

中欧多元平衡混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52

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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 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	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧多元平衡混合型证券投资基金	
基金简称	中欧多元平衡混合	
基金主代码	025828	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 5 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额	259,560,910.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧多元平衡混合 A	中欧多元平衡混合 C
下属分级基金的交易代码	025828	025829
报告期末下属分级基金的份额总额	109,314,603.49 份	150,246,307.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置,确定股票、债券、现金等资产的投资比例,重点通过跟踪宏观经济数据(包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等)和政策环境的变化趋势,来做前瞻性的战略判断。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*45%+中证港股通综合指数收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金如投资港股通标的股票,还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	刘晴川
	联系电话	021-68609600	010-65051166
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	AC_Product@cicc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	-
传真		021-50190017	010-65059873
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区陆	北京市朝阳区建国门外大街 1 号

	家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码	200120	100004
法定代表人	窦玉明	陈亮

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧多元平衡混合 A	中欧多元平衡混合 C
本期已实现收益	1,873,175.74	4,355,437.49
本期利润	-2,821,453.02	-1,699,537.44
加权平均基金份 额本期利润	-0.0193	-0.0058
本期加权平均净 值利润率	-1.92%	-0.58%
本期基金份额净 值增长率	-2.92%	-3.11%
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	-3,657,189.76	-5,285,755.10
期末可供分配基 金份额利润	-0.0335	-0.0352
期末基金资产净 值	105,657,413.73	144,960,552.37
期末基金份额净	0.9665	0.9648

值		
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	-2.75%	-2.97%

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

中欧多元平衡混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.98%	0.58%	5.90%	0.67%	-7.88%	-0.09%
过去六个月	-2.92%	0.51%	4.72%	0.62%	-7.64%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-2.75%	0.48%	6.16%	0.59%	-8.91%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率(税后)*50%+中证 A500 指数收益率*45%+中证港股通综合指数收益率*5%。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。

中欧多元平衡混合 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	-2.07%	0.58%	5.90%	0.67%	-7.97%	-0.09%
过去六个月	-3.11%	0.52%	4.72%	0.62%	-7.83%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-2.97%	0.48%	6.16%	0.59%	-9.13%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率(税后)*50%+中证 A500 指数收益率*45%+中证港股

通综合指数收益率*5%。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

中欧多元平衡混合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：本基金基金合同生效日期为 2025 年 12 月 5 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已经符合基金合同约定。

中欧多元平衡混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 12 月 5 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

已经符合基金合同约定。

§ 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		
张学明	基金经理	2025-12-05	-	9 年	历任成都银行股份有限公司中台风控研究岗，中泰证券（上海）资产管理有限公司对冲基金部副总经理，上海艾方资产管理有限公司反脆弱投资部总监、投资经理。2023-04-24 加入中欧基金管理有限公司，历任高级研究员。

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。

-

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

多元平衡产品的配置理念可以总结为三点：一是价值策略打底，红利景气杠铃配置，追求权益端的高夏普；二是衍生品控制风险，追求尾部风险管理；三是低估值转债作为债券替代。

产品在一季度处于建仓期，且打开是在指数快速上涨之后，因此产品在坚持配置理念的基础上，主要的动作就是“控制风险”和“找机会”。

控制风险体现在：产品建仓期打开可能面临仓位被动上升，因此我们在配置上对价值、红利类策略更加倾斜，同时衍生品的空头头寸也更加积极。找机会体现在：3 月份市场的持续下跌给予我们调整配置结构的机会，产品在下跌过程中迅速回到基准配置，我们把进攻性的景气仓位调整到了基准比例，同时降低衍生品的头寸，产品也较快完成净值修复。

