 3 日	101.45	400,000	40,581,315.07
102582899	25 华能 MTN012	2026 年 7 月 3 日	102.11	500,000	51,054,246.58
102584428	25 湘高速 MTN021	2026 年 7 月 3 日	102.25	300,000	30,674,033.42
102584709	25 湘高速 MTN022	2026 年 7 月 3 日	102.09	300,000	30,626,224.11
102601834	26 诸暨国资 MTN001	2026 年 7 月 3 日	101.36	206,000	20,880,984.00
102680059	26 龙城发展 MTN001	2026 年 7 月 3 日	101.66	400,000	40,665,095.89
102580144	25 朝阳国资 MTN001	2026 年 7 月 6 日	101.82	532,000	54,168,347.86
合计				12,966,000	1,328,182,037.03

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 92,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	171,602,120.54	218,122,216.99
合计	171,602,120.54	218,122,216.99

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以下未有三方评级的一般短期融资券、政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	2,192,021,791.42	2,924,393,716.68
AAA 以下	353,056,310.82	379,743,365.25
未评级	2,877,952,758.33	3,015,439,720.42
合计	5,423,030,860.57	6,319,576,802.35

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的一般公司债、一般中期票据、政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	6,203,385.02	-	-	-	6,203,385.02
结算备付金	22,119,615.00	-	-	-	22,119,615.00
存出保证金	948,181.71	-	-	-	948,181.71
交易性金融资产	416,418,729.85	4,645,044,730.76	533,169,520.50	945,566,310.84	6,540,199,291.95
应收申购款	-	-	-	214,206.88	214,206.88
应收清算款	-	-	-	10,602,338.72	10,602,338.72
资产总计	445,689,911.58	4,645,044,730.76	533,169,520.50	956,382,856.44	6,580,287,019.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	883,980.26	883,980.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,910,713.09	2,910,713.09
应付托管费	-	-	-	485,118.84	485,118.84
应付清算款	-	-	-	14,924,504.53	14,924,504.53
卖出回购金融资产款	1,352,114,547.97	-	-	-	1,352,114,547.97
应付销售服务费	-	-	-	102,821.51	102,821.51
应交税费	-	-	-	210,545.93	210,545.93
其他负债	-	-	-	3,417,054.03	3,417,054.03
负债总计	1,352,114,547.97	-	-	22,934,738.19	1,375,049,286.16
利率敏感度缺口	-906,424,636.39	4,645,044,730.76	533,169,520.50	933,448,118.25	5,205,237,733.12
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,592,536.44	-	-	-	12,592,536.44
结算备付金	12,844,701.11	-	-	-	12,844,701.11
存出保证金	356,699.79	-	-	-	356,699.79
交易性金融资产	881,357,314.79	5,306,345,547.20	349,996,157.35	1,110,230,017.05	7,647,929,036.39
应收申购款	-	-	-	10,657,955.06	10,657,955.06
资产总计	907,151,252.13	5,306,345,547.20	349,996,157.35	1,120,887,972.11	7,684,380,928.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,918,269.56	5,918,269.56
应付管理人报酬	-	-	-	3,029,535.05	3,029,535.05
应付托管费	-	-	-	504,922.51	504,922.51
应付清算款	-	-	-	10,535,046.87	10,535,046.87
卖出回购金融资产款	1,116,159,658.50	-	-	-	1,116,159,658.50
应付销售服务费	-	-	-	194,960.59	194,960.59
应交税费	-	-	-	192,649.82	192,649.82
其他负债	-	-	-	543,377.07	543,377.07
负债总计	1,116,159,658.50	-	-	20,918,761.47	1,137,078,419.97
利率敏感度缺口	-209,008,406.37	5,306,345,547.20	349,996,157.35	1,099,969,210.64	6,547,302,508.82

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	利率上升 25BP	-37,847,816.41	-38,357,331.12
	利率下降 25BP	38,334,963.41	38,775,037.76

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	945,566,310.84	18.17	1,110,230,017.05	16.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—

