

中欧鼎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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43

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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
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	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧鼎利债券型证券投资基金		
基金简称	中欧鼎利债券		
基金主代码	166010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 9 月 18 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	14,002,461,528.63 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
下属分级基金的交易代码	166010	009520	009519
报告期末下属分级基金的份额总额	4,619,064,208.37 份	2,850,644,203.05 份	6,532,753,117.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。
投资策略	本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、证券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。 本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整大类资产的配置比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+中证可转换债券指数×25%+中债综合财富指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	滕菲菲
	联系电话	021-68609600	4006800000
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95558
传真		021-50190017	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	窦玉明	方合英

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	A 类：中国证券登记结算有限责任公司 C 类、E 类：中欧基金管理有限公司	A 类：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类、E 类：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)		
	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
本期已实现收益	121,006,379.10	55,215,185.92	149,234,833.85
本期利润	341,779,714.38	158,263,792.15	399,836,479.86
加权平均基金份额本期利润	0.0919	0.0896	0.0898
本期加权平均净值利润率	6.67%	6.15%	6.03%
本期基金份额净值增长率	8.39%	8.20%	8.39%

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	2,043,039,743.75	588,969,230.77	1,584,963,331.37
期末可供分配基金份额利润	0.4423	0.2066	0.2426
期末基金资产净值	6,593,327,012.33	4,284,511,294.79	10,078,864,435.15
期末基金份额净值	1.4274	1.5030	1.5428
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	56.62%	36.22%	39.81%

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

中欧鼎利债券 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	6.72%	0.55%	3.70%	0.39%	3.02%	0.16%
过去六个月	8.39%	0.49%	3.64%	0.40%	4.75%	0.09%
过去一年	17.05%	0.45%	9.14%	0.34%	7.91%	0.11%
过去三年	17.97%	0.54%	19.68%	0.31%	-1.71%	0.23%
过去五年	16.45%	0.59%	23.50%	0.30%	-7.05%	0.29%

过去七年	48.99%	0.60%	38.02%	0.29%	10.97%	0.31%
自基金合同生效起 至今	56.62%	0.54%	43.93%	0.27%	12.69%	0.27%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率*60%+中证可转换债券指数*25%+中证 800 指数收益率*15%。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。

中欧鼎利债券 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	6.62%	0.55%	3.70%	0.39%	2.92%	0.16%
过去六个月	8.20%	0.49%	3.64%	0.40%	4.56%	0.09%
过去一年	16.60%	0.45%	9.14%	0.34%	7.46%	0.11%
过去三年	16.57%	0.54%	19.68%	0.31%	-3.11%	0.23%
过去五年	14.11%	0.59%	23.50%	0.30%	-9.39%	0.29%
自基金份额起始运作日至今	36.22%	0.62%	34.14%	0.31%	2.08%	0.31%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率*60%+中证可转换债券指数*25%+中证 800 指数收益率*15%。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。

中欧鼎利债券 E

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	6.72%	0.55%	3.70%	0.39%	3.02%	0.16%
过去六个月	8.39%	0.49%	3.64%	0.40%	4.75%	0.09%
过去一年	17.04%	0.45%	9.14%	0.34%	7.90%	0.11%
过去三年	18.14%	0.54%	19.68%	0.31%	-1.54%	0.23%
过去五年	16.62%	0.59%	23.50%	0.30%	-6.88%	0.29%
自基金份额起始运作日至今	39.81%	0.62%	34.14%	0.31%	5.67%	0.31%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率*60%+中证可转换债券指数*25%+中证 800

指数收益率*15%。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

中欧鼎利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型生效日为 2017 年 9 月 18 日，自 2020 年 6 月 3 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总值指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%”变更为“中证 800 指数收益率*15%+中证可转换债券指数*25%+中债综合财富指数收益率*60%”，图示日期为 2017 年 9 月 18 日至 2026 年 06 月 30 日。

中欧鼎利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自 2020 年 6 月 3 日起，本基金增加 C 类份额。同日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总

值指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%“变更为”中证 800 指数收益率*15%+中证可转换债券指数*25%+中债综合财富指数收益率*60%”。图示日期为 2020 年 6 月 4 日至 2026 年 06 月 30 日。