二季度市场环境出现明显变化，配置结构承受了调整压力。“红利、价值”类策略是长期高夏普的策略，很多以长期绝对收益为目标的投资者几乎都以价值、红利类策略打底仓，我们也不例外，但市场上所有“红利、价值”类策略几乎都遭遇了历史最大回撤，令不少配置者“始料未及”。景气表现尚可，但不足以弥补价值类回撤；而转债长期处于高位，我们在 4 月找到一波低估值转债回归机会，其他时候几乎没有仓位。受多方面因素共同影响，组合整体收益承压。

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-2.92%，同期业绩比较基准收益率为 4.72%；基金 C 类份额净值增长率为-3.11%，同期业绩比较基准收益率为 4.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们依然相信红利和价值策略的长期表现。第一，回看历史，红利策略在股息率不够高的市场环境下容易发生年度亏损，只要股息率足够高，红利策略每年实现绝对收益率的概率较高，这个策略当前的配置价值很高。

第二，回顾历史，每次宏大叙事的开展往往都会伴随价值类策略的表现不佳，但每次叙事的结束往往也都是价值策略新一轮表现的开始，所以对于价值策略来说，或许已经很接近下一个表现周期的开始了。因此，未来这个产品很大程度上依赖价值类策略的回归，而我们也根据策略的信号做了一定程度的超配。

在操作层面，产品会按照系统化多策略的配置框架进行配置，依靠规则执行衍生品的头寸，这个步骤的核心是控制风险；同时，我们的策略研究团队会持续对策略的 alpha 进行迭代，在策略的基础上力争提供更高的收益，策略的择时仓位信号也在持续迭代过程中。当我们可以较好地控制风险时，之后的工作就是在整体结构不变的情况下，尽可能提高收益，获取更高的风险收益比。而转债策略，需要等到一波估值的调整，我们或能找到不少低估的转债。

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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧多元平衡混合型证券投资基金

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	23,951,800.43	334,897,919.36
结算备付金		5,174,559.94	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	221,641,967.52	340,917,786.08
其中：股票投资		132,123,164.15	93,694,800.56
基金投资		—	—

债券投资		89,518,803.37	247,222,985.52
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		—	—
应收股利		52,718.01	—
应收申购款		952,810.65	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		251,773,856.55	675,815,705.44
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		—	—
应付清算款		43,826.55	—
应付赎回款		702,393.90	—
应付管理人报酬		224,091.02	480,264.94
应付托管费		44,818.23	96,052.99
应付销售服务费		51,824.03	139,977.41
应付投资顾问费		—	—
应交税费		2,240.99	4,200.39
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	86,695.73	8,265.24
负债合计		1,155,890.45	728,760.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	259,560,910.96	674,102,904.45
未分配利润	6.4.7.8	-8,942,944.86	984,040.02
净资产合计		250,617,966.10	675,086,944.47
负债和净资产总计		251,773,856.55	675,815,705.44

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 259,560,910.96 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 0.9665 元，基金份额总额 109,314,603.49 份；下属 C 类基金份额净值为人民币

0.9648 元，基金份额总额 150,246,307.47 份。

2. 本基金基金合同于 2025 年 12 月 05 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧多元平衡混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-1,187,569.49
1. 利息收入		61,661.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	61,661.57
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,154,864.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,245,453.05
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,368,544.34
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	1,694,809.82
股利收益	6.4.7.14	1,846,056.80
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	-10,749,603.69
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	345,508.62
减：二、营业总支出		3,333,420.97
1. 管理人报酬		2,207,378.70
2. 托管费		441,475.71
3. 销售服务费		589,373.20
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		10,179.96
8. 其他费用	6.4.7.18	85,013.40

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,520,990.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,520,990.46
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,520,990.46

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧多元平衡混合型证券投资基金

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	674,102,904.45	-	984,040.02	675,086,944.47
二、本期期初净资产	674,102,904.45	-	984,040.02	675,086,944.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-414,541,993.49	-	-9,926,984.88	-424,468,978.37
（一）、综合收益总额	-	-	-4,520,990.46	-4,520,990.46
（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）	-414,541,993.49	-	-2,776,890.83	-417,318,884.32
其中：1. 基金申购款	90,116,020.80	-	638,845.89	90,754,866.69
2. 基金赎回款	-504,658,014.29	-	-3,415,736.72	-508,073,751.01
（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）	-	-	-2,629,103.59	-2,629,103.59
四、本期期末净资产	259,560,910.96	-	-8,942,944.86	250,617,966.10