其他	-	-	-	-
合计	945,566,310.84	18.17	1,110,230,017.05	16.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 18.17%（2025 年 12 月 31 日：16.96%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,225,333,629.06	1,372,072,111.85
第二层次	5,314,865,662.89	6,275,856,924.54
第三层次	-	-
合计	6,540,199,291.95	7,647,929,036.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	11,764,727.31	0.18
9	合计	6,580,287,019.28	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

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	19,322,850.00	0.37

	应业		
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

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	002648	卫星化学	351, 900	8, 266, 131. 00	0. 16
12	600150	中国船舶	242, 500	8, 194, 075. 00	0. 16
13	688256	寒武纪	4, 942	7, 885, 208. 10	0. 15
14	000709	河钢股份	3, 881, 500	7, 530, 110. 00	0. 14
15	600037	歌华有线	1, 193, 200	7, 481, 364. 00	0. 14
16	601998	中信银行	1, 073, 900	7, 442, 127. 00	0. 14
17	600874	创业环保	1, 361, 100	7, 295, 496. 00	0. 14
18	000810	创维数字	547, 300	7, 251, 725. 00	0. 14

19	000589	贵州轮胎	1,761,800	7,152,908.00	0.14
20	600030	中信证券	240,700	6,915,311.00	0.13
21	301358	湖南裕能	87,800	6,661,386.00	0.13
22	688498	源杰科技	3,450	6,506,700.00	0.13
23	688059	华锐精密	32,487	6,487,978.77	0.12
24	002466	天齐锂业	105,200	6,450,864.00	0.12
25	601899	紫金矿业	253,600	6,375,504.00	0.12
26	600887	伊利股份	259,800	6,224,808.00	0.12
27	000683	博源化工	1,049,900	6,047,424.00	0.12
28	603317	天味食品	457,600	5,953,376.00	0.11
29	603288	海天味业	178,100	5,905,796.00	0.11
30	600971	恒源煤电	848,800	5,856,720.00	0.11
31	601500	通用股份	1,604,200	5,855,330.00	0.11
32	603799	华友钴业	121,200	5,849,112.00	0.11
33	601163	三角轮胎	453,800	5,758,722.00	0.11
34	601229	上海银行	629,700	5,465,796.00	0.11
35	002142	宁波银行	177,900	5,281,851.00	0.10
36	601069	西部黄金	233,300	5,132,600.00	0.10
37	600741	华域汽车	326,400	5,065,728.00	0.10
38	002027	分众传媒	1,045,300	5,059,252.00	0.10
39	600329	达仁堂	132,500	4,931,650.00	0.09
40	600398	海澜之家	937,300	4,902,079.00	0.09
41	603195	公牛集团	122,500	4,795,875.00	0.09
42	000415	渤海租赁	1,166,800	4,748,876.00	0.09
43	603507	振江股份	144,295	4,745,862.55	0.09
44	000049	德赛电池	201,100	4,699,707.00	0.09
45	300681	英搏尔	163,600	4,682,232.00	0.09
46	688041	海光信息	12,613	4,670,593.90	0.09
47	000977	浪潮信息	66,700	4,669,000.00	0.09
48	002384	东山精密	17,700	4,643,595.00	0.09
49	603256	宏和科技	17,500	4,643,275.00	0.09
50	300476	胜宏科技	13,400	4,642,162.00	0.09
51	301216	万凯新材	201,900	4,641,681.00	0.09
52	601233	桐昆股份	213,700	4,626,605.00	0.09
53	600519	贵州茅台	3,900	4,623,411.00	0.09
54	600941	中国移动	53,200	4,582,116.00	0.09
55	603816	顾家家居	203,300	4,545,788.00	0.09
56	605117	德业股份	42,500	4,512,650.00	0.09
57	600566	济川药业	202,200	4,486,818.00	0.09
58	601319	中国人保	660,800	4,467,008.00	0.09
59	301031	中熔电气	37,100	4,431,595.00	0.09
60	002152	广电运通	470,900	4,417,042.00	0.08
61	002079	苏州固锝	293,500	4,411,305.00	0.08