注：自 2020 年 6 月 3 日起，本基金增加 E 类份额，同日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总值指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%“变更为”中证 800 指数收益率*15%+中证可转换债券指数*25%+中债综合财富指数收益率*60%”。图示日期为 2020 年 6 月 4 日至 2026 年 06 月 30 日。

§ 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		
赵宇	基金经理	2024-04-	-	7 年	历任博时基金管理有限公司基金经理助理

澄	/ 基金 经理助理	26			兼高级研究员。2024-01-29 加入中欧基金 管理有限公司。
邓欣 雨	固收投决 会委员 / 混合资产 组组长 / 基金经理	2025-05- 26	-	17 年	历任博时基金管理有限公司固定收益研究 员、固定收益研究员兼基金经理助理、基 金经理、混合资产投资部投资总监助理兼 基金经理。2023-10-27 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，其中赵宇澄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

从上半年国内资本市场表现看，权益市场整体震荡上涨，万得全 A 指数上涨 11.52%，但全 A

等权指数下跌 1.37%，A 股市场内部结构性差异极其显著，呈现出科技成长主导的结构性牛市，而以消费为代表的传统板块表现低迷，“硅基”挤压“碳基”，市场核心主线围绕 AI 算力和半导体展开。转债方面，中证转债指数上涨 2.51%，在高价格和高估值局面下，转债市场呈现高波动震荡行情特征，捕捉股市映射下的结构机会和波段交易更为重要。受益于流动性宽松环境，债市震荡上涨，不过低利率环境对绝对收益空间有所制约。从影响资本市场风险因素看，美以对伊朗发动的战争成为最大变量，高油价引发投资人对滞胀风险的担忧。

组合运作方面，基于我们对 2026 年展望中提到的思路，即权益市场从估值驱动转向业绩驱动，波动加大且宽基指数收益预期下降，投资上更注重从业绩方面挖掘机会，一方面是涨价链，一方面是创新成长领域。一季度组合在涨价或涨价预期链条中有业绩的周期品种上配置了部分仓位，主要是有色和化工品种，中东战事发生后我们重新评估该领域的投资价值，结果是大幅降低相关持仓，而从上市公司一季报看，以创业板为代表的成长板块业绩增速突出，符合业绩驱动的配置思路，因此组合进一步加强了在科技成长领域方面的持仓。组合在权益方面的投资更注重公司经营基本面，寻找经营能力持续改善的高增长领域仍是未来投资的主要方向。考虑到转债配置价值较为一般，组合显著降低了在该类资产的持仓。

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 8.39%，同期业绩比较基准收益率为 3.64%；基金 C 类份额净值增长率为 8.20%，同期业绩比较基准收益率为 3.64%；基金 E 类份额净值增长率为 8.39%，同期业绩比较基准收益率为 3.64%。

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，经济基本面整体趋于平稳的可能性偏大，外需方面需观察高油价中枢带来的需求影响，预计出口边际转弱的概率在提升，内需难有波动，对增量政策持中性判断。考虑到国内经济处于新旧动能转换的结构调整期，质量重于总量，投资机会更应从高端制造或科技突破领域中寻找，这代表着中国硬实力的提升，特别是“十五五”战略规划中着重提及的方向。在权益市场估值普遍不低的环境下，需秉持从业绩方面寻找优质资产，一方面 beta 视角看，可关注有业绩的强产业趋势领域，如 AI 相关等，另一方面 alpha 视角看，景气思维选股，如可关注全球竞争力强、基本面在右侧的优质企业。在社会总需求波动不大情况下，融资需求偏弱，整体看处于信用收缩环境中，同时我们的分析显示银行负债端成本处于下行中，且银行并未主动收缩资产负债表，债市环境相对偏友好。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对