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

基金管理人负责人

王音然

主管会计工作负责人

李宝林

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧多元平衡混合型证券投资基金(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[2025]1739号《关于准予中欧多元平衡混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧多元平衡混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币673,954,716.05元,经向中国证监会备案,《中欧多元平衡混合型证券投资基金基金合同》于2025年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为674,102,904.45份基金份额,其中包含认购资金利息折合148,188.40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1月1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1月1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，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)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金于每月度最后一个交易日(以下简称“评价日”)对基金的可供分配利润进行评价，评价日核定的每份基金份额可供分配利润高于 0 元时，基金管理人将进行收益分配。对于非评价日，当核定的每份基金份额可供分配利润高于 0.01 元(含)时，基金管理人可根据实际情况决定是否进行收益分配。

具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2)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按除权日的该类基金份额净值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；

(3)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；

(4)由于本基金各类基金份额收取的费用不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(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	20,085.54
等于：本金	20,000.00
加：应计利息	85.54
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	23,931,714.89
等于：本金	23,931,306.11
加：应计利息	408.78
减：坏账准备	—
合计	23,951,800.43

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		141,915,270.08	-	132,123,164.15	-9,792,105.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	88,299,627.81	1,262,999.27	89,518,803.37	-43,823.71
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	88,299,627.81	1,262,999.27	89,518,803.37	-43,823.71
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		230,214,897.89	1,262,999.27	221,641,967.52	-9,835,929.64

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	22.74
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	63,672.96
预提费用-审计费	17,852.03

其他应付	5,148.00
合计	86,695.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧多元平衡混合 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	182,901,682.88	182,901,682.88
本期申购	48,476,450.20	48,476,450.20
本期赎回（以“-”号填列）	-122,063,529.59	-122,063,529.59
本期末	109,314,603.49	109,314,603.49

中欧多元平衡混合 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	491,201,221.57	491,201,221.57
本期申购	41,639,570.60	41,639,570.60
本期赎回（以“-”号填列）	-382,594,484.70	-382,594,484.70
本期末	150,246,307.47	150,246,307.47

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

中欧多元平衡混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	57,084.53	247,941.34	305,025.87
本期期初	57,084.53	247,941.34	305,025.87
本期利润	1,873,175.74	-4,694,628.76	-2,821,453.02
本期基金份额交易产生的变动数	-589,114.42	378,803.88	-210,310.54
其中：基金申购款	334,700.07	-90,385.66	244,314.41
基金赎回款	-923,814.49	469,189.54	-454,624.95
本期已分配利润	-930,452.07	-	-930,452.07
本期末	410,693.78	-4,067,883.54	-3,657,189.76

中欧多元平衡混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,281.44	665,732.71	679,014.15
本期期初	13,281.44	665,732.71	679,014.15
本期利润	4,355,437.49	-6,054,974.93	-1,699,537.44
本期基金份额交易产生的变动数	-2,373,709.99	-192,870.30	-2,566,580.29
其中：基金申购款	358,505.10	36,026.38	394,531.48

基金赎回款	-2,732,215.09	-228,896.68	-2,961,111.77
本期已分配利润	-1,698,651.52	-	-1,698,651.52
本期末	296,357.42	-5,582,112.52	-5,285,755.10

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	16,142.64
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	24,947.45
结算备付金利息收入	20,571.48
其他	-
合计	61,661.57

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	777,621,624.77
减：卖出股票成本总额	773,140,523.89
减：交易费用	1,235,647.83
买卖股票差价收入	3,245,453.05

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	1,454,379.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	914,165.12
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	2,368,544.34

