

中欧颐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	9
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	10
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	11
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	12
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	12
§ 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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46

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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧颐利债券型证券投资基金	
基金简称	中欧颐利债券	
基金主代码	016850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 25 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	6,656,626,619.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
下属分级基金的交易代码	016850	016851
报告期末下属分级基金的份额总额	6,107,147,884.14 份	549,478,735.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*3%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	北京市西城区金融大街 3 号

	家嘴环路 479 号 8 层	
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、10、16 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200120	100808
法定代表人	竇玉明	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	中国证券报
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)	
	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
本期已实现收益	-66,350,110.73	-5,779,397.57
本期利润	-43,724,272.10	-2,035,644.91
加权平均基金份 额本期利润	-0.0055	-0.0026
本期加权平均净 值利润率	-0.49%	-0.23%
本期基金份额净 值增长率	-0.24%	-0.45%
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	584,168,459.46	43,880,846.50
期末可供分配基 金份额利润	0.0957	0.0799
期末基金资产净	6,781,010,248.71	601,385,542.04

值		
期末基金份额净值	1.1103	1.0945
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	11.03%	9.45%

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

中欧颐利债券 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	-1.11%	0.13%	1.94%	0.16%	-3.05%	-0.03%
过去六个月	-0.24%	0.15%	2.11%	0.15%	-2.35%	0.00%
过去一年	1.94%	0.13%	3.72%	0.13%	-1.78%	0.00%
过去三年	11.22%	0.14%	15.07%	0.14%	-3.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	11.03%	0.14%	18.22%	0.13%	-7.19%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中债新综合财富指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*3%。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。

中欧颐利债券 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	-1.21%	0.13%	1.94%	0.16%	-3.15%	-0.03%
过去六个月	-0.45%	0.15%	2.11%	0.15%	-2.56%	0.00%

过去一年	1.53%	0.13%	3.72%	0.13%	-2.19%	0.00%
过去三年	9.91%	0.14%	15.07%	0.14%	-5.16%	0.00%
自基金合同生效起 至今	9.45%	0.14%	18.22%	0.13%	-8.77%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中债新综合财富指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数收益率*3%。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		
刘勇	基金经理	2023-08-14	-	10 年	历任中铁资源集团商贸有限公司大宗商品部期货投资，太平洋证券股份有限公司信用业务部证券研究及管理，幸福人寿保险股份有限公司高级研究员、研究所总经理助理、股票投资部总经理助理。2023-06-21 加入中欧基金管理有限公司。
胡阆洋	基金经理 / 基金经理助理	2024-12-24	-	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。

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，其中胡阆洋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 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

2026 年上半年，A 股呈现先抑后扬的结构性牛市——指数普涨但极度分化，科技成长一枝独秀，红利/大盘价值/微盘表现较弱。上证指数仅涨 3.2%，科创 50 却飙涨 64%，冰火两重天。第一季度指数高位震荡承压：1 月上证突破 4100 点、创近十年阶段新高，2 月高位整固；2 月末美以空袭伊朗、霍尔木兹海峡封锁推动油价暴涨，3 月迎来最大回调。第二季度市场逐步修复，科技主线确立：4 月特朗普“TACO”再度停火，风险偏好 V 型修复；5-6 月地缘钝化，AI 大模型迭代叠加算力需求成为真正主线，科创 50 显著跑赢。债券层面，上半年的行情主要是钱多驱动的行情走势，十年期国债从年初高点 1.90% 一路下探到 1.70% 附近位置。驱动力并不是基本面的大幅走弱，也不是央行降息。更多的其实是高息存款到期后存款搬家，推动理财、债基、保险等负债端的持续扩张。在资金面宽松和上述逻辑推动下，债券市场表现出了几个逻辑：1. 曲线走陡，短端下行幅度明显超越长端。2. 票息资产受追捧，比如长久期二永、长久期普信和超长久期地方债。但从 6 月上旬资金面收紧引发基金赎回以来，信用债出现 3-9BP 的快速调整，债券资产波动开始走高。

产品坚持低波动二级债基的定位，充分利用股债资产的对冲效果，严格控制产品净值的回撤幅度。股票组合坚持稳健红利类资产、顺周期资产、科技制造和消费医药等重点行业的均衡配置。坚定看好红利股票的配置价值，特别是港股的高股息资产，由于有持续的资金流入和更好的性价比，是底仓配置的较好品种，对其他高波动股票资产有较好的对冲效果，力争通过挖掘有阿尔法的个股来创造绝对收益。组合在一季度抓住涨价链的配置窗口，增加对有色、化工等顺周期行业