62	002376	新北洋	766,000	4,404,500.00	0.08
63	002111	威海广泰	485,500	4,369,500.00	0.08
64	601997	贵阳银行	851,000	4,365,630.00	0.08
65	000708	中信特钢	342,300	4,319,826.00	0.08
66	300769	德方纳米	64,900	4,315,850.00	0.08
67	601000	唐山港	1,029,200	4,271,180.00	0.08
68	601577	长沙银行	486,300	4,235,673.00	0.08
69	600717	天津港	1,086,100	4,224,929.00	0.08
70	600598	北大荒	388,800	4,214,592.00	0.08
71	000544	中原环保	602,200	4,197,334.00	0.08
72	603508	思维列控	195,900	4,184,424.00	0.08
73	301109	军信股份	335,700	4,182,822.00	0.08
74	600901	江苏金租	720,800	4,144,600.00	0.08
75	002867	周大生	368,200	4,105,430.00	0.08
76	300972	万辰集团	23,500	4,075,135.00	0.08
77	000807	云铝股份	183,200	4,056,048.00	0.08
78	301371	敷尔佳	154,200	4,009,200.00	0.08
79	688700	东威科技	44,674	3,993,855.60	0.08
80	600288	大恒科技	298,000	3,963,400.00	0.08
81	000552	甘肃能化	1,762,000	3,946,880.00	0.08
82	002956	西麦食品	187,840	3,899,558.40	0.07
83	000568	泸州老窖	50,200	3,891,504.00	0.07
84	000581	威孚高科	226,700	3,858,434.00	0.07
85	002563	森马服饰	764,500	3,853,080.00	0.07
86	002557	洽洽食品	212,800	3,821,888.00	0.07
87	002233	塔牌集团	547,700	3,817,469.00	0.07
88	000949	新乡化纤	595,700	3,776,738.00	0.07
89	601816	京沪高铁	832,900	3,773,037.00	0.07
90	300438	鹏辉能源	45,400	3,761,390.00	0.07
91	600395	盘江股份	822,500	3,750,600.00	0.07
92	000783	长江证券	380,300	3,707,925.00	0.07
93	001339	智微智能	36,100	3,692,308.00	0.07
94	688072	拓荆科技	4,198	3,692,266.94	0.07
95	600210	紫江企业	587,600	3,643,120.00	0.07
96	600020	中原高速	985,300	3,635,757.00	0.07
97	600285	羚锐制药	187,300	3,629,874.00	0.07
98	002838	道恩股份	117,500	3,597,850.00	0.07
99	002948	青岛银行	701,300	3,562,604.00	0.07
100	000893	亚钾国际	87,100	3,561,519.00	0.07
101	600309	万华化学	51,800	3,543,638.00	0.07
102	688308	欧科亿	19,377	3,522,932.37	0.07
103	000989	九芝堂	451,400	3,507,378.00	0.07
104	002916	深南电路	7,500	3,434,250.00	0.07