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	260,450,902.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	257,962,234.71

本总额	
减：应计利息总额	1,566,553.77
减：交易费用	7,948.55
买卖债券差价收入	914,165.12

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,694,809.82

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	1,846,056.80
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	1,846,056.80

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	-10,749,603.69
股票投资	-10,598,260.57
债券投资	-151,343.12
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	-10,749,603.69

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	345,064.52
基金转换费收入	444.10
合计	345,508.62

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	55,407.72
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,874.87
账户维护费	4,500.00
证券组合费	378.78
合计	85,013.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人
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
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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	2,207,378.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	744,623.58
应支付基金管理人的净管理费	1,462,755.12

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	441,475.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧多元平衡混合 A	中欧多元平衡混合 C	合计
国都证券	-	0.69	0.69
中欧财富	-	143.42	143.42
合计	-	144.11	144.11

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

计算方法如下： $H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国国际金融股份有限公司	20,085.54	16,142.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国国际金融股份有限公司保管，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

单位：人民币元

中欧多元平衡混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 3 月 9 日	-	2026 年 3 月 9 日	0.0620	869,072.83	61,379.24	930,452.07	-
合计	-	-	-	0.0620	869,072.83	61,379.24	930,452.07	-
中欧多元平衡混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 3 月 9 日	-	2026 年 3 月 9 日	0.0570	1,538,312.45	160,339.07	1,698,651.52	-
合计	-	-	-	0.0570	1,538,312.45	160,339.07	1,698,651.52	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	8,905	56,815.34	57,704.40	-

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，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。本基金在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。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检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面

金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	—	40,241,205.48
合计	—	40,241,205.48

注：本期末基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	82,369,468.48	141,932,826.31

AAA 以下	7,149,334.89	4,713,079.75
未评级	-	60,335,873.98
合计	89,518,803.37	206,981,780.04

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的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	23,951,800.43	-	-	-	23,951,800.43
结算备付金	5,174,559.94	-	-	-	5,174,559.94
交易性金融资产	2,852,269.57	86,666,533.80	-	-132,123,164.15	221,641,967.52
应收股利	-	-	-	52,718.01	52,718.01
应收申购款	-	-	-	952,810.65	952,810.65
资产总计	31,978,629.94	86,666,533.80	-	-133,128,692.81	251,773,856.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	702,393.90	702,393.90
应付管理人报酬	-	-	-	224,091.02	224,091.02
应付托管费	-	-	-	44,818.23	44,818.23
应付清算款	-	-	-	43,826.55	43,826.55
应付销售服务费	-	-	-	51,824.03	51,824.03
应交税费	-	-	-	2,240.99	2,240.99
其他负债	-	-	-	86,695.73	86,695.73
负债总计	-	-	-	1,155,890.45	1,155,890.45
利率敏感度缺口	31,978,629.94	86,666,533.80	-	-131,972,802.36	250,617,966.10
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	334,897,919.36	-	-	-	334,897,919.36
交易性金融资产	42,010,710.82	204,609,037.09	603,237.61	93,694,800.56	340,917,786.08
资产总计	376,908,630.18	204,609,037.09	603,237.61	93,694,800.56	675,815,705.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	480,264.94	480,264.94
应付托管费	-	-	-	96,052.99	96,052.99
应付销售服务费	-	-	-	139,977.41	139,977.41
应交税费	-	-	-	4,200.39	4,200.39
其他负债	-	-	-	8,265.24	8,265.24
负债总计	-	-	-	728,760.97	728,760.97
利率敏感度缺口	376,908,630.18	204,609,037.09	603,237.61	92,966,039.59	675,086,944.47

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	-247,267.89	-985,777.68
	利率下降 25BP	247,952.80	989,253.54

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,373,473.25	-	4,373,473.25

应收股利	-	52,718.01	-	52,718.01
资产合计	-	4,426,191.26	-	4,426,191.26
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	-	4,426,191.26	-	4,426,191.26
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币贬值 5%	-221,309.56	-
	港币相对人民币升值 5%	221,309.56	-