的关注，并在美伊冲突爆发之后，增加对新能源的关注。由于 5、6 月份市场风格越发极致，股票内部除科技的方向均承压，降低股票的仓位控制组合回撤。顺周期内部，整体持仓向景气度确定性和持续性更强的非银金融和煤炭行业集中。对于稳健类的红利，组合仍保持较高比例的银行股权重，更偏重于有一定成长性的优质城商行和股份行，同时更加集中关注能够提升分红比例的个股。科技板块配置 AI 方向中较为紧缺的环节。对消费保持谨慎。债券操作上，组合在上半年较好地把握了债券市场行情的几波走势。考虑到今年货币政策持续的宽松状态，短久期信用债上行风险可控，组合在年初关注 2Y 附近短信用的投资机会。4 月份以来，组合在震荡中逐渐抬升久期，积极通过长久期利率债参与波段交易。

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-0.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.11%；基金 C 类份额净值增长率为-0.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，股票市场风格再平衡的动力强劲，红利板块股价存在修复的动力，目前来看，我们认为红利板块存在比较明显的超跌特征，相对估值的角度，和债券的性价比比较也超过了 2 倍标准差的极值位置；绝对估值的层面，中证红利指数的静态股息率也超过了 5%，并且主要行业今年都有不错的利润增长，动态股息率更加高。我们认为股价与基本面的背离终将会修复。考虑到今年市场的风险偏好较高，整体持仓向景气度确定性和持续性更强的非银金融和煤炭行业集中。对于稳健类的红利，组合仍保持较高比例的银行股权重，更偏重于有一定成长性的优质城商行和股份行，同时更加集中关注能够提升分红比例的个股。科技方向会在拥挤度消化之后关注投资机会。对于债券市场，站在当前时点看下半年，钱多的状态能否持续是我们非常关注的方向。高息存款到期规模下半年明显下降，理财 8-9 月也存在季节性回表的压力，因此我们会十分关注钱多是否会有退坡的趋势。除此之外，上半年地方债发行进度偏慢，后续尤其三季度，市场还会面临供给压力。二者叠加，我们会认为债券夏普最高的阶段可能已经过去，三季度或更强调组合对高波动和低绝对收益的交易节奏把握能力。

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”）在中欧颐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遵规守信、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：中欧颐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	307,115,583.76	144,713,935.52
结算备付金		88,262,681.14	42,283,460.61
存出保证金		1,792,016.89	1,760,619.27
交易性金融资产	6.4.7.2	8,729,837,985.92	9,343,841,940.84
其中：股票投资		666,368,394.96	909,440,499.86
基金投资		—	—
债券投资		8,063,469,590.96	8,434,401,440.98
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		43,529,332.32	127,847,648.79
应收股利		2,472,773.29	793,785.79
应收申购款		53,284.94	1,171,300.78
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		9,173,063,658.26	9,662,412,691.60
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		1,421,050,654.24	1,829,210,699.99
应付清算款		27,650,682.87	—
应付赎回款		332,905,942.71	206,044,355.57

应付管理人报酬		4,600,533.93	4,049,269.16
应付托管费		766,755.65	674,878.21
应付销售服务费		241,689.06	393,082.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		385,777.13	341,843.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,065,831.92	1,423,759.94
负债合计		1,790,667,867.51	2,042,137,888.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,656,626,619.14	6,858,969,729.14
未分配利润	6.4.7.8	725,769,171.61	761,305,074.02
净资产合计		7,382,395,790.75	7,620,274,803.16
负债和净资产总计		9,173,063,658.26	9,662,412,691.60

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 6,656,626,619.14 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.1103 元，基金份额总额 6,107,147,884.14 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0945 元，基金份额总额 549,478,735.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧颐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		3,456,500.87	65,826,002.16
1. 利息收入		429,232.96	171,929.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	429,232.96	110,742.73
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		-	61,186.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-23,480,220.20	75,714,768.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-141,669,310.04	35,353,661.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	102,641,190.66	35,959,166.71
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	15,547,899.18	4,401,940.52
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	26,369,591.29	-10,061,896.30
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	137,896.82	1,200.55
减：二、营业总支出		49,216,417.88	11,798,403.06
1. 管理人报酬		29,119,941.90	6,989,574.90
2. 托管费		4,853,323.62	1,164,929.17
3. 销售服务费		1,733,721.28	311,533.02
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		13,130,695.82	3,161,048.49
其中：卖出回购金融资产支出		13,130,695.82	3,161,048.49
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		247,484.40	60,921.85
8. 其他费用	6.4.7.18	131,250.86	110,395.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,759,917.01	54,027,599.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,759,917.01	54,027,599.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-45,759,917.01	54,027,599.10