105	600428	中远海特	436,800	3,411,408.00	0.07
106	688012	中微公司	7,122	3,336,657.00	0.06
107	300047	天源迪科	373,900	3,320,232.00	0.06
108	688521	芯原股份	8,939	3,317,620.46	0.06
109	301260	格力博	241,700	3,265,367.00	0.06
110	000848	承德露露	440,600	3,260,440.00	0.06
111	688536	思瑞浦	8,955	3,260,425.95	0.06
112	300432	富临精工	161,900	3,252,571.00	0.06
113	002839	张家港行	832,440	3,246,516.00	0.06
114	300016	北陆药业	419,100	3,214,497.00	0.06
115	603993	洛阳钼业	182,000	3,194,100.00	0.06
116	002772	众兴菌业	275,600	3,130,816.00	0.06
117	601339	百隆东方	458,800	3,106,076.00	0.06
118	000885	城发环境	253,800	3,053,214.00	0.06
119	002154	报喜鸟	856,800	3,050,208.00	0.06
120	601360	三六零	346,700	3,012,823.00	0.06
121	000301	东方盛虹	261,000	2,988,450.00	0.06
122	002458	益生股份	382,400	2,971,248.00	0.06
123	600233	圆通速递	186,200	2,932,650.00	0.06
124	600499	科达制造	210,100	2,899,380.00	0.06
125	300073	当升科技	60,200	2,892,008.00	0.06
126	002746	仙坛股份	566,500	2,889,150.00	0.06
127	002738	中矿资源	48,400	2,855,116.00	0.05
128	000426	兴业银锡	85,500	2,818,080.00	0.05
129	002293	罗莱生活	282,400	2,792,936.00	0.05
130	601601	中国太保	97,700	2,786,404.00	0.05
131	688275	万润新能	21,748	2,773,957.40	0.05
132	000828	东莞控股	294,700	2,758,392.00	0.05
133	002216	三全食品	234,700	2,706,091.00	0.05
134	688503	聚和材料	20,326	2,697,260.20	0.05
135	600801	华新建材	172,900	2,697,240.00	0.05
136	601138	工业富联	37,300	2,691,195.00	0.05
137	300773	拉卡拉	174,500	2,669,850.00	0.05
138	600908	无锡银行	524,100	2,662,428.00	0.05
139	002487	大金重工	45,900	2,660,823.00	0.05
140	000900	现代投资	768,500	2,659,010.00	0.05
141	603901	永创智能	242,100	2,631,627.00	0.05
142	600183	生益科技	15,100	2,618,340.00	0.05
143	600081	东风科技	283,600	2,575,088.00	0.05
144	300054	鼎龙股份	24,300	2,575,071.00	0.05
145	300962	中金辐照	202,300	2,528,750.00	0.05
146	002415	海康威视	73,700	2,520,540.00	0.05
147	002166	莱茵生物	401,200	2,519,536.00	0.05

148	603213	镇洋发展	181,500	2,510,145.00	0.05
149	600595	中孚实业	446,200	2,507,644.00	0.05
150	688533	上声电子	119,856	2,500,196.16	0.05
151	600585	海螺水泥	147,200	2,495,040.00	0.05
152	600966	博汇纸业	518,600	2,478,908.00	0.05
153	600685	中船防务	96,700	2,460,048.00	0.05
154	001203	大中矿业	82,100	2,458,895.00	0.05
155	301377	鼎泰高科	4,400	2,423,960.00	0.05
156	603118	共进股份	200,100	2,423,211.00	0.05
157	000657	中钨高新	25,100	2,402,572.00	0.05
158	002532	天山铝业	222,700	2,389,571.00	0.05
159	000338	潍柴动力	87,600	2,387,100.00	0.05
160	002756	永兴材料	41,700	2,361,888.00	0.05
161	000975	山金国际	138,300	2,351,100.00	0.05
162	301606	绿联科技	38,300	2,337,066.00	0.04
163	603588	高能环境	120,200	2,307,840.00	0.04
164	002371	北方华创	2,600	2,299,856.00	0.04
165	601828	美凯龙	1,125,800	2,296,632.00	0.04
166	002354	天娱数科	244,000	2,269,200.00	0.04
167	301206	三元生物	101,600	2,258,568.00	0.04
168	601318	中国平安	46,900	2,239,006.00	0.04
169	300590	移为通信	155,700	2,234,295.00	0.04
170	600938	中国海油	81,900	2,223,585.00	0.04
171	603049	中策橡胶	47,900	2,146,399.00	0.04
172	000933	神火股份	101,100	2,143,320.00	0.04
173	002439	启明星辰	169,100	2,139,115.00	0.04
174	603259	药明康德	17,100	2,129,121.00	0.04
175	688208	道通科技	84,348	2,124,726.12	0.04
176	002250	联化科技	152,800	2,088,776.00	0.04
177	603025	大豪科技	150,800	2,056,912.00	0.04
178	600884	杉杉股份	151,100	2,047,405.00	0.04
179	000519	中兵红箭	97,100	2,045,897.00	0.04
180	000089	深圳机场	337,900	2,037,537.00	0.04
181	600101	明星电力	258,000	2,035,620.00	0.04
182	001298	好上好	97,000	2,012,750.00	0.04
183	601200	上海环境	300,800	1,985,280.00	0.04
184	601208	东材科技	28,000	1,982,120.00	0.04
185	002812	恩捷股份	29,600	1,980,536.00	0.04
186	688368	晶丰明源	9,123	1,975,311.96	0.04
187	600919	江苏银行	180,700	1,947,946.00	0.04
188	601218	吉鑫科技	450,700	1,938,010.00	0.04
189	002497	雅化集团	95,100	1,937,187.00	0.04
190	301439	泓淋电力	123,100	1,935,132.00	0.04

