中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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03月13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 6
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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 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 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 41

7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
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 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
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 45
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 45
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 45

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 45
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 本报告期投资基金情况 46
7.13 投资组合报告附注 51

§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
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 53

§9 开放式基金份额变动 53

§10 重大事件揭示 54

10.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
10.8 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 55
10.9 其他重大事件 57

§11 影响投资者决策的其他重要信息 58

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 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 58

§12 备查文件目录 58

12.1 备查文件目录 58
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）	
基金主代码	025218	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年3月13日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,133,675,478.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	025218	025219
报告期末下属分级基金的份额总额	2,592,141,743.71份	2,541,533,734.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。 战略资产配置策略（SAA）是决定基金长期收益率和波动率的关键，也是基金力争实现将基金投资组合长期波动率控制在合适水平这一投资目标的核心。本基金的战略资产配置策略（SAA）将从国内股票和债券市场的风险收益特征出发，通过综合分析宏观政策、经济周期、行业发展趋势、市场流动性水平，投资人风险收益偏好等因素，以分散投资的方式，锚定长期目标波动率，进行有效的长期资产配置。 本基金的战术资产配置策略（TAA）是指会更多着眼于在充分研究分析诸如细分经济周期、各项经济指标、货币政策变化、利率水平、信用利差变化、突发事件性因素等中短期市场变化的基础上，根据具体不同市场形势的具体转变而对基金各类资产组合既定长期投资比例所进行的动态调整，力争使基金投资组合的长期波动率与目标值不发生重大偏离。通过战术资产配置，本基金将在战略资产配置层面实现对长期资产配置的优化，力争获取超额回报。
业绩比较基准	中证纯债债券型基金指数收益率*87%+沪深300指数收益率*8%+MSCI世界指数（MSCI World Index）收益率（使用估值汇率折算）*2%+上海黄金交易所Au99.99 现货实盘合约收益率*3%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基

	金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的证券，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张姗
	联系电话	021-68609600	400-61-95555
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	400-61-95555
传真		021-50190017	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		窦玉明	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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3月13日-2026年6月30日)	
	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C
本期已实现收益	7,549,019.34	4,355,150.44
本期利润	-296,485.20	-3,335,778.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-0.0013

本期加权平均净值利润率	-0.01%	-0.13%
本期基金份额净值增长率	-0.01%	-0.13%
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	-281,481.41	-3,309,615.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0001	-0.0013
期末基金资产净值	2,591,860,262.30	2,538,224,119.24
期末基金份额净值	0.9999	0.9987
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	-0.01%	-0.13%

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。

4、本基金合同自2026年03月13日生效，基金合同生效当期的财务数据和相关指标按实际存续期计算，下同。

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

中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.03%	0.11%	1.34%	0.13%	-1.31%	-0.02%
自基金合同生效起	-0.01%	0.10%	0.73%	0.15%	-0.74%	-0.05%