中欧鼎利债券型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中欧基金管理有限公司在中欧鼎利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中欧基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中欧鼎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	1,891,024.21	10,235,074.50
结算备付金		73,584,024.03	11,221,370.03
存出保证金		2,114,724.80	343,651.82
交易性金融资产	6.4.7.2	21,208,813,223.01	3,400,671,929.95
其中：股票投资		3,977,231,535.82	575,001,580.91
基金投资		-	-
债券投资		17,231,581,687.19	2,825,670,349.04
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	-	149,095,788.59
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		53,986,121.95	25,247,139.82
应收股利		-	-
应收申购款		224,083,830.29	19,756,305.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,564,472,948.29	3,616,571,260.70
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		337,049,770.82	149,970,418.00
应付清算款		24,470,373.17	32,900,116.01
应付赎回款		228,661,035.71	5,544,293.75
应付管理人报酬		10,656,969.82	1,849,121.75
应付托管费		1,522,424.25	264,160.25
应付销售服务费		1,346,306.68	155,512.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		290,552.81	71,377.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,772,772.76	554,089.19
负债合计		607,770,206.02	191,309,088.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,605,004,093.00	2,132,210,884.95
未分配利润	6.4.7.8	8,351,698,649.27	1,293,051,286.87
净资产合计		20,956,702,742.27	3,425,262,171.82
负债和净资产总计		21,564,472,948.29	3,616,571,260.70

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 14,002,461,528.63 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.4274 元，基金份额总额 4,619,064,208.37 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.5030 元，基金份额总额 2,850,644,203.05 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 1.5428 元，基金份额总额 6,532,753,117.21 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧鼎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		964,426,926.98	26,083,423.32
1. 利息收入		1,549,591.44	119,918.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	750,145.06	96,170.56
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		799,446.38	23,747.55

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		386,369,476.97	28,712,702.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	206,453,464.82	-3,199,049.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	171,636,580.04	30,834,043.39
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	8,279,432.11	1,077,708.59
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	574,423,587.52	-2,892,872.48
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	2,084,271.05	143,674.73
减：二、营业总支出		64,546,940.59	5,191,805.49
1. 管理人报酬		49,464,936.89	3,997,845.54
2. 托管费		7,066,419.49	571,120.74
3. 销售服务费		5,063,664.07	172,823.45
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,692,322.08	332,111.32
其中：卖出回购金融资产 支出		2,692,322.08	332,111.32
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		122,703.29	15,878.65
8. 其他费用	6.4.7.18	136,894.77	102,025.79
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		899,879,986.39	20,891,617.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		899,879,986.39	20,891,617.83
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		899,879,986.39	20,891,617.83

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧鼎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	2,132,210,884. 95	—	1,293,051,286. 87	3,425,262,171.8 2
二、本期期初净资产	2,132,210,884. 95	—	1,293,051,286. 87	3,425,262,171.8 2
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,472,793,208 .05	—	7,058,647,362. 40	17,531,440,570. 45
(一)、综合收益总额	—	—	899,879,986.39	899,879,986.39
(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)	10,472,793,208 .05	—	6,158,767,376. 01	16,631,560,584. 06
其中：1. 基金申购款	17,380,633,107 .55	—	9,952,708,619. 77	27,333,341,727. 32
2. 基金赎回款	-6,907,839,899 .50	—	-3,793,941,243 .76	-10,701,781,143 .26
(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	12,605,004,093 .00	—	8,351,698,649. 27	20,956,702,742. 27
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	377,284,059.36	—	237,798,678.61	615,082,737.97
二、本期期初净资产	377,284,059.36	—	237,798,678.61	615,082,737.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	377,204,462.22	—	230,745,564.18	607,950,026.40

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	20,891,617.83	20,891,617.83
(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)	377,204,462.22	-	209,853,946.35	587,058,408.57
其中：1. 基金申购款	935,336,925.06	-	422,682,007.27	1,358,018,932.33
2. 基金赎回款	-558,132,462.84	-	-212,828,060.92	-770,960,523.76
(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	754,488,521.58	-	468,544,242.79	1,223,032,764.37

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

中欧鼎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[2017]1044号《关于准予中欧鼎利分级债券型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册而来。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧鼎利债券型证券投资基金基金合同》于2017年9月18日正式生效,基金合同生效日的基金资产净值为143,772,483.06元。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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。本财务报表以持续经营为基础编制。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、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》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。
2. 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入, 恢复缴纳增值税; 取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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. 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, 暂不计缴企业所得税。
4. 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。
5. 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。
6. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	1,891,024.21
等于: 本金	1,878,412.54
加: 应计利息	12,611.67
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	1,891,024.21