191	001314	亿道信息	30,400	1,878,720.00	0.04
192	688981	中芯国际	11,728	1,862,640.96	0.04
193	002714	牧原股份	53,200	1,861,468.00	0.04
194	600508	上海能源	251,200	1,851,344.00	0.04
195	600596	新安股份	115,600	1,844,976.00	0.04
196	001389	广合科技	7,700	1,826,825.00	0.04
197	301311	昆船智能	139,600	1,813,404.00	0.03
198	300563	神宇股份	63,300	1,797,087.00	0.03
199	601166	兴业银行	107,100	1,773,576.00	0.03
200	600827	百联股份	239,300	1,773,213.00	0.03
201	601778	晶科科技	411,200	1,768,160.00	0.03
202	600546	山煤国际	158,500	1,732,405.00	0.03
203	300307	慈星股份	232,800	1,715,736.00	0.03
204	603587	地素时尚	153,600	1,706,496.00	0.03
205	601009	南京银行	172,000	1,701,080.00	0.03
206	601963	重庆银行	167,500	1,688,400.00	0.03
207	002204	大连重工	317,700	1,677,456.00	0.03
208	002132	恒星科技	304,700	1,648,427.00	0.03
209	600955	维远股份	109,700	1,614,784.00	0.03
210	600007	中国国贸	84,200	1,598,116.00	0.03
211	002163	海南发展	191,000	1,592,940.00	0.03
212	600714	金瑞矿业	77,500	1,591,075.00	0.03
213	002406	远东传动	239,000	1,567,840.00	0.03
214	600489	中金黄金	85,500	1,543,275.00	0.03
215	002602	世纪华通	108,100	1,524,210.00	0.03
216	002690	美亚光电	104,400	1,496,052.00	0.03
217	000719	中原传媒	130,600	1,492,758.00	0.03
218	600704	物产中大	307,000	1,449,040.00	0.03
219	688099	晶晨股份	14,061	1,446,876.90	0.03
220	688639	华恒生物	89,599	1,446,127.86	0.03
221	002475	立讯精密	20,500	1,443,200.00	0.03
222	600869	远东股份	42,800	1,432,516.00	0.03
223	002067	景兴纸业	389,000	1,431,520.00	0.03
224	000059	华锦股份	381,700	1,431,375.00	0.03
225	300953	震裕科技	10,700	1,430,590.00	0.03
226	300291	百纳千成	284,500	1,374,135.00	0.03
227	603071	物产环能	124,100	1,372,546.00	0.03
228	300219	鸿利智汇	128,300	1,338,169.00	0.03
229	603515	欧普照明	80,800	1,320,272.00	0.03
230	301339	通行宝	127,700	1,306,371.00	0.03
231	600461	洪城环境	143,100	1,296,486.00	0.02
232	300443	金雷股份	60,000	1,294,800.00	0.02
233	001286	陕西能源	127,300	1,290,822.00	0.02