至今						

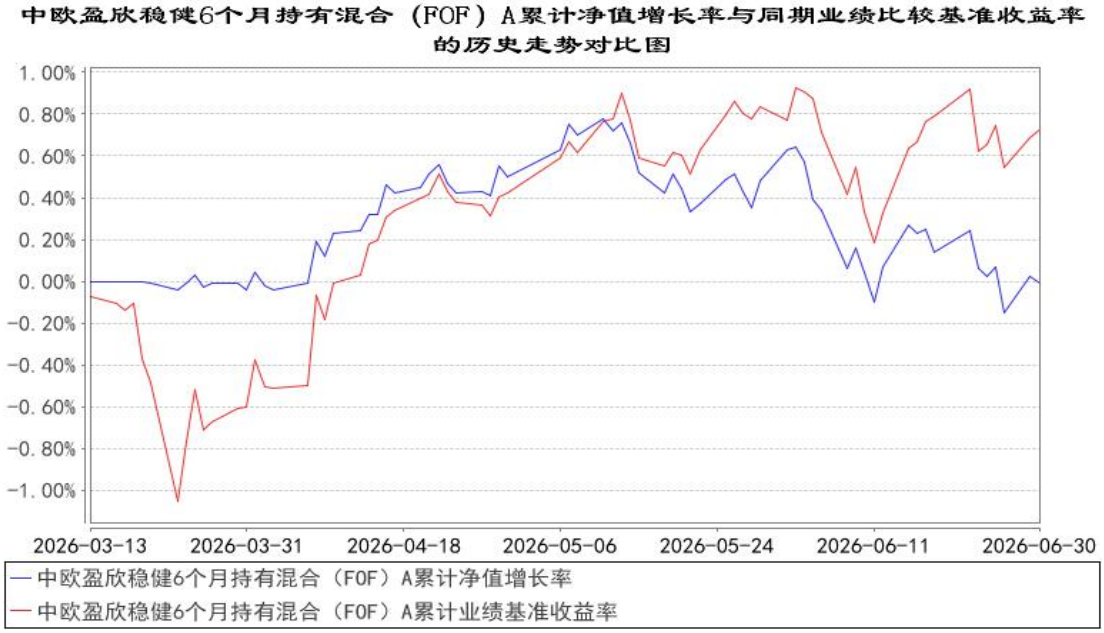
注：本基金业绩比较基准为：中证纯债债券型基金指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*8%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益率*3%+MSCI 世界指数(MSCI WORLD INDEX)收益率(使用估值汇率折算)*2%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧盈欣稳健 6 个月持有混合（FOF）C

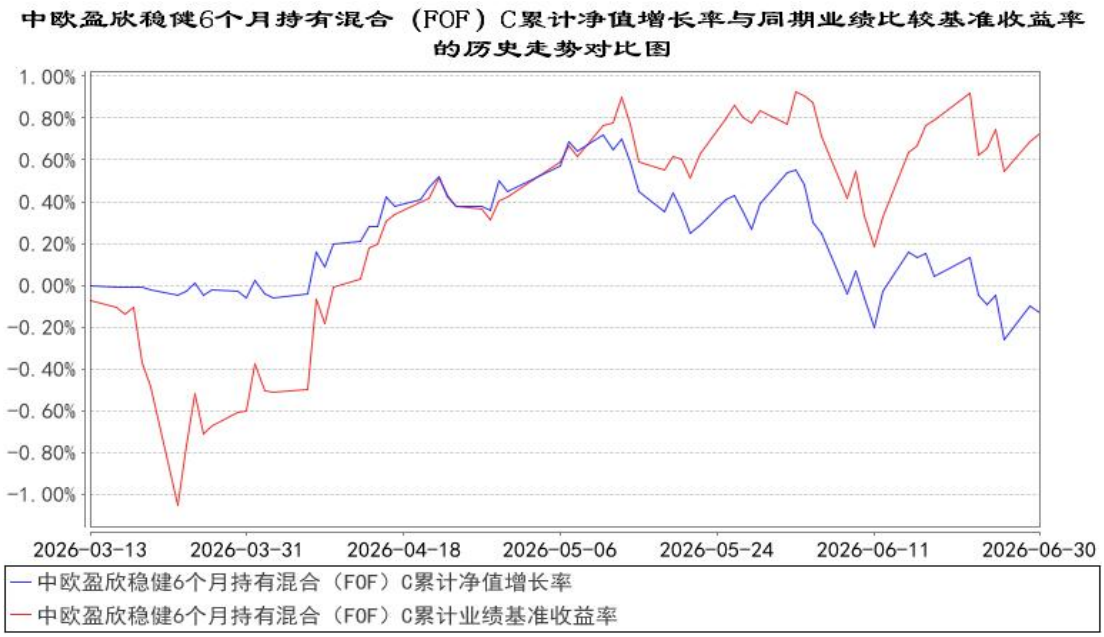
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.07%	0.11%	1.34%	0.13%	-1.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-0.13%	0.10%	0.73%	0.15%	-0.86%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中证纯债债券型基金指数收益率*87%+沪深 300 指数收益率*8%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益率*3%+MSCI 世界指数(MSCI WORLD INDEX)收益率(使用估值汇率折算)*2%。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



注：本基金基金合同生效日期为 2026 年 3 月 13 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。