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		3,460,441,376.86	-	3,977,231,535.82	516,790,158.96
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债 券	交易所 市场	1,900,889,906.79	9,996,999.10	1,955,660,159.44	44,773,253.55
	银行间 市场	15,079,142,421.38	138,808,527.75	15,275,921,527.75	57,970,578.62
	合计	16,980,032,328.17	148,805,526.85	17,231,581,687.19	102,743,832.17
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		20,440,473,705.03	148,805,526.85	21,208,813,223.01	619,533,991.13

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	105,501.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,580,126.61
其中：交易所市场	3,531,071.94
银行间市场	49,054.67
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	9,775.70
预提费用-审计费	17,852.03
应付转出费	2.74
应付补差费	6.86
合计	3,772,772.76

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧鼎利债券 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	1,239,139,757.87	864,248,988.07
本期申购	4,907,804,700.47	3,423,003,232.27
本期赎回（以“-”号填列）	-1,527,880,249.97	-1,065,645,447.60
本期末	4,619,064,208.37	3,221,606,772.74

中欧鼎利债券 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	330,224,894.92	330,224,894.92
本期申购	4,603,762,189.73	4,603,762,189.73
本期赎回（以“-”号填列）	-2,083,342,881.60	-2,083,342,881.60
本期末	2,850,644,203.05	2,850,644,203.05

中欧鼎利债券 E

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	937,737,001.96	937,737,001.96
本期申购	9,353,867,685.55	9,353,867,685.55
本期赎回（以“-”号填列）	-3,758,851,570.30	-3,758,851,570.30
本期末	6,532,753,117.21	6,532,753,117.21

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

中欧鼎利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	504,205,960.92	263,338,489.03	767,544,449.95
本期期初	504,205,960.92	263,338,489.03	767,544,449.95
本期利润	121,006,379.10	220,773,335.28	341,779,714.38
本期基金份额交易产生的变动数	1,417,827,403.73	844,568,671.53	2,262,396,075.26
其中：基金申购款	2,074,460,771.42	1,226,351,794.82	3,300,812,566.24
基金赎回款	-656,633,367.69	-381,783,123.29	-1,038,416,490.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,043,039,743.75	1,328,680,495.84	3,371,720,239.59

中欧鼎利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,831,270.93	71,660,118.20	128,491,389.13
本期期初	56,831,270.93	71,660,118.20	128,491,389.13
本期利润	55,215,185.92	103,048,606.23	158,263,792.15
本期基金份额交易产生的变动数	476,922,773.92	670,189,136.54	1,147,111,910.46
其中：基金申购款	881,610,473.04	1,195,233,752.87	2,076,844,225.91
基金赎回款	-404,687,699.12	-525,044,616.33	-929,732,315.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	588,969,230.77	844,897,860.97	1,433,867,091.74

中欧鼎利债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	191,642,593.12	205,372,854.67	397,015,447.79
本期期初	191,642,593.12	205,372,854.67	397,015,447.79
本期利润	149,234,833.85	250,601,646.01	399,836,479.86
本期基金份额交易产生的变动数	1,244,085,904.40	1,505,173,485.89	2,749,259,390.29
其中：基金申购款	2,108,914,597.80	2,466,137,229.82	4,575,051,827.62
基金赎回款	-864,828,693.40	-960,963,743.93	-1,825,792,437.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,584,963,331.37	1,961,147,986.57	3,546,111,317.94

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	304,660.74
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	69,047.80
其他	376,436.52
合计	750,145.06

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	5,204,893,543.71
减：卖出股票成本总额	4,989,323,477.27
减：交易费用	9,116,601.62
买卖股票差价收入	206,453,464.82

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	119,375,435.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	52,261,144.84
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	171,636,580.04

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	3,952,823,166.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,871,741,257.89
减：应计利息总额	28,590,967.28
减：交易费用	229,796.00
买卖债券差价收入	52,261,144.84

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	8,279,432.11
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	8,279,432.11

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	574,423,587.52
股票投资	484,068,066.66
债券投资	90,355,520.86
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	574,423,587.52

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	1,788,624.63
基金转换费收入	295,646.42
合计	2,084,271.05

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	17,852.03

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	40,935.37
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	136,894.77

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
中信银行股份有限公司	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	—	—	29,148,543.94	4.95

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	-	-	243,475,381.68	16.76

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	-	-	174,460,000.00	6.98

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	-	-	-	-
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	12,704.64	4.95	-	-