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧颐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	6,858,969,729.14	-	761,305,074.02	7,620,274,803.16
二、本期期初净资产	6,858,969,729.	-	761,305,074.02	7,620,274,803.1

	14			6
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-202,343,110.00	-	-35,535,902.41	-237,879,012.41
(一)、综合收益总额	-	-	-45,759,917.01	-45,759,917.01
(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)	-202,343,110.00	-	10,224,014.60	-192,119,095.40
其中：1. 基金申购款	7,849,083,739.89	-	970,007,671.34	8,819,091,411.23
2. 基金赎回款	-8,051,426,849.89	-	-959,783,656.74	-9,011,210,506.63
(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	6,656,626,619.14	-	725,769,171.61	7,382,395,790.75
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	1,591,048,349.28	-	105,980,779.12	1,697,029,128.40
二、本期期初净资产	1,591,048,349.28	-	105,980,779.12	1,697,029,128.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,724,521,767.43	-	187,392,484.63	1,911,914,252.06
(一)、综合收益总额	-	-	54,027,599.10	54,027,599.10
(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)	1,724,521,767.43	-	133,364,885.53	1,857,886,652.96

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	2, 779, 107, 466. 09	-	210, 165, 557. 26	2, 989, 273, 023. 3 5
2. 基金赎回款	-1, 054, 585, 698 . 66	-	-76, 800, 671. 73	-1, 131, 386, 370. 39
(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	3, 315, 570, 116. 71	-	293, 373, 263. 75	3, 608, 943, 380. 4 6

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
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

中欧颐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[2022]2118 号文《关于准予中欧颐利债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《中欧颐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基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,017,338.75 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61362990_B55 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧颐利债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 25 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 200,019,011.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,672.62 份基金份额。其中 A 类基金的基金份额总额为 190,009,225.78 份，包含认购利息折合 1,670.56 份；C 类基金的基金份额总额为 10,009,785.59 份，包含认购利息折合 2.06 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

令第 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	307,115,583.76
等于：本金	307,068,070.63
加：应计利息	47,513.13
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	307,115,583.76

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		723,839,735.54	—	666,368,394.96	-57,471,340.58
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	1,129,332,030.72	12,676,930.92	1,146,211,785.92	4,202,824.28
	银行间市场	6,816,588,433.88	65,812,605.04	6,917,257,805.04	34,856,766.12
	合计	7,945,920,464.60	78,489,535.96	8,063,469,590.96	39,059,590.40
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		8,669,760,200.14	78,489,535.96	8,729,837,985.92	-18,411,750.18

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	2,966,652.87
其中：交易所市场	2,802,446.95
银行间市场	164,205.92
应付利息	—
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	39,671.58

应付补差费	0.10
合计	3,065,831.92

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧颐利债券 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	5,838,154,094.75	5,838,154,094.75
本期申购	7,180,795,855.85	7,180,795,855.85
本期赎回（以“-”号填列）	-6,911,802,066.46	-6,911,802,066.46
本期末	6,107,147,884.14	6,107,147,884.14

中欧颐利债券 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	1,020,815,634.39	1,020,815,634.39
本期申购	668,287,884.04	668,287,884.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,139,624,783.43	-1,139,624,783.43
本期末	549,478,735.00	549,478,735.00

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

中欧颐利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	602,400,924.22	57,472,640.99	659,873,565.21
本期期初	602,400,924.22	57,472,640.99	659,873,565.21
本期利润	-66,350,110.73	22,625,838.63	-43,724,272.10
本期基金份额交易产生的变动数	48,117,645.97	9,595,425.49	57,713,071.46
其中：基金申购款	794,111,800.96	102,602,603.97	896,714,404.93
基金赎回款	-745,994,154.99	-93,007,178.48	-839,001,333.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	584,168,459.46	89,693,905.11	673,862,364.57

中欧颐利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	91,361,810.27	10,069,698.54	101,431,508.81
本期期初	91,361,810.27	10,069,698.54	101,431,508.81
本期利润	-5,779,397.57	3,743,752.66	-2,035,644.91
本期基金份额交易产生的变动数	-41,701,566.20	-5,787,490.66	-47,489,056.86
其中：基金申购款	63,619,962.01	9,673,304.40	73,293,266.41

基金赎回款	-105,321,528.21	-15,460,795.06	-120,782,323.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,880,846.50	8,025,960.54	51,906,807.04

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	258,403.15
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	101,586.71
其他	69,243.10
合计	429,232.96

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	5,265,983,757.67
减：卖出股票成本总额	5,398,162,682.62
减：交易费用	9,490,385.09
买卖股票差价收入	-141,669,310.04

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	111,725,463.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,084,272.63
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	102,641,190.66

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	8,587,323,713.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	8,522,294,422.49