234	601033	永兴股份	95,700	1,282,380.00	0.02
235	600523	贵航股份	119,400	1,259,670.00	0.02
236	601665	齐鲁银行	218,000	1,257,860.00	0.02
237	600203	福日电子	100,300	1,218,645.00	0.02
238	002737	葵花药业	108,700	1,218,527.00	0.02
239	002266	浙富控股	240,700	1,217,942.00	0.02
240	600031	三一重工	68,300	1,180,224.00	0.02
241	300592	华凯易佰	65,500	1,159,350.00	0.02
242	300512	中亚股份	168,500	1,149,170.00	0.02
243	000567	海德股份	190,800	1,139,076.00	0.02
244	603124	江南新材	5,800	1,084,484.00	0.02
245	603156	养元饮品	22,100	1,084,447.00	0.02
246	603233	大参林	71,800	1,079,154.00	0.02
247	688775	影石创新	7,643	1,059,701.95	0.02
248	000612	焦作万方	100,000	1,059,000.00	0.02
249	600893	航发动力	27,600	1,058,184.00	0.02
250	002281	光迅科技	4,100	1,053,454.00	0.02
251	000045	深纺织 A	98,800	1,041,352.00	0.02
252	688105	诺唯赞	58,855	1,021,134.25	0.02
253	300475	香农芯创	3,400	1,020,000.00	0.02
254	601688	华泰证券	48,900	1,008,318.00	0.02
255	002274	华昌化工	217,000	1,004,710.00	0.02
256	688151	华强科技	67,468	1,003,249.16	0.02
257	002876	三利谱	28,300	996,443.00	0.02
258	600372	中航机载	90,400	980,840.00	0.02
259	605222	起帆电缆	41,800	974,776.00	0.02
260	002008	大族激光	6,300	945,693.00	0.02
261	603305	旭升集团	76,900	932,028.00	0.02
262	600487	亨通光电	8,500	929,390.00	0.02
263	603068	博通集成	23,000	925,290.00	0.02
264	002938	鹏鼎控股	8,600	906,268.00	0.02
265	605577	龙版传媒	102,500	903,025.00	0.02
266	688390	固德威	8,318	902,586.18	0.02
267	000957	中通客车	94,800	887,328.00	0.02
268	601328	交通银行	137,900	886,697.00	0.02
269	601898	中煤能源	71,700	873,306.00	0.02
270	688008	XD 澜起科	2,788	864,001.20	0.02
271	601699	潞安环能	59,200	845,376.00	0.02
272	002686	亿利达	163,500	842,025.00	0.02
273	002745	木林森	66,500	834,575.00	0.02
274	300857	协创数据	2,400	815,760.00	0.02
275	000001	平安银行	77,900	782,895.00	0.02
276	600346	恒力石化	44,200	782,782.00	0.02

277	601336	新华保险	13,100	781,546.00	0.02
278	603111	康尼机电	134,900	763,534.00	0.01
279	603511	爱慕股份	63,600	731,400.00	0.01
280	002041	登海种业	92,400	727,188.00	0.01
281	688668	鼎通科技	1,947	726,815.10	0.01
282	600808	马钢股份	282,300	705,750.00	0.01
283	601789	宁波建工	171,800	688,918.00	0.01
284	600025	华能水电	77,100	685,419.00	0.01
285	000425	徐工机械	84,500	683,605.00	0.01
286	603108	润达医疗	73,200	651,480.00	0.01
287	002460	赣锋锂业	9,900	647,460.00	0.01
288	600528	中铁工业	95,500	629,345.00	0.01
289	000737	北方铜业	46,400	613,408.00	0.01
290	601288	农业银行	100,800	611,856.00	0.01
291	300213	佳讯飞鸿	96,300	583,578.00	0.01
292	000561	烽火电子	77,900	576,460.00	0.01
293	600880	博瑞传播	154,100	570,170.00	0.01
294	603979	金诚信	9,600	566,688.00	0.01
295	600522	中天科技	9,200	558,256.00	0.01
296	605007	五洲特纸	41,000	548,990.00	0.01
297	605016	百龙创园	21,200	548,020.00	0.01
298	603026	石大胜华	6,100	545,157.00	0.01
299	002545	东方铁塔	33,400	541,748.00	0.01
300	000617	中油资本	81,400	536,426.00	0.01
301	603013	亚普股份	33,800	533,702.00	0.01
302	603906	龙蟠科技	19,700	522,641.00	0.01
303	688696	极米科技	7,987	515,480.98	0.01
304	000858	五粮液	6,900	510,600.00	0.01
305	601995	中金公司	14,000	506,100.00	0.01
306	600293	三峡新材	166,600	476,476.00	0.01
307	301500	飞南资源	18,200	474,110.00	0.01
308	000333	美的集团	6,100	460,733.00	0.01
309	000852	石化机械	90,600	449,376.00	0.01
310	601111	中国国航	73,500	444,675.00	0.01
311	600168	武汉控股	106,900	431,876.00	0.01
312	603985	恒润股份	16,900	405,938.00	0.01
313	300666	江丰电子	1,100	405,460.00	0.01
314	688222	成都先导	12,463	400,186.93	0.01
315	301246	宏源药业	14,600	392,740.00	0.01
316	688388	嘉元科技	8,890	391,160.00	0.01
317	603345	安井食品	4,800	384,912.00	0.01
318	601566	九牧王	46,400	377,232.00	0.01
319	600029	南方航空	72,600	376,068.00	0.01