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	132,123,164.15	52.72	93,694,800.56	13.88
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	132,123,164.15	52.72	93,694,800.56	13.88

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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	9,033,421.26	—
	业绩比较基准下降 5%	-9,033,421.26	—

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	139,444,344.21	98,407,880.31
第二层次	82,197,623.31	242,509,905.77
第三层次	—	—
合计	221,641,967.52	340,917,786.08

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	132,123,164.15	52.48
	其中：股票	132,123,164.15	52.48
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	89,518,803.37	35.56
	其中：债券	89,518,803.37	35.56
	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	29,126,360.37	11.57
8	其他各项资产	1,005,528.66	0.40
9	合计	251,773,856.55	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 4,373,473.25 元，占基金资产净值比例 1.75%。

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	2,087,844.00	0.83
B	采矿业	7,086,622.00	2.83
C	制造业	89,350,933.32	35.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,805,227.00	1.52
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,114,038.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	5,343,248.00	2.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,870,176.03	2.34
J	金融业	5,463,334.50	2.18
K	房地产业	220,629.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,062,434.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	1,200,619.05	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	2,564,733.00	1.02
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	579,853.00	0.23

S	综合	-	-
	合计	127,749,690.90	50.97

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	95,193.08	0.04
消费者非必需品	1,152,109.01	0.46
消费者常用品	153,531.85	0.06
能源	475,617.98	0.19
金融	189,170.19	0.08
医疗保健	213,750.15	0.09
工业	322,883.47	0.13
信息技术	280,928.16	0.11
电信服务	1,418,550.60	0.57
公用事业	33,508.66	0.01
地产业	38,230.10	0.02
合计	4,373,473.25	1.75

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	300308	中际旭创	1,900	2,413,000.00	0.96
2	002493	荣盛石化	183,900	1,976,925.00	0.79
3	600320	振华重工	411,200	1,698,256.00	0.68
4	000703	恒逸石化	123,200	1,671,824.00	0.67
5	603288	海天味业	50,300	1,667,948.00	0.67
6	600623	华谊集团	196,900	1,588,983.00	0.63
7	000709	河钢股份	752,800	1,460,432.00	0.58
8	00700	腾讯控股	3,800	1,418,550.60	0.57
9	600037	歌华有线	219,300	1,375,011.00	0.55
10	000810	创维数字	100,700	1,334,275.00	0.53
11	000333	美的集团	16,900	1,276,457.00	0.51
12	688256	寒武纪	763	1,217,404.65	0.49
13	600874	创业环保	225,000	1,206,000.00	0.48
14	301216	万凯新材	51,500	1,183,985.00	0.47
15	002648	卫星化学	50,000	1,174,500.00	0.47
16	601069	西部黄金	53,300	1,172,600.00	0.47
17	688498	源杰科技	616	1,161,776.00	0.46
18	603986	兆易创新	1,400	1,141,000.00	0.46
19	300750	宁德时代	2,700	1,061,127.00	0.42
19	03750	宁德时代	100	60,972.21	0.02
20	000589	贵州轮胎	274,100	1,112,846.00	0.44
21	601500	通用股份	302,900	1,105,585.00	0.44