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	49,464,936.89	3,997,845.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,049,344.99	195,157.34
应支付基金管理人的净管理费	44,415,591.90	3,802,688.20

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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	7,066,419.49	571,120.74

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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			
	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E	合计
国都证券	0.00	1,161.71	0.00	1,161.71
中欧财富	0.00	615.97	0.00	615.97
中欧基金	0.00	2,670,990.23	0.00	2,670,990.23
合计	0.00	2,672,767.91	0.00	2,672,767.91
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			
	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00	0.00
中欧财富	0.00	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	104,851.35	0.00	104,851.35
合计	0.00	104,851.35	0.00	104,851.35

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%，本基金 E 类基金份额不收取销售服务费。

计算方法如下

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付到指定账户。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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	70,615,002.74	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

中欧鼎利债券 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	131,775.45
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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	131,775.45
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00	0.40%

中欧鼎利债券 E

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	130,729.61
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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	130,729.61
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。
- 3、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 A 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

中欧鼎利债券 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	229,752.79	0.00%	—	—

注：1、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。

2、本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类基金份额、E 类基金份额。

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
中信银行股份有限公司	1,891,024.21	304,660.74	20,420,956.43	44,482.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中信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 116,094,770.82 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
260205	26 国开 05	2026 年 7 月 1 日	101.86	1,222,000	124,467,362.41
合计				1,222,000	124,467,362.41

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 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 220,955,000.00 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。本基金在控制风险的基础上, 力争为持有人创造稳定的长期回报。 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，将风险控制可在承受的范围之内。

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	1,165,446,989.59	254,881,996.72
合计	1,165,446,989.59	254,881,996.72

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国债、一般短期融资券。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

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	-	39,494,801.75
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	39,494,801.75

注：本期末基金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	9,538,644,414.02	1,081,916,529.73
AAA 以下	800,910,171.70	391,395,645.96
未评级	5,726,580,111.88	1,057,981,374.88
合计	16,066,134,697.60	2,531,293,550.57

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国债、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	1,891,024.21	-	-	-	1,891,024.21
结算备付金	73,584,024.03	-	-	-	73,584,024.03
存出保证金	2,114,724.80	-	-	-	2,114,724.80
交易性金融资产	1,721,483,892.84	12,980,713,372.36	2,529,384,421.99	3,977,231,535.82	21,208,813,223.01
应收申购款	4,999,000.00	-	-	219,084,830.29	224,083,830.29
应收清算款	-	-	-	53,986,121.95	53,986,121.95
资产总计	1,804,072,665.88	12,980,713,372.36	2,529,384,421.99	4,250,302,488.06	21,564,472,948.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	228,661,035.71	228,661,035.71
应付管理人报酬	-	-	-	10,656,969.82	10,656,969.82
应付托管费	-	-	-	1,522,424.25	1,522,424.25
应付清算款	-	-	-	24,470,373.17	24,470,373.17

卖出回购金融资产款	337,049,770.82	-	-	-	337,049,770.82
应付销售服务费	-	-	-	1,346,306.68	1,346,306.68
应交税费	-	-	-	290,552.81	290,552.81
其他负债	-	-	-	3,772,772.76	3,772,772.76
负债总计	337,049,770.82	-	-	270,720,435.20	607,770,206.02
利率敏感度缺口	1,467,022,895.06	12,980,713,372.36	2,529,384,421.99	3,979,582,052.86	20,956,702,742.27
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	10,235,074.50	-	-	-	10,235,074.50
结算备付金	11,221,370.03	-	-	-	11,221,370.03
存出保证金	343,651.82	-	-	-	343,651.82
交易性金融资产	875,266,088.91	1,633,496,772.49	316,907,487.64	575,001,580.91	3,400,671,929.95
买入返售金融资产	149,095,788.59	-	-	-	149,095,788.59
应收申购款	18,997,000.00	-	-	759,305.99	19,756,305.99
应收清算款	-	-	-	25,247,139.82	25,247,139.82
资产总计	1,065,158,973.85	1,633,496,772.49	316,907,487.64	601,008,026.72	3,616,571,260.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,544,293.75	5,544,293.75
应付管理人报酬	-	-	-	1,849,121.75	1,849,121.75
应付托管费	-	-	-	264,160.25	264,160.25
应付清算款	-	-	-	32,900,116.01	32,900,116.01
卖出回购金融资产款	149,970,418.00	-	-	-	149,970,418.00
应付销售服务费	-	-	-	155,512.44	155,512.44
应交税费	-	-	-	71,377.49	71,377.49
其他负债	-	-	-	554,089.19	554,089.19
负债总计	149,970,418.00	-	-	41,338,670.88	191,309,088.88
利率敏感度缺口	915,188,555.85	1,633,496,772.49	316,907,487.64	559,669,355.84	3,425,262,171.82