320	601857	中国石油	39,400	341,992.00	0.01
321	688221	前沿生物	14,695	329,168.00	0.01
322	300737	科顺股份	50,000	328,500.00	0.01
323	600230	沧州大化	24,900	324,198.00	0.01
324	600433	冠豪高新	96,000	308,160.00	0.01
325	301048	金鹰重工	35,300	303,933.00	0.01
326	601518	吉林高速	108,100	302,680.00	0.01
327	600558	大西洋	59,000	291,460.00	0.01
328	600115	中国东航	72,300	275,463.00	0.01
329	688317	之江生物	16,809	255,496.80	0.00
330	688231	隆达股份	6,713	246,568.49	0.00
331	600967	内蒙一机	21,700	235,445.00	0.00
332	002353	杰瑞股份	1,500	228,750.00	0.00
333	600797	浙大网新	33,600	215,040.00	0.00
334	301026	浩通科技	10,500	212,310.00	0.00
335	600132	重庆啤酒	4,900	202,370.00	0.00
336	300122	智飞生物	16,900	197,561.00	0.00
337	300184	力源信息	11,200	196,560.00	0.00
338	601668	中国建筑	41,400	179,676.00	0.00
339	002780	三夫户外	14,200	172,388.00	0.00
340	002389	航天彩虹	9,100	161,707.00	0.00
341	300879	大叶股份	10,300	161,504.00	0.00
342	603887	城地香江	17,200	160,648.00	0.00
343	000729	燕京啤酒	15,600	158,028.00	0.00
344	000651	格力电器	4,100	153,750.00	0.00
345	600036	招商银行	4,100	145,550.00	0.00
346	600276	恒瑞医药	2,500	130,100.00	0.00
347	688269	凯立新材	3,639	115,392.69	0.00
348	000869	张裕 A	7,200	112,176.00	0.00
349	603053	成都燃气	13,400	112,024.00	0.00
350	002429	兆驰股份	10,300	107,017.00	0.00
351	600905	三峡能源	28,800	106,848.00	0.00
352	001323	慕思股份	5,300	83,740.00	0.00
353	000421	南京公用	12,400	61,504.00	0.00
354	603486	科沃斯	1,200	60,900.00	0.00
355	300982	苏文电能	3,800	57,418.00	0.00
356	601600	中国铝业	6,200	50,964.00	0.00
357	688084	晶品特装	990	49,777.20	0.00
358	688213	思特威	440	47,110.80	0.00
359	600886	国投电力	3,100	41,261.00	0.00
360	601225	陕西煤业	1,900	38,665.00	0.00
361	002065	东华软件	4,900	34,986.00	0.00
362	688489	三未信安	938	21,292.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	101,767,829.40	1.55
2	300750	宁德时代	66,317,207.37	1.01
3	603986	兆易创新	46,647,249.00	0.71
4	600938	中国海油	45,809,853.00	0.70
5	601899	紫金矿业	45,096,559.00	0.69
6	601318	中国平安	43,514,118.00	0.66
7	002142	宁波银行	39,022,814.82	0.60
8	300502	新易盛	34,522,277.60	0.53
9	000157	中联重科	33,117,000.00	0.51
10	688256	寒武纪	31,664,634.25	0.48
11	600585	海螺水泥	31,240,348.00	0.48
12	600346	恒力石化	29,814,599.56	0.46
13	002493	荣盛石化	29,704,549.00	0.45
14	002415	海康威视	27,221,745.00	0.42
15	000567	海德股份	26,699,670.00	0.41
16	000425	徐工机械	25,229,992.00	0.39
17	002027	分众传媒	25,058,712.00	0.38
18	300476	胜宏科技	25,025,630.00	0.38
19	000725	京东方 A	24,761,781.00	0.38
20	688002	睿创微纳	24,191,598.89	0.37