本总额	
减：应计利息总额	73,993,051.50
减：交易费用	120,512.21
买卖债券差价收入	-9,084,272.63

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	15,547,899.18
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	15,547,899.18

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	26,369,591.29
股票投资	-34,168,747.85
债券投资	60,538,339.14
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	26,369,591.29

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	132,091.16
基金转换费收入	5,805.66
合计	137,896.82

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	39,671.58
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
证券组合费	9,469.62
存托服务费	4,002.29
合计	131,250.86

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	481,666,863.08	4.61	-	-

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	421,964,472.91	25.49	20,043,875.89	3.94

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回 购 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（%）
国都证券	674,000,000.00	2.58	-	-

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	214,781.37	4.59	180,844.23	6.45
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 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	-	-	-	-

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	29,119,941.90	6,989,574.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,396,753.22	305,050.43
应支付基金管理人的净管理费	24,723,188.68	6,684,524.47

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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	4,853,323.62	1,164,929.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现

数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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		
	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C	合计
国都证券	0.00	384.33	384.33
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	307.37	307.37
中欧财富	0.00	8,667.32	8,667.32
中欧基金	0.00	518,395.95	518,395.95
合计	0.00	527,754.97	527,754.97
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		
	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
中欧财富	0.00	349.80	349.80
中欧基金	0.00	300,082.04	300,082.04
合计	0.00	300,431.84	300,431.84

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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

中欧颐利债券 A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	6,875,666.50	6,875,666.50
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,875,666.50	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	6,875,666.50
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00	0.22%

中欧颐利债券 C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	0.00	150,015.00
报告期间申购/买	0.00	0.00

入总份额		
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	150,015.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00	0.07%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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

中欧颐利债券 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	3,033,236.22	0.05%	4,335,335.23	0.07%

份额单位：份

中欧颐利债券 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	27,887.41	0.01%	27,883.65	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	307,115,583.76	258,403.15	10,313,004.23	54,270.22

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 1,150,050,654.24 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
102102020	21 闽高速 MTN006	2026 年 7 月 1 日	107.80	400,000	43,120,326.58
102282605	22 深圳地铁 MTN002B	2026 年 7 月 1 日	104.37	300,000	31,311,984.66
102282701	22 中海企业 MTN006 (绿色)	2026 年 7 月 1 日	102.82	400,000	41,127,057.53
102480276	24 中海企业 MTN001A	2026 年 7 月 1 日	101.90	320,000	32,607,886.03
102481533	24 东南国资 MTN001	2026 年 7 月 1 日	102.94	300,000	30,882,739.73
102482343	24 湘高速 MTN006	2026 年 7 月 1 日	101.18	200,000	20,236,536.99
102580144	25 朝阳国资 MTN001	2026 年 7 月 1 日	101.82	400,000	40,728,081.10
102581251	25 国航 MTN001	2026 年 7 月 1 日	101.38	291,000	29,501,079.32
102582663	25 南航股 MTN001	2026 年 7 月 1 日	100.38	756,000	75,883,957.74

102582799	25 中金集 MTN003(科 创债)	2026 年 7 月 1 日	102.09	400,000	40,837,115.62
102584428	25 湘高速 MTN021	2026 年 7 月 1 日	102.25	300,000	30,674,033.42
102584430	25 嘉兴国 资 MTN001	2026 年 7 月 1 日	102.15	200,000	20,429,178.08
102584590	25 萧山机 场 MTN002A(绿 色)	2026 年 7 月 1 日	102.03	100,000	10,202,575.34
170210	17 国开 10	2026 年 7 月 1 日	103.00	400,000	41,199,046.58
210208	21 国开 08	2026 年 7 月 1 日	102.58	800,000	82,063,605.48
220215	22 国开 15	2026 年 7 月 1 日	110.50	237,000	26,189,006.47
240202	24 国开 02	2026 年 7 月 1 日	101.66	300,000	30,499,421.92
240205	24 国开 05	2026 年 7 月 1 日	107.81	475,000	51,211,532.87
240210	24 国开 10	2026 年 7 月 1 日	105.02	600,000	63,012,328.77
240215	24 国开 15	2026 年 7 月 1 日	106.10	500,000	53,049,273.97
250202	25 国开 02	2026 年 7 月 1 日	100.33	1,300,000	130,431,065.75
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.27	100,000	10,126,909.59
260205	26 国开 05	2026 年 7 月 1 日	101.86	1,100,000	112,040,997.26
260301	26 进出 01	2026 年 7 月 1 日	100.53	200,000	20,105,326.03
260401	26 农发 01	2026 年 7 月 1 日	100.82	1,000,000	100,823,287.67
2605272	26 广东债 20	2026 年 7 月 1 日	102.65	300,000	30,793,646.74
2605578	26 江苏债 23	2026 年 7 月 1 日	100.44	59,000	5,926,222.93
2605582	26 安徽债 38	2026 年 7 月 1 日	100.68	200,000	20,135,271.74
合计				11,938,000	1,225,149,495.91