22	600971	恒源煤电	160,000	1,104,000.00	0.44
23	600519	贵州茅台	900	1,066,941.00	0.43
24	000049	德赛电池	44,400	1,037,628.00	0.41
25	000683	博源化工	176,700	1,017,792.00	0.41
26	601163	三角轮胎	79,200	1,005,048.00	0.40
27	301371	敷尔佳	37,600	977,600.00	0.39
28	002079	苏州固锝	64,000	961,920.00	0.38
29	002233	塔牌集团	137,900	961,163.00	0.38
30	000552	甘肃能化	423,200	947,968.00	0.38
31	688059	华锐精密	4,638	926,254.98	0.37
32	300769	德方纳米	13,800	917,700.00	0.37
33	603317	天味食品	70,500	917,205.00	0.37
34	603259	药明康德	6,900	859,119.00	0.34
34	02359	药明康德	300	40,048.84	0.02
35	301358	湖南裕能	11,800	895,266.00	0.36
36	603507	振江股份	27,100	891,319.00	0.36
37	600717	天津港	229,000	890,810.00	0.36
38	000581	威孚高科	51,900	883,338.00	0.35
39	002466	天齐锂业	14,400	883,008.00	0.35
40	002152	广电运通	92,200	864,836.00	0.35
41	002376	新北洋	147,600	848,700.00	0.34
42	600276	恒瑞医药	16,300	848,252.00	0.34
43	000544	中原环保	120,500	839,885.00	0.34
44	002111	威海广泰	92,500	832,500.00	0.33
45	688700	东威科技	9,312	832,492.80	0.33
46	000415	渤海租赁	202,200	822,954.00	0.33
47	600801	华新建材	52,500	819,000.00	0.33
48	000949	新乡化纤	128,300	813,422.00	0.32
49	300047	天源迪科	91,600	813,408.00	0.32
50	600395	盘江股份	175,200	798,912.00	0.32
51	300438	鹏辉能源	9,600	795,360.00	0.32
52	688536	思瑞浦	2,180	793,716.20	0.32
53	600288	大恒科技	59,500	791,350.00	0.32
54	600233	圆通速递	50,200	790,650.00	0.32
55	002838	道恩股份	25,800	789,996.00	0.32
56	600150	中国船舶	23,200	783,928.00	0.31
57	001339	智微智能	7,650	782,442.00	0.31
58	300432	富临精工	38,800	779,492.00	0.31
59	600020	中原高速	210,100	775,269.00	0.31
60	601828	美凯龙	378,400	771,936.00	0.31
61	603256	宏和科技	2,900	769,457.00	0.31
62	000885	城发环境	63,800	767,514.00	0.31
63	002415	海康威视	22,400	766,080.00	0.31

64	002458	益生股份	98,200	763,014.00	0.30
65	688308	欧科亿	4,104	746,148.24	0.30
66	301260	格力博	54,900	741,699.00	0.30
67	000301	东方盛虹	64,700	740,815.00	0.30
68	002738	中矿资源	12,300	725,577.00	0.29
69	000989	九芝堂	88,200	685,314.00	0.27
70	002756	永兴材料	11,700	662,688.00	0.26
71	002497	雅化集团	32,200	655,914.00	0.26
72	002250	联化科技	47,600	650,692.00	0.26
73	000426	兴业银锡	19,700	649,312.00	0.26
74	001203	大中矿业	21,500	643,925.00	0.26
75	603901	永创智能	59,100	642,417.00	0.26
76	601233	桐昆股份	29,500	638,675.00	0.25
77	600595	中孚实业	113,500	637,870.00	0.25
78	600081	东风科技	69,900	634,692.00	0.25
79	000900	现代投资	181,200	626,952.00	0.25
80	002557	洽洽食品	34,900	626,804.00	0.25
81	600966	博汇纸业	130,800	625,224.00	0.25
82	688275	万润新能	4,884	622,954.20	0.25
83	601200	上海环境	94,300	622,380.00	0.25
84	603588	高能环境	32,200	618,240.00	0.25
85	000657	中钨高新	6,400	612,608.00	0.24
86	002532	天山铝业	56,600	607,318.00	0.24
87	300972	万辰集团	3,500	606,935.00	0.24
88	002772	众兴菌业	53,300	605,488.00	0.24
89	000807	云铝股份	27,100	599,994.00	0.24
90	688012	中微公司	1,269	594,526.50	0.24
91	600546	山煤国际	53,500	584,755.00	0.23
92	600508	上海能源	78,900	581,493.00	0.23
93	002746	仙坛股份	113,400	578,340.00	0.23
94	300563	神宇股份	20,000	567,800.00	0.23
95	301206	三元生物	24,500	544,635.00	0.22
96	002956	西麦食品	26,000	539,760.00	0.22
97	600887	伊利股份	22,400	536,704.00	0.21
98	603213	镇洋发展	38,800	536,604.00	0.21
99	600309	万华化学	7,700	526,757.00	0.21
100	300073	当升科技	10,600	509,224.00	0.20
101	002154	报喜鸟	140,200	499,112.00	0.20
102	600101	明星电力	63,000	497,070.00	0.20
103	603195	公牛集团	12,600	493,290.00	0.20
104	09988	阿里巴巴-W	6,000	483,869.21	0.19
105	601218	吉鑫科技	109,900	472,570.00	0.19
106	688368	晶丰明源	2,179	471,797.08	0.19