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	-168,174,999.21	-18,871,758.32
	利率下降 25BP	172,677,970.55	19,565,975.10

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	3,977,231,535.82	18.98	575,001,580.91	16.79
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	3,977,231,535.82	18.98	575,001,580.91	16.79

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

18.98%（2025 年 12 月 31 日：16.79%），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	4,726,919,230.04	962,956,338.57
第二层次	16,481,893,992.97	2,437,715,591.38
第三层次	—	—
合计	21,208,813,223.01	3,400,671,929.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账

面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	3,977,231,535.82	18.44
	其中：股票	3,977,231,535.82	18.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,231,581,687.19	79.91
	其中：债券	17,231,581,687.19	79.91
	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	75,475,048.24	0.35
8	其他各项资产	280,184,677.04	1.30
9	合计	21,564,472,948.29	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,484,003,122.47	16.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	446,116,672.05	2.13
J	金融业	47,111,741.30	0.22
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	3,977,231,535.82	18.98

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	688256	寒武纪	230,421	367,648,226.55	1.75
2	300308	中际旭创	225,585	286,492,950.00	1.37
3	688008	澜起科技	544,032	168,595,516.80	0.80
4	300502	新易盛	273,595	166,072,165.00	0.79
5	002384	东山精密	499,857	131,137,483.95	0.63
6	688041	海光信息	351,189	130,045,286.70	0.62
7	688981	中芯国际	817,274	129,799,456.68	0.62
8	002353	杰瑞股份	834,079	127,197,047.50	0.61
9	688019	安集科技	370,707	125,840,198.22	0.60
10	300661	圣邦股份	827,358	118,709,325.84	0.57
11	601138	工业富联	1,513,099	109,170,092.85	0.52
12	605196	华通线缆	4,180,000	109,098,000.00	0.52
13	600522	中天科技	1,792,000	108,738,560.00	0.52
14	002938	鹏鼎控股	1,002,069	105,598,031.22	0.50
15	300394	天孚通信	307,860	93,183,064.80	0.44
16	300623	捷捷微电	1,968,200	88,549,318.00	0.42
17	300835	龙磁科技	378,900	86,953,761.00	0.41
18	002126	银轮股份	1,631,300	81,238,740.00	0.39
19	002281	光迅科技	314,100	80,704,854.00	0.39
20	688111	金山办公	368,310	78,468,445.50	0.37
21	300137	先河环保	4,468,420	77,929,244.80	0.37
22	002222	福晶科技	840,928	77,600,835.84	0.37
23	688608	恒玄科技	447,441	74,807,660.79	0.36
24	000338	潍柴动力	2,586,110	70,471,497.50	0.34
25	688396	华润微	709,791	69,240,112.05	0.33
26	600183	生益科技	398,730	69,139,782.00	0.33
27	603067	振华股份	1,490,600	68,999,874.00	0.33

28	003018	金富科技	856,000	65,252,880.00	0.31
29	688630	芯碁微装	118,183	64,928,558.37	0.31
30	605117	德业股份	583,240	61,928,423.20	0.30
31	300373	扬杰科技	389,600	61,256,808.00	0.29
32	600362	江西铜业	1,299,600	56,272,680.00	0.27
33	603256	宏和科技	188,800	50,094,304.00	0.24
34	002916	深南电路	107,900	49,407,410.00	0.24
35	600030	中信证券	1,639,810	47,111,741.30	0.22
36	301338	凯格精机	287,420	46,817,843.80	0.22
37	600584	长电科技	451,000	46,701,050.00	0.22
38	002415	海康威视	1,292,500	44,203,500.00	0.21
39	688390	固德威	352,956	38,299,255.56	0.18
40	002709	天赐材料	697,200	35,856,996.00	0.17
41	600105	永鼎股份	514,000	34,684,720.00	0.17
42	600487	亨通光电	300,400	32,845,736.00	0.16
43	300420	五洋自控	2,205,600	20,864,976.00	0.10
44	300782	卓胜微	175,900	19,275,122.00	0.09