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 271,000,000.00 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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金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。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和反馈。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同责任，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	20,105,326.03	20,168,676.71
合计	20,105,326.03	20,168,676.71

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	3,580,293,814.43	3,670,016,607.08
AAA 以下	104,672,137.63	180,401,551.49
未评级	4,358,398,312.87	4,563,814,605.70
合计	8,043,364,264.93	8,414,232,764.27

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地方政府债、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公司的证券不得超过该证券的 10%。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	307,115,583.76	-	-	-	307,115,583.76
结算备付金	88,262,681.14	-	-	-	88,262,681.14
存出保证金	1,792,016.89	-	-	-	1,792,016.89
交易性金融资产	672,924,732.96	6,667,301,230.86	723,243,627.14	666,368,394.96	8,729,837,985.92
应收股利	-	-	-	2,472,773.29	2,472,773.29
应收申购款	-	-	-	53,284.94	53,284.94
应收清算款	-	-	-	43,529,332.32	43,529,332.32
资产总计	1,070,095,014.75	6,667,301,230.86	723,243,627.14	712,423,785.51	9,173,063,658.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	332,905,942.71	332,905,942.71
应付管理人报酬	-	-	-	4,600,533.93	4,600,533.93
应付托管费	-	-	-	766,755.65	766,755.65
应付清算款	-	-	-	27,650,682.87	27,650,682.87
卖出回购金融资产款	1,421,050,654.24	-	-	-	1,421,050,654.24
应付销售服务费	-	-	-	241,689.06	241,689.06
应交税费	-	-	-	385,777.13	385,777.13
其他负债	-	-	-	3,065,831.92	3,065,831.92
负债总计	1,421,050,654.24	-	-	369,617,213.27	1,790,667,867.51
利率敏感度缺口	-350,955,639.49	6,667,301,230.86	723,243,627.14	342,806,572.24	7,382,395,790.75
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	144,713,935.52	-	-	-	144,713,935.52
结算备付金	42,283,460.61	-	-	-	42,283,460.61
存出保证金	1,760,619.27	-	-	-	1,760,619.27
交易性金融资产	1,015,837,671.17	7,233,595,828.84	184,967,940.97	909,440,499.86	9,343,841,940.84
应收股利	-	-	-	793,785.79	793,785.79
应收申购款	-	-	-	1,171,300.78	1,171,300.78
应收清算款	-	-	-	127,847,648.79	127,847,648.79
资产总计	1,204,595,686.57	7,233,595,828.84	184,967,940.97	1,039,253,235.22	9,662,412,691.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	206,044,355.57	206,044,355.57

应付管理人报酬	-	-	-	4,049,269.16	4,049,269.16
应付托管费	-	-	-	674,878.21	674,878.21
卖出回购金融资产款	1,829,210,699.99	-	-	-	1,829,210,699.99
应付销售服务费	-	-	-	393,082.37	393,082.37
应交税费	-	-	-	341,843.20	341,843.20
其他负债	-	-	-	1,423,759.94	1,423,759.94
负债总计	1,829,210,699.99	-	-	212,927,188.45	2,042,137,888.44
利率敏感度缺口	-624,615,013.42	7,233,595,828.84	184,967,940.97	826,326,046.77	7,620,274,803.16

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	-57,705,354.37	-48,712,810.78
	利率下降 25BP	58,458,565.34	49,194,188.55

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	140,065,394.00	-	140,065,394.00
应收股利	-	2,472,773.29	-	2,472,773.29
资产合计	-	142,538,167.29	-	142,538,167.29

以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	142,538,167.29	-	142,538,167.29
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	184,834,041.00	-	184,834,041.00
应收股利	-	793,785.79	-	793,785.79
资产合计	-	185,627,826.79	-	185,627,826.79
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	185,627,826.79	-	185,627,826.79

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
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）
	港币相对人民币贬值 5%	-7,126,908.36	-9,281,391.34
	港币相对人民币升值 5%	7,126,908.36	9,281,391.34

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	666,368,394.96	9.03	909,440,499.86	11.93
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	666,368,394.96	9.03	909,440,499.86	11.93

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 9.03%（2025 年 12 月 31 日：11.93%），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	666,955,448.76	904,771,843.76
第二层次	8,062,882,537.16	8,439,070,097.08
第三层次	—	—
合计	8,729,837,985.92	9,343,841,940.84