注：本基金基金合同生效日期为 2026 年 3 月 13 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§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		
邓达	基金经理	2026-03-13	-	13 年	历任中国人寿养老保险股份有限公司年金投资经理助理，平安人寿保险股份有限公司战术投资部传统资产投资团队助理投资经理。2018-06-04 加入中欧基金管理有限

					公司，历任投资经理。

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。

-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本产品的投资目标主要有四个：一是力争在风险适度可控的前提下追求更好的长期复合收益；二是力争为客户获取更加平稳的持有体验；三在充分研究基础上引入更多资产类别改善产品特性；四是保持组合资产的流动性。

2026年上半年国内权益市场宽基指数表现较好，内部分化较大。宽基指数来看，沪深300全收益、偏股混合基金指数的收益率分别为8.6%、18.2%，基金指数表现更强。风格指数来看，高

盈利质量指数、低市盈率指数、中证500全收益、万得双创指数、中证2000全收益的收益率分别为+2.4%、-10.6%、+21.8%、+36.5%、+9.6%。从中信一级行业来看，表现较好是电子（+85.5%）、通信（+74.5%）、建材（+43.7%）、基础化工（+18.6%）、机械（+16.2%），表现较差是消费者服务（-31.9%）、综合金融（-29.6%）、综合（-25.1%）、农林牧渔（-24.8%）、商贸零售（-22.2%）。

结果上来看，上半年30个中信一级行业中仅有5个行业跑赢主要宽基指数，同时各指数的中位数收益和指数收益相比负超额巨大。以沪深300为例，上半年中位数收益为负数。另外一个特征是，瑕疵股的跌幅显著大于龙头公司，尽管估值已较为充分反映瑕疵。

本产品3月发行，在市场回调中稳步提升风险资产。实际运行中来看，二季度、尤其是五六月份，国内权益部分负超额明显放大。我们一方面认真审慎所投品种的基本面和估值面，对确有问题的加以调整；另一方面进一步分散组合、增加龙头、增加指数基金配置，减少风格分化的冲击。

7月以来这一分化和组合负超额都有所收敛。

从纯债投资来说，今年以来特别是信用债走出比较好的行情，信用利差不断压缩，二季度震荡有所放大。本组合债券投资部分配置高等级和中短久期，并寻求类债券资产的配置补充，以有利于组合的抗风险能力。

商品投资方面，黄金震荡走弱，其他商品也有所回调，我们保持黄金低配，并保持其他商品一定的配置力度，坚持多元资产的配置定位。

海外权益投资方面，今年各指数表现有所差异，我们主要投资于不同的美股ETF并动态调整，7月份以来增加对非美国市场的投资。

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-0.01%，同期业绩比较基准收益率为0.73%；基金C类份额净值增长率为-0.13%，同期业绩比较基准收益率为0.73%。

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2026年下半年，我们一方面将继续优化组合配置，尤其是国内权益、债券、商品的配置，力求保持组合平稳。

其他本年度的计划工作仍将稳步推进：一是，积极等待长端收益率逐步进入战略配置区域；二是，改进基金研究、加大配置力度；三，挖掘其他另类资产；四，改进债券基金的杠杆配置水平。

关于大类资产当前的配置价值以及本组合的运行前景，我们认为风险和机遇并存。风险点是，国内债券相对位置较高，收益率上行和下行空间非对称，对于高比例投资固收类资产的产品来说，

始终是我们持续关注的核心风险点之一；机遇是，国内价值和质量蓝筹的投资价值接近历史较好位置，国内的经济先行指标离企稳越来越近，同时科技成长板块经过7月份的回调配置价值有所上升；中性因素是，豆粕、能源、黄金、海外权益配置价值仍在。