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	688256	寒武纪	321,800,076.11	9.39
2	300308	中际旭创	158,305,307.05	4.62
3	002222	福晶科技	150,389,128.45	4.39
4	605196	华通线缆	144,903,679.00	4.23
5	601138	工业富联	138,679,738.26	4.05
6	688019	安集科技	129,044,980.86	3.77
7	601233	桐昆股份	123,844,602.78	3.62
8	688111	金山办公	119,841,545.00	3.50
9	688981	中芯国际	119,179,973.32	3.48
10	002384	东山精密	109,975,880.96	3.21
11	300137	先河环保	106,821,842.35	3.12
12	688008	澜起科技	106,576,711.82	3.11
13	688041	海光信息	105,791,919.01	3.09
14	002353	杰瑞股份	100,639,853.55	2.94
15	600362	江西铜业	99,999,027.46	2.92
16	300502	新易盛	99,749,727.70	2.91
17	300661	圣邦股份	99,695,995.60	2.91
18	002938	鹏鼎控股	96,670,572.55	2.82
19	300373	扬杰科技	96,655,585.02	2.82
20	600309	万华化学	95,957,575.00	2.80
21	002709	天赐材料	95,846,528.54	2.80
22	002126	银轮股份	95,137,218.63	2.78

23	300394	天孚通信	94,419,186.00	2.76
24	600875	东方电气	88,716,235.00	2.59
25	000811	冰轮环境	85,362,926.87	2.49
26	688608	恒玄科技	83,953,829.81	2.45
27	300623	捷捷微电	83,598,453.81	2.44
28	300835	龙磁科技	83,045,500.50	2.42
29	688691	灿芯股份	79,374,559.91	2.32
30	600482	中国动力	78,697,660.22	2.30
31	688012	中微公司	77,854,990.38	2.27
32	300548	长芯博创	75,621,217.50	2.21
33	000338	潍柴动力	71,408,900.20	2.08
34	002916	深南电路	71,138,933.23	2.08
35	605117	德业股份	70,779,544.08	2.07

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	000811	冰轮环境	158,996,526.20	4.64
2	601233	桐昆股份	120,734,390.67	3.52
3	688012	中微公司	105,028,426.68	3.07
4	600309	万华化学	99,204,914.75	2.90
5	002850	科达利	85,115,279.65	2.48
6	000657	中钨高新	84,794,964.53	2.48
7	600426	华鲁恒升	83,701,096.09	2.44
8	002709	天赐材料	75,085,721.55	2.19
9	688498	源杰科技	73,947,974.06	2.16
10	300620	光库科技	73,417,776.00	2.14
11	688019	安集科技	73,369,537.78	2.14
12	600875	东方电气	70,648,784.23	2.06
13	300274	阳光电源	70,441,605.03	2.06
14	688691	灿芯股份	67,966,027.02	1.98
15	603061	金海通	67,482,981.30	1.97
16	300548	长芯博创	67,070,679.00	1.96
17	688661	和林微纳	66,702,366.25	1.95
18	002487	大金重工	66,606,204.00	1.94
19	601899	紫金矿业	64,314,319.17	1.88
20	000962	东方钨业	63,791,534.14	1.86

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	7,907,485,365.52
卖出股票收入（成交）总额	5,204,893,543.71

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	1,795,233,291.08	8.57
2	央行票据	—	—
3	金融债券	13,911,476,664.08	66.38
	其中：政策性金融债	4,485,745,350.67	21.40
4	企业债券	91,335,653.71	0.44
5	企业短期融资券	50,810,178.08	0.24
6	中期票据	633,038,206.02	3.02
7	可转债（可交换债）	749,687,694.22	3.58
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	17,231,581,687.19	82.22

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	9,500,000	967,626,794.52	4.62
2	232480033	24 建行二级资本债 02A	7,900,000	819,894,335.89	3.91
3	019827	26 国债 01	7,400,000	744,796,619.17	3.55
4	250218	25 国开 18	6,600,000	675,548,515.07	3.22
5	232480061	24 工行二级资本债 01A(BC)	6,400,000	663,417,863.01	3.17