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	666,368,394.96	7.26

	其中：股票	666,368,394.96	7.26
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,063,469,590.96	87.90
	其中：债券	8,063,469,590.96	87.90
	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	395,378,264.90	4.31
8	其他各项资产	47,847,407.44	0.52
9	合计	9,173,063,658.26	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 140,065,394.00 元，占基金资产净值比例 1.90%。

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	—	—
B	采矿业	29,648,451.00	0.40
C	制造业	176,403,442.43	2.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,406,971.30	0.56
E	建筑业	1,073,100.00	0.01
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	54,697,488.00	0.74
H	住宿和餐饮业	609,861.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,209,273.75	0.12
J	金融业	139,861,678.24	1.89
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	18,066,159.84	0.24
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	55,326,575.40	0.75
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	—	—
S	综合	—	—

	合计	526,303,000.96	7.13
--	----	----------------	------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	2,802,460.00	0.04
消费者非必需品	16,128.00	0.00
消费者常用品	20,864.00	0.00
能源	29,945,420.00	0.41
金融	53,567,876.00	0.73
医疗保健	2,074.00	0.00
工业	18,965,684.00	0.26
信息技术	19,847,770.00	0.27
电信服务	6,772,930.00	0.09
公用事业	8,068,060.00	0.11
地产业	56,128.00	0.00
合计	140,065,394.00	1.90

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600323	瀚蓝环境	1,775,629	48,758,772.34	0.66
2	601006	大秦铁路	10,503,000	48,418,830.00	0.66
3	601166	兴业银行	2,496,300	41,338,728.00	0.56
4	600674	川投能源	2,916,390	41,325,246.30	0.56
5	600496	精工钢构	10,694,100	33,151,710.00	0.45
6	02318	中国平安	472,000	20,928,480.00	0.28
6	601318	中国平安	44,200	2,110,108.00	0.03
7	601211	国泰海通	1,168,800	21,272,160.00	0.29
8	01336	新华保险	515,600	20,608,532.00	0.28
9	01171	兖矿能源	2,008,000	19,276,800.00	0.26
9	600188	兖矿能源	3,600	63,972.00	0.00
10	000977	浪潮信息	276,200	19,334,000.00	0.26
11	601138	工业富联	267,729	19,316,647.35	0.26
12	601009	南京银行	1,755,200	17,358,928.00	0.24
13	601628	中国人寿	405,671	14,340,469.85	0.19
13	02628	中国人寿	105,000	2,431,800.00	0.03
14	601665	齐鲁银行	2,559,507	14,768,355.39	0.20
15	600256	广汇能源	2,923,900	14,444,066.00	0.20
16	00981	中芯国际	175,500	13,627,575.00	0.18
17	600755	厦门国贸	2,423,552	13,135,651.84	0.18
18	300308	中际旭创	10,200	12,954,000.00	0.18
19	603225	新凤鸣	558,400	10,972,560.00	0.15

20	000425	徐工机械	1,279,500	10,351,155.00	0.14
21	000776	广发证券	428,300	10,022,220.00	0.14
22	002916	深南电路	20,600	9,432,740.00	0.13
23	01766	中国中车	2,186,000	8,525,400.00	0.12
24	00916	龙源电力	1,859,000	8,068,060.00	0.11
25	603268	松发股份	55,900	7,785,752.00	0.11
26	03808	中国重汽	230,000	7,698,100.00	0.10
27	601288	农业银行	812,800	4,933,696.00	0.07
27	01288	农业银行	374,000	1,735,360.00	0.02
28	301109	军信股份	527,111	6,567,803.06	0.09
29	601077	渝农商行	980,400	5,990,244.00	0.08
30	01277	力量发展	4,458,000	5,973,720.00	0.08
31	600985	淮北矿业	407,400	5,723,970.00	0.08
32	600999	招商证券	254,600	5,372,060.00	0.07
33	688256	寒武纪	3,125	4,986,093.75	0.07
34	002027	分众传媒	1,018,700	4,930,508.00	0.07
35	601298	青岛港	604,300	4,864,615.00	0.07
36	600031	三一重工	271,700	4,694,976.00	0.06
37	00883	中国海洋石油	266,000	4,694,900.00	0.06
38	300454	深信服	43,900	4,223,180.00	0.06
39	688127	蓝特光学	42,718	4,169,276.80	0.06
40	301611	珂玛科技	22,600	4,069,582.00	0.06
41	300568	星源材质	216,700	4,056,624.00	0.05
42	688234	天岳先进	23,153	4,017,277.03	0.05
43	300571	平治信息	87,200	3,981,552.00	0.05
44	300274	阳光电源	24,600	3,911,892.00	0.05
45	601233	桐昆股份	175,900	3,808,235.00	0.05
46	603256	宏和科技	14,300	3,794,219.00	0.05
47	601699	潞安环能	265,400	3,789,912.00	0.05
48	920179	凯德石英	38,069	3,740,279.25	0.05
49	06869	长飞光纤光缆	16,500	3,660,195.00	0.05
50	601168	西部矿业	128,300	3,482,062.00	0.05
51	09911	赤子城科技	526,000	3,450,560.00	0.05
52	00939	建设银行	490,000	3,434,900.00	0.05
53	03908	中金公司	185,600	3,385,344.00	0.05
54	00700	腾讯控股	8,900	3,322,370.00	0.05
55	600309	万华化学	40,600	2,777,446.00	0.04
56	00390	中国中铁	944,000	2,709,280.00	0.04
57	00148	建滔集团	25,000	2,560,000.00	0.03
58	000651	格力电器	67,700	2,538,750.00	0.03
59	600887	伊利股份	99,800	2,391,208.00	0.03
60	600546	山煤国际	192,300	2,101,839.00	0.03
61	301216	万凯新材	81,400	1,871,386.00	0.03