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

本基金本报告期未进行利润分配，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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。 招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	298,390,413.65
结算备付金		6,076,088.84
存出保证金		347,623.37
交易性金融资产	6.4.7.2	4,832,356,654.83
其中：股票投资		184,693,572.79
基金投资		4,389,701,766.51
债券投资		257,961,315.53
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		520,777.92
应收股利		782,523.84
应收申购款		154,464.36
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.5	6,575.61
资产总计		5,138,635,122.42
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026年6月30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		-
应付清算款		4,749,700.66
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,020,387.83
应付托管费		631,531.95
应付销售服务费		836,022.75
应付投资顾问费		-
应交税费		27,904.26
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	285,193.43
负债合计		8,550,740.88
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	5,133,675,478.58
未分配利润	6.4.7.8	-3,591,097.04
净资产合计		5,130,084,381.54
负债和净资产总计		5,138,635,122.42

注：1.报告截止日2026年06月30日，基金份额总额5,133,675,478.58份，其中下属A类基金份额净值为人民币0.9999元，基金份额总额2,592,141,743.71份；下属C类基金份额净值为人民币0.9987元，基金份额总额2,541,533,734.87份。

2.本基金基金合同于2026年03月13日生效，故无上年度可比区间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
一、营业总收入		9,311,998.61
1.利息收入		824,097.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	599,142.80
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		224,954.25
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,012,424.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,416,335.82
基金投资收益	6.4.7.11	8,659,955.97
债券投资收益	6.4.7.12	864,990.84
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	19,903,813.02
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）	6.4.7.16	-15,536,433.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,911.46
减：二、营业总支出		12,944,262.74
1．管理人报酬		7,516,767.53
2．托管费		2,296,700.46
3．销售服务费		3,037,897.68
4．投资顾问费		-
5．利息支出		5,897.43
其中：卖出回购金融资产支出		5,897.43
6．信用减值损失	6.4.7.19	-
7．税金及附加		30,036.72
8．其他费用	6.4.7.20	56,962.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,632,264.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,632,264.13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-3,632,264.13

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）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				
二、本期期初净资产	5,125,154,276.36	-	-	5,125,154,276.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,521,202.22	-	-3,591,097.04	4,930,105.18
（一)、综合收益总额	-	-	-3,632,264.13	-3,632,264.13
（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）	8,521,202.22	-	41,167.09	8,562,369.31
其中：1.基金申购款	8,521,202.22	-	41,167.09	8,562,369.31
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	5,133,675,478.58	-	-3,591,097.04	5,130,084,381.54

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

中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2025]1478号《关于准予中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金(FOF)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《中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金(FOF)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5,124,361,536.12元，经向中国证监会备案，《中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2026年3月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,125,154,276.36份基金份额，其中包含认购资金利息折合792,740.24份基金份额。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年3月13日(基金合同生效日)至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年3月13日(基金合同生效日)至2026年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、

买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2)金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其

他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代

扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费按照权责发生制原则在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式

的，红利再投资的份额免收申购费；

(2)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(4)因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的锁定持有期；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《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》(中国证

监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定， 对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[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]127号《财政部国家税务总局证监会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》、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。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	298,390,413.65

等于：本金	298,365,940.23
加：应计利息	24,473.42
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	298,390,413.65

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		213,688,972.36	-	184,693,572.79	-28,995,399.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	256,270,497.00	1,430,645.53	257,961,315.53	260,173.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	256,270,497.00	1,430,645.53	257,961,315.53	260,173.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		4,376,502,973.85	-	4,389,701,766.51	13,198,792.66
其他		-	-	-	-
合计		4,846,462,443.21	1,430,645.53	4,832,356,654.83	-15,536,433.91

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应收利息	-
其他应收款	6,575.61
待摊费用	-
合计	6,575.61

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	232,063.43
其中：交易所市场	232,063.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	15,714.60
预提费用-信息披露费	37,415.40
合计	285,193.43

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A

项目	本期 2026年3月13日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,589,367,128.45	2,589,367,128.45
本期申购	2,774,615.26	2,774,615.26
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,592,141,743.71	2,592,141,743.71

中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C

项目	本期 2026年3月13日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,535,787,147.91	2,535,787,147.91
本期申购	5,746,586.96	5,746,586.96
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,541,533,734.87	2,541,533,734.87

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同于2026年03月13日生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,125,154,276.36份基金份额，其中认购资金利息折合792,740.24份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	7,549,019.34	-7,845,504.54	-296,485.20
本期基金份额交易产生的变动数	3,596.07	11,407.72	15,003.79
其中：基金申购款	3,596.07	11,407.72	15,003.79
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,552,615.41	-7,834,096.82	-281,481.41