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	255,911,357.70	3.91
2	601899	紫金矿业	134,987,184.66	2.06
3	601318	中国平安	129,126,236.94	1.97
4	600938	中国海油	104,558,648.58	1.60
5	300308	中际旭创	86,744,826.00	1.32
6	300274	阳光电源	78,934,931.00	1.21
7	601398	工商银行	57,761,186.55	0.88
8	601939	建设银行	52,303,965.20	0.80
9	600019	宝钢股份	50,011,963.59	0.76
10	000333	美的集团	48,380,295.76	0.74
11	000830	鲁西化工	47,630,908.00	0.73
12	603986	兆易创新	44,046,907.00	0.67
13	600519	贵州茅台	43,836,836.66	0.67
14	000807	云铝股份	42,786,832.62	0.65

15	000425	徐工机械	40,443,245.64	0.62
16	601088	中国神华	35,253,338.32	0.54
17	002142	宁波银行	33,639,688.56	0.51
18	002714	牧原股份	32,682,123.69	0.50
19	600660	福耀玻璃	31,892,993.81	0.49
20	600031	三一重工	31,251,404.00	0.48

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,043,944,167.13
卖出股票收入（成交）总额	4,141,639,752.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	948,181.71
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,764,727.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧双利债券 A	10,464	383,651.25	3,915,803,325.27	97.54%	98,723,321.18	2.46%
中欧双利债券 C	37,298	6,805.58	70,731,683.56	27.87%	183,103,002.00	72.13%
合计	47,762	89,367.31	3,986,535,008.83	93.40%	281,826,323.18	6.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧双利债券 A	186,889.06	0.00%
	中欧双利债券 C	591.62	0.00%
	合计	187,480.68	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧双利债券 A	0~10
	中欧双利债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧双利债券 A	0
	中欧双利债券 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 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
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	200,023,784.56	2,090.00

本报告期期初基金份额总额	4,926,667,004.95	495,014,889.53
本报告期基金总申购份额	3,943,764,444.87	113,482,588.99
减：本报告期基金总赎回份额	4,855,904,803.37	354,662,792.96
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	1	2,325,725.958.08	28.41	1,013,780.54	28.41	—
民生证券	1	1,876,032.100.82	22.92	817,773.15	22.92	—
国金证券	1	1,821,500.698.25	22.25	793,997.05	22.25	—
东方证券	1	946,007,064.24	11.56	412,371.24	11.56	—
招商证券	1	758,610,469.43	9.27	330,667.66	9.27	—
国泰海通	3	278,718,792.37	3.40	121,488.40	3.40	—
中金公司	1	118,663,935.46	1.45	51,725.49	1.45	—
国都证券	2	60,324,901.20	0.74	26,295.39	0.74	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
开源证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	987,616,551.34	18.91	4,074,300,000.00	31.53	-	-
民生证券	1,260,152,651.03	24.13	183,000,000.00	1.42	-	-
国金证券	619,132,054.06	11.85	66,000,000.00	0.51	-	-
东方证券	571,180,306.63	10.94	4,100,000,000.00	31.73	-	-
招商证券	1,103,577,378.03	21.13	3,808,000,000.00	29.47	-	-
国泰海通	285,855,823.09	5.47	663,700,000.00	5.14	-	-
中金公司	162,212,656.87	3.11	25,000,000.00	0.19	-	-
国都证券	233,624,649.82	4.47	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证	-	-	-	-	-	-

券						
---	--	--	--	--	--	--

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧双利债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧双利债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧双利债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧双利债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧双利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
10	中欧双利债券型证券投资基金更新招募说明书（2026 年 5 月）	中国证监会指定媒介	2026-05-21
11	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06
12	中欧双利债券型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2026-06-26
13	中欧双利债券型证券投资基金托管协议（修订）	中国证监会指定媒介	2026-06-26
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与各基金托管人协商一致，本基金管理人于 2026 年 7 月 27 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体可参见管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 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 8 月 29 日