62	02899	紫金矿业	70,000	1,666,000.00	0.02
63	01398	工商银行	187,000	1,043,460.00	0.01
63	601398	工商银行	61,500	434,805.00	0.01
64	601975	招商南油	379,100	1,414,043.00	0.02
65	002736	国信证券	129,400	1,292,706.00	0.02
66	600019	宝钢股份	216,700	1,176,681.00	0.02
67	00914	海螺水泥	78,000	1,136,460.00	0.02
68	600507	方大特钢	271,400	1,099,170.00	0.01
69	601117	中国化学	146,000	1,073,100.00	0.01
70	688282	理工导航	14,485	843,027.00	0.01
71	600754	锦江酒店	33,900	609,861.00	0.01
72	601328	交通银行	50,600	325,358.00	0.00
73	600919	江苏银行	28,000	301,840.00	0.00
74	600795	国电电力	17,500	81,725.00	0.00
75	600482	XD 中国动	2,300	75,440.00	0.00
76	600219	南山铝业	13,700	54,663.00	0.00
77	00012	恒基地产	2,000	43,080.00	0.00
78	601898	中煤能源	3,500	42,630.00	0.00
79	603369	今世缘	1,400	33,194.00	0.00
80	02208	金风科技	3,600	32,904.00	0.00
81	02517	锅圈	12,800	20,864.00	0.00
82	09988	阿里巴巴-W	200	16,128.00	0.00
83	02423	贝壳-W	400	13,048.00	0.00
84	01513	丽珠医药	100	2,074.00	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	601318	中国平安	63,057,506.28	0.83
1	02318	中国平安	34,012,851.50	0.45
2	600755	厦门国贸	79,995,793.64	1.05
3	600496	精工钢构	76,598,158.00	1.01
4	301216	万凯新材	70,980,639.50	0.93
5	601628	中国人寿	62,076,401.27	0.81
5	02628	中国人寿	2,595,726.35	0.03
6	600323	瀚蓝环境	60,976,784.53	0.80
7	01336	新华保险	58,163,338.42	0.76
7	601336	新华保险	84,432.00	0.00
8	600256	广汇能源	56,995,585.00	0.75
9	601006	大秦铁路	55,117,666.00	0.72
10	601117	中国化学	51,996,947.00	0.68
11	689009	九号公司	49,996,105.70	0.66
12	601288	农业银行	39,346,737.00	0.52

12	01288	农业银行	9,578,217.79	0.13
13	601608	中信重工	48,496,517.75	0.64
14	601166	兴业银行	46,588,951.00	0.61
15	01171	兖矿能源	40,250,376.13	0.53
15	600188	兖矿能源	5,089,139.00	0.07
16	600507	方大特钢	44,698,010.14	0.59
17	600674	川投能源	44,052,527.31	0.58
18	601665	齐鲁银行	43,997,349.00	0.58
19	600452	涪陵电力	43,995,186.49	0.58
20	000157	中联重科	42,565,495.90	0.56