中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,355,150.44	-7,690,929.37	-3,335,778.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,153.55	24,009.75	26,163.30
其中：基金申购款	2,153.55	24,009.75	26,163.30
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,357,303.99	-7,666,919.62	-3,309,615.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
活期存款利息收入	588,443.64
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	10,483.70
其他	215.46
合计	599,142.80

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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出股票成交总额	190,374,033.31
减：卖出股票成本总额	195,277,898.41
减：交易费用	512,470.72
买卖股票差价收入	-5,416,335.82

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	810,751,931.68
减：卖出/赎回基金成本总额	801,810,157.50
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	224,247.68
减：交易费用	57,570.53
基金投资收益	8,659,955.97

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	864,990.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	864,990.84

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,173,190.39
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	16,730,622.63
合计	19,903,813.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-15,536,433.91
股票投资	-28,995,399.57
债券投资	260,173.00
资产支持证券投资	-
基金投资	13,198,792.66
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	-15,536,433.91

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	11,911.46
合计	11,911.46

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	16,308.75

当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,782,087.63
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,043,531.67

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费及托管费等进行的估算，上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	15,714.60
信息披露费	37,415.40
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,665.11
开户费	400.00
证券组合费	767.81
合计	56,962.92

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
招商银行股份有限公司	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
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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国都证券	112,693,078.32	18.80

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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国都证券	256,810,201.61	100.00

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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
国都证券	3,700,000,000.00	95.98

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
国都证券	959,792,781.20	44.33

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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3月13日（基金合同生效日）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	49,121.60	18.27	33,043.12	14.24

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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,516,767.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,559,259.65
应支付基金管理人的净管理费	2,957,507.88

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E 取0

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,296,700.46

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 3 月 13 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧盈欣稳健 6 个月持有混合（FOF）A	中欧盈欣稳健 6 个月持有混合（FOF）C	合计
招商银行股份有限公司	-	3,037,860.62	3,037,860.62
合计	-	3,037,860.62	3,037,860.62

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×0.40%÷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

销售服务费每日计提。

（1）基金管理人直销渠道：

对于基金份额收取的销售服务费,在投资者赎回基金份额或基金合同终止时,随赎回款(或清算款)一并返还给投资者。

基金销售子公司销售母公司所管理基金的，按照本条要求执行。

（2）代销渠道：

对于投资者持续持有期限未超过一年（即 365 天，下同）的基金份额收取的销售服务费，逐日累计至每月月末，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款指令，基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中按照指定的账户路径一次性支付给基金管理人并

由基金管理人代付给各基金销售机构。

对于持续持有期限超过一年的基金份额继续收取的销售服务费,在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。其中，持续持有期限为合同生效日（针对募集期内认购的基金份额）或该笔份额申购、转入确认日与赎回、转出确认日或基金合同终止情形发生日下一工作日的间隔天数。

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

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金各类基金份额。

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3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	298,390,413.65	588,443.64

注：本基金的银行存款由基金托管人招商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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人中欧基金管理有限公司所管理的基金合计人民币

940,208,875.11元。占本基金资产净值的比例为18.33%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2026年3月13日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	11,911.46
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,342,084.90
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	294,399.29

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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，本基金无因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。

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为混合型基金中基金(FOF)，风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。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。本基金是基金中基金,灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产,在严格控制投资组合风险的前提下,寻求基金资产的长期稳健增值。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的检查和反馈。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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同