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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。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。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。

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	2,114,724.80
2	应收清算款	53,986,121.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	224,083,830.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	280,184,677.04

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	123241	欧通转债	163,898,975.69	0.78

2	113677	华懋转债	78,053,364.25	0.37
3	113691	和邦转债	71,626,949.99	0.34
4	118030	睿创转债	59,945,221.40	0.29
5	123251	华医转债	43,749,654.35	0.21
6	127089	晶澳转债	39,990,062.59	0.19
7	127103	东南转债	39,537,906.13	0.19
8	127067	恒逸转 2	25,382,280.16	0.12
9	118053	正帆转债	22,812,503.80	0.11
10	111000	起帆转债	17,529,216.17	0.08
11	123263	鼎捷转债	16,509,847.73	0.08
12	123259	锦浪转 02	15,801,724.56	0.08
13	127092	运机转债	15,616,016.71	0.07
14	110095	双良转债	14,314,425.78	0.07
15	123243	严牌转债	13,582,936.45	0.06
16	113692	保隆转债	12,620,193.92	0.06
17	127082	亚科转债	10,705,506.49	0.05
18	127045	牧原转债	9,292,467.18	0.04
19	113647	禾丰转债	8,416,984.49	0.04
20	113648	巨星转债	6,676,743.03	0.03
21	123150	九强转债	5,011,308.83	0.02
22	127072	博实转债	4,363,558.93	0.02
23	113682	益丰转债	2,785,771.60	0.01
24	110087	天业转债	1,053,918.60	0.01
25	123255	鼎龙转债	33,500.33	0.00

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
中欧鼎利 债券 A	5,687	812,214.56	4,559,046,118.85	98.70%	60,018,089.52	1.30%

中欧鼎利债券 C	48,537	58,731.36	2,418,011,488.90	84.82%	432,632,714.15	15.18%
中欧鼎利债券 E	4,181	1,562,485.80	6,527,284,475.49	99.92%	5,468,641.72	0.08%
合计	58,405	239,747.65	13,504,342,083.24	96.44%	498,119,445.39	3.56%

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	中欧鼎利债券 A	1,021,683.30	0.02%
	中欧鼎利债券 C	381,659.25	0.01%
	中欧鼎利债券 E	339.47	0.00%
	合计	1,403,682.02	0.01%

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	中欧鼎利债券 A	0
	中欧鼎利债券 C	0
	中欧鼎利债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧鼎利债券 A	0
	中欧鼎利债券 C	0
	中欧鼎利债券 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧鼎利债券 A	中欧鼎利债券 C	中欧鼎利债券 E
基金合同生效日（2017 年 9 月 18 日）基金份额总额	141,832,319.99	—	—
本报告期期初基金份额总额	1,239,139,757.87	330,224,894.92	937,737,001.96
本报告期基金总申购份额	4,907,804,700.47	4,603,762,189.73	9,353,867,685.55
减：本报告期基金总赎回份额	1,527,880,249.97	2,083,342,881.60	3,758,851,570.30

本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	4,619,064,208.37	2,850,644,203.05	6,532,753,117.21

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

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，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 (%)	
广发证券	1	6,353,563,188.85	48.77	2,769,533.62	48.77	-
华福证券	1	3,489,581,827.35	26.79	1,521,094.87	26.78	-
国盛证券	1	2,746,528,938.63	21.08	1,197,202.68	21.08	-
兴业证券	1	264,305,569.55	2.03	115,211.74	2.03	-
开源证券	1	174,091,453.63	1.34	75,886.28	1.34	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
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 (%)
广发证券	1,343,449,724.11	32.61	3,440,000,000.00	8.49	-	-
华福证券	1,297,916,012.50	31.50	24,008,717,000.00	59.26	-	-
国盛证	1,126,634,2	27.35	12,227,535,0	30.18	-	-

券	50.63		00.00			
兴业证 券	289,351,876 .42	7.02	779,772,000. 00	1.92	-	-
开源证 券	62,405,647. 07	1.51	60,000,000.0 0	0.15	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 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	2026-01-17
2	中欧鼎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	2026-01-17
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“赤峰黄金”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-21
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	中欧鼎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
7	中欧鼎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
8	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
9	中欧鼎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

11	中欧鼎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
12	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