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	601665	齐鲁银行	87,092,739.24	1.14
2	600323	瀚蓝环境	79,269,091.00	1.04
3	601318	中国平安	57,328,948.76	0.75
3	02318	中国平安	7,007,017.71	0.09
4	600039	四川路桥	62,802,665.04	0.82
5	301216	万凯新材	62,272,290.50	0.82
6	600755	厦门国贸	57,558,527.34	0.76
7	601117	中国化学	57,190,169.00	0.75
8	600507	方大特钢	54,900,875.65	0.72
9	601699	潞安环能	51,338,605.76	0.67
10	689009	九号公司	49,330,354.91	0.65
11	000719	中原传媒	48,674,129.60	0.64
12	002948	青岛银行	48,489,776.76	0.64
13	600452	涪陵电力	46,730,729.59	0.61
14	601628	中国人寿	46,269,308.00	0.61
15	603345	安井食品	45,837,935.00	0.60
16	601608	中信重工	45,400,379.50	0.60
17	688308	欧科亿	44,088,633.89	0.58
18	002415	海康威视	43,836,551.85	0.58
19	01171	兖矿能源	39,402,521.56	0.52
19	600188	兖矿能源	4,009,536.00	0.05
20	300835	龙磁科技	42,192,133.50	0.55

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	5,189,259,325.57
卖出股票收入（成交）总额	5,265,983,757.67

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	2,809,656,032.35	38.06
	其中：政策性金融债	1,000,265,920.55	13.55
4	企业债券	716,884,754.03	9.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,475,368,386.65	60.62
7	可转债（可交换债）	587,053.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	60,973,364.13	0.83
10	合计	8,063,469,590.96	109.23

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	243639	25 东证 Y1	1,400,000	144,517,397.26	1.96
2	232480098	24 浦发银行二级资本债 02A	1,320,000	135,533,115.62	1.84
3	250202	25 国开 02	1,300,000	130,431,065.75	1.77
4	244577	26 中财 Y1	1,200,000	123,019,660.27	1.67
5	242400005	24 农行永续债 01	1,100,000	113,977,847.12	1.54

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。国债期货作为利

率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

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，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。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。中国农业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的处罚。中国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的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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	1,792,016.89
2	应收清算款	43,529,332.32
3	应收股利	2,472,773.29
4	应收利息	—
5	应收申购款	53,284.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	47,847,407.44

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	118011	银微转债	587,053.80	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
中欧颐利债券 A	1,325	4,609,168.21	6,070,959,937.78	99.41%	36,187,946.36	0.59%
中欧颐利债券 C	30,938	17,760.64	403,605,754.27	73.45%	145,872,980.73	26.55%
合计	32,263	206,323.86	6,474,565,692.05	97.26%	182,060,927.09	2.74%

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	中欧颐利债券 A	3,207,192.18	0.05%
	中欧颐利债券 C	41,537.87	0.01%
	合计	3,248,730.05	0.05%

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	中欧颐利债券 A	0
	中欧颐利债券 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	中欧颐利债券 A	0~10
	中欧颐利债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧颐利债券 A	中欧颐利债券 C
基金合同生效日 (2022 年 11 月 25 日) 基金份额总额	190,009,225.78	10,009,785.59
本报告期期初基金份 额总额	5,838,154,094.75	1,020,815,634.39
本报告期基金总申购 份额	7,180,795,855.85	668,287,884.04
减：本报告期基金总 赎回份额	6,911,802,066.46	1,139,624,783.43
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	6,107,147,884.14	549,478,735.00

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(%)	
东方证券	1	3,804,767,263.31	36.39	1,709,176.56	36.56	—
招商证券	1	1,420,390,021.50	13.59	646,110.71	13.82	—
中金公司	1	1,268,909,880.82	12.14	553,120.64	11.83	—
民生证券	1	1,235,796,327.95	11.82	538,682.04	11.52	—
华泰证券	1	1,101,777,954.03	10.54	495,013.06	10.59	—
国泰海通	3	897,117,183.44	8.58	409,349.93	8.76	—
国都证券	2	481,666,863.08	4.61	214,781.37	4.59	—
国金证券	1	241,317,730.18	2.31	107,329.58	2.30	—

开源证券	1	3,499,858.93	0.03	1,277.52	0.03	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	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(%)
东方证券	140,509,163.51	8.49	11,786,000.00	45.20	-	-
招商证券	908,677,315.97	54.90	4,440,000.00	17.03	-	-
中金公司	99,631,417.40	6.02	1,179,000.00	4.52	-	-
民生证券	84,325,574.59	5.09	659,000.00	2.53	-	-
华泰证券	-	-	4,988,000.00	19.13	-	-
国泰海通	-	-	2,336,000.00	8.96	-	-
国都证券	421,964,472.91	25.49	674,000.00	2.58	-	-
国金证券	-	-	12,000,000.00	0.05	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长江证	-	-	-	-	-	-

券						
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 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	中欧颐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	中欧颐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
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
6	中欧颐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	2026-04-15
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	2026-04-15
8	中欧颐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
9	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	中国证监会指定媒介	2026-06-06

	本公司旗下基金销售业务的公告		
--	----------------	--	--

§ 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 9 月 21 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 8 月 22 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