业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 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于约定开放日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于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2026年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约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、公开募集的证券投资基金、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，证券投资基金可在基金销售机构申购、赎回，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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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	298,390,413.65	-	-	-	298,390,413.65
结算备付金	6,076,088.84	-	-	-	6,076,088.84
存出保证金	347,623.37	-	-	-	347,623.37
交易性金融资产	257,961,315.53	-	-	4,574,395,339.30	4,832,356,654.83
应收股利	-	-	-	782,523.84	782,523.84
应收申购款	-	-	-	154,464.36	154,464.36
应收清算款	-	-	-	520,777.92	520,777.92
其他资产	-	-	-	6,575.61	6,575.61
资产总计	562,775,441.39	-	-	4,575,859,681.03	5,138,635,122.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,020,387.83	2,020,387.83
应付托管费	-	-	-	631,531.95	631,531.95
应付清算款	-	-	-	4,749,700.66	4,749,700.66
应付销售服务费	-	-	-	836,022.75	836,022.75
应交税费	-	-	-	27,904.26	27,904.26
其他负债	-	-	-	285,193.43	285,193.43
负债总计	-	-	-	8,550,740.88	8,550,740.88
利率敏感度缺口	562,775,441.39	-	-	4,567,308,940.15	5,130,084,381.54

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

于2026年6月30日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为5.03%，因此市

场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	32,957,659.00	-	32,957,659.00
应收股利	-	782,523.84	-	782,523.84
资产合计	-	33,740,182.84	-	33,740,182.84
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	-	33,740,182.84	-	33,740,182.84

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）
	港币相对人民币贬值5%	-1,687,009.14
	港币相对人民币升值5%	1,687,009.14

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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金及证券交

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	184,693,572.79	3.60
交易性金融资产－基金投资	4,389,701,766.51	85.57
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	4,574,395,339.30	89.17

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	业绩比较基准上升5%	116,683,103.48
	业绩比较基准下降5%	-116,683,103.48

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
第一层次	4,574,395,339.30
第二层次	257,961,315.53
第三层次	-
合计	4,832,356,654.83

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	184,693,572.79	3.59
	其中：股票	184,693,572.79	3.59

2	基金投资	4,389,701,766.51	85.43
3	固定收益投资	257,961,315.53	5.02
	其中：债券	257,961,315.53	5.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	304,466,502.49	5.93
8	其他各项资产	1,811,965.10	0.04
9	合计	5,138,635,122.42	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32,957,659.00元，占基金资产净值比例0.64%。

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	14,393,211.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	79,271,946.00	1.55
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	19,230,946.69	0.37
J	金融业	27,369,179.10	0.53
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	11,470,631.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	151,735,913.79	2.96

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	-	-
消费者非必需品	12,152,219.00	0.24
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	10,829,840.00	0.21
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	9,975,600.00	0.19
合计	32,957,659.00	0.64

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	001328	登康口腔	896,400	23,225,724.00	0.45
2	601825	沪农商行	2,455,500	18,391,695.00	0.36
3	300750	宁德时代	43,500	17,095,935.00	0.33
4	300761	立华股份	877,100	14,393,211.00	0.28
5	601801	皖新传媒	2,326,700	11,470,631.00	0.22
6	00038	第一拖拉机股份	1,864,000	10,829,840.00	0.21
7	688188	柏楚电子	101,447	10,824,394.90	0.21
8	02869	绿城服务	2,934,000	9,975,600.00	0.19
9	600031	三一重工	540,500	9,339,840.00	0.18
10	000333	美的集团	123,500	9,327,955.00	0.18
11	601077	渝农商行	1,469,310	8,977,484.10	0.17
12	688095	福昕软件	141,453	8,406,551.79	0.16
13	600328	中盐化工	1,163,900	6,983,400.00	0.14
14	000951	中国重汽	353,500	6,896,785.00	0.13
15	09988	阿里巴巴-W	82,100	6,620,544.00	0.13
16	02331	李宁	432,500	5,531,675.00	0.11
17	002233	塔牌集团	634,100	4,419,677.00	0.09
18	000528	柳 工	262,600	1,982,630.00	0.04

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)

1	601825	沪农商行	42,161,658.82	0.82
2	688188	柏楚电子	36,681,992.93	0.72
3	001328	登康口腔	33,010,224.88	0.64
4	000333	美的集团	24,405,581.40	0.48
5	601801	皖新传媒	23,886,312.49	0.47
6	300750	宁德时代	22,244,053.00	0.43
7	09988	阿里巴巴-W	21,510,267.71	0.42
8	688095	福昕软件	21,306,439.71	0.42
9	300761	立华股份	20,992,678.00	0.41
10	600328	中盐化工	20,469,253.80	0.40
11	00038	第一拖拉机股份	15,553,488.68	0.30
12	601077	渝农商行	14,220,755.20	0.28
13	688120	华海清科	12,989,977.90	0.25
14	600031	三一重工	11,329,525.00	0.22
15	02869	绿城服务	10,732,608.07	0.21
16	000528	柳 工	10,470,879.00	0.20
17	01313	华润建材科技	9,456,189.41	0.18
18	600519	贵州茅台	7,952,831.00	0.16
19	09660	地平线机器人-W	7,785,657.72	0.15
20	02331	李宁	7,272,424.61	0.14

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688188	柏楚电子	27,585,401.99	0.54
2	601825	沪农商行	19,316,388.00	0.38
3	000333	美的集团	16,055,518.00	0.31
4	688120	华海清科	15,541,236.36	0.30
5	688095	福昕软件	10,741,933.86	0.21
6	09988	阿里巴巴-W	9,497,389.97	0.19
7	601801	皖新传媒	9,246,790.80	0.18
8	600328	中盐化工	8,486,187.00	0.17
9	01313	华润建材科技	8,421,056.53	0.16
10	600519	贵州茅台	7,561,183.00	0.15
11	000528	柳 工	7,044,756.00	0.14
12	09660	地平线机器人-W	6,919,499.13	0.13
13	600985	淮北矿业	6,025,780.00	0.12
14	001328	登康口腔	5,529,698.72	0.11
15	01024	快手-W	5,274,448.73	0.10
16	300750	宁德时代	4,547,383.00	0.09

17	601077	渝农商行	4,098,915.00	0.08
18	300761	立华股份	4,046,203.00	0.08
19	000529	广弘控股	4,033,435.00	0.08
20	300502	新易盛	3,767,772.00	0.07

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	408,966,870.77
卖出股票收入（成交）总额	190,374,033.31

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	257,961,315.53	5.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	257,961,315.53	5.03

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	019827	26国债01	2,563,000	257,961,315.53	5.03

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006591	广发景明中短债A	契约型开放式	501,500,595.90	515,442,312.47	10.05	否
2	007529	嘉实汇鑫中短债债券A	契约型开放式	421,947,389.48	464,775,049.51	9.06	否
3	511360	海富通中证短融ETF	交易	4,075,700.00	463,040,277.00	9.03	否

			型开放式				
4	006829	鹏扬利沣短债A	契约型开放式	329,181,291.93	359,564,725.18	7.01	否
5	001164	中欧琪和灵活配置混合A	契约型开放式	245,873,372.54	339,133,142.74	6.61	是
6	019929	广发中债0-2年政金债指数A	契约型开放式	296,384,578.31	309,721,884.33	6.04	否
7	007169	易方达中债1-3年国开行债券指数A	契约型开放式	304,923,535.05	309,070,495.13	6.02	否
8	009593	国泰中债1-3年国开债A	契约型开放式	251,278,824.32	258,967,956.34	5.05	否
9	002920	中欧短债债券A	契约型	232,558,139.53	251,418,604.65	4.90	是

			开放式				
10	003280	鹏华丰恒债券A	契约型开放式	223,690,386.58	244,180,425.99	4.76	否
11	020589	景顺长城睿丰短债债券F	契约型开放式	141,401,156.92	154,636,305.21	3.01	否
12	002592	中欧纯债债券(LOF)E	契约型开放式	114,000,361.81	129,504,411.02	2.52	是
13	016850	中欧颐利债券A	契约型开放式	91,174,648.14	101,231,211.83	1.97	是
14	159985	华夏饲料豆粕期货ETF	交易型开放式	43,678,200.00	86,701,227.00	1.69	否
15	002961	中欧双利债券A	契约型开	46,894,282.19	57,318,881.12	1.12	是

			放式				
16	010678	中欧均衡成长混合A	契约型开放式	52,785,354.94	51,291,529.40	1.00	是
17	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式	9,389,700.00	47,126,904.30	0.92	否
18	513400	道琼斯ETF	交易型开放式	33,331,298.00	43,564,006.49	0.85	否
19	512880	国泰中证全指证券公司ETF	交易型开放式	38,467,800.00	43,314,742.80	0.84	否
20	510310	易方达沪深300ETF	交易型开放式	5,992,758.00	29,244,659.04	0.57	否
21	159577	汇添富MSCI美国50ETF	交易型开放	14,380,000.00	22,375,280.00	0.44	否

			式				
22	159632	华安纳斯达克100ETF(QDII)	交易型开放式	6,740,200.00	16,587,632.20	0.32	否
23	513080	华安法国CAC40ETF	交易型开放式	8,849,100.00	15,485,925.00	0.30	否
24	159915	易方达创业板ETF	交易型开放式	3,322,100.00	14,497,644.40	0.28	否
25	508068	华夏北京保障房REIT	契约型封闭式	3,441,231.00	13,740,835.38	0.27	否
26	010679	中欧均衡成长混合C	契约型开放式	11,094,355.88	10,311,094.35	0.20	是
27	159937	博时黄金ETF	交易型开放	1,229,100.00	10,264,214.10	0.20	否

			式				
28	180501	红土创新深圳安居REIT	契约型封闭式	2,982,952.00	10,112,207.28	0.20	否
29	260101	景顺长城优选混合	契约型开放式	1,607,102.60	8,990,774.79	0.18	否
30	006049	恒越研究精选混合A/B	契约型开放式	2,505,261.10	4,325,082.76	0.08	否
31	159650	博时中债0-3年国开行ETF	交易型开放式	34,900.00	3,762,324.70	0.07	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

合计持有数量（只）	合计持有份额（份）	合计公允价值（元）	合计占基金资产净值比例（%）
2	6,424,183.00	23,853,042.66	0.46

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	347,623.37
2	应收清算款	520,777.92
3	应收股利	782,523.84
4	应收利息	-
5	应收申购款	154,464.36
6	其他应收款	6,575.61
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,811,965.10

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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。

7.13.6 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
中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	10,441	248,265.66	54,974,983.59	2.12%	2,537,166,760.12	97.88%
中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C	10,546	240,995.04	19,077,596.39	0.75%	2,522,456,138.48	99.25%
合计	20,987	244,612.16	74,052,579.98	1.44%	5,059,622,898.60	98.56%

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	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	19,920.32	0.00%
	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C	10,000.00	0.00%
	合计	29,920.32	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	0
	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）A	0
	中欧盈欣稳健6个月持有混合（FOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧盈欣稳健6个月持有混合(FOF)A	中欧盈欣稳健6个月持有混合(FOF)C
基金合同生效日（2026年3月13日）基金份额总额	2,589,367,128.45	2,535,787,147.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,774,615.26	5,746,586.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,592,141,743.71	2,541,533,734.87

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的基金未发生重大影响事项。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.8 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

10.8.1 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(%)	
国泰海通	1	263,403,420.46	43.95	121,674.61	45.27	-
浙商证券	1	193,548,958.04	32.29	84,363.60	31.38	-
国都证券	1	112,693,078.32	18.80	49,121.60	18.27	-
长江证券	2	29,695,447.26	4.95	13,645.08	5.08	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证	成交金额	占当期基金成交总额的

				额的比例(%)		成交总额的比例(%)		比例(%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-	294,391,425.63	13.60
浙商证券	-	-	155,000,000.00	4.02	-	-	819,743,147.82	37.86
国都证券	256,810,201.61	100.00	3,700,000,000.00	95.98	-	-	959,792,781.20	44.33
长江证券	-	-	-	-	-	-	91,417,269.20	4.22
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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。

10.9 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	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2026-01-06
2	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-06
3	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2026-01-06
4	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会指定媒介	2026-01-06
5	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会指定媒介	2026-01-06
6	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	中国证监会指定媒介	2026-01-06

7	中欧基金管理有限公司关于中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集规模上限的公告	中国证监会指定媒介	2026-02-14
8	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-11
9	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2026-03-14
10	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
11	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）2026年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-15
12	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
13	中欧盈欣稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-05-07
14	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 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

无。

§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