107	001314	亿道信息	7,600	469,680.00	0.19
108	002027	分众传媒	96,600	467,544.00	0.19
109	002166	莱茵生物	74,400	467,232.00	0.19
110	601000	唐山港	110,100	456,915.00	0.18
111	601997	贵阳银行	88,500	454,005.00	0.18
112	002406	远东传动	68,500	449,360.00	0.18
113	600901	江苏金租	75,100	431,825.00	0.17
114	600598	北大荒	39,700	430,348.00	0.17
115	688503	聚和材料	3,188	423,047.60	0.17
116	601577	长沙银行	47,400	412,854.00	0.16
117	688981	中芯国际	2,557	406,102.74	0.16
118	00883	中国海洋石油	23,000	405,925.53	0.16
119	09992	泡泡玛特	3,000	403,094.06	0.16
120	300592	华凯易佰	22,700	401,790.00	0.16
121	000893	亚钾国际	9,800	400,722.00	0.16
122	600523	贵航股份	37,900	399,845.00	0.16
123	600000	浦发银行	46,300	398,643.00	0.16
124	300590	移为通信	26,400	378,840.00	0.15
125	000089	深圳机场	60,500	364,815.00	0.15
126	300502	新易盛	600	364,200.00	0.15
127	000059	华锦股份	96,700	362,625.00	0.14
128	300953	震裕科技	2,700	360,990.00	0.14
129	002948	青岛银行	69,600	353,568.00	0.14
130	001298	好上好	17,000	352,750.00	0.14
131	688002	睿创微纳	2,279	352,538.51	0.14
132	300681	英搏尔	12,300	352,026.00	0.14
133	301109	军信股份	28,200	351,372.00	0.14
134	002812	恩捷股份	5,200	347,932.00	0.14
135	301031	中熔电气	2,900	346,405.00	0.14
136	601100	恒立液压	3,200	344,192.00	0.14
137	688105	诺唯赞	19,683	341,500.05	0.14
138	605117	德业股份	3,200	339,776.00	0.14
139	300054	鼎龙股份	3,200	339,104.00	0.14
140	688521	芯原股份	910	337,737.40	0.13
141	301377	鼎泰高科	600	330,540.00	0.13
142	600596	新安股份	20,600	328,776.00	0.13
143	002439	启明星辰	25,400	321,310.00	0.13
144	600489	中金黄金	17,700	319,485.00	0.13
145	002839	张家港行	81,900	319,410.00	0.13
146	600809	山西汾酒	2,900	317,173.00	0.13
147	601208	东材科技	4,400	311,476.00	0.12
148	002204	大连重工	58,400	308,352.00	0.12
149	000933	神火股份	14,500	307,400.00	0.12

150	605577	龙版传媒	34,700	305,707.00	0.12
151	601998	中信银行	43,900	304,227.00	0.12
152	000519	中兵红箭	14,400	303,408.00	0.12
153	600660	福耀玻璃	6,000	302,640.00	0.12
154	600884	杉杉股份	22,200	300,810.00	0.12
155	000957	中通客车	31,800	297,648.00	0.12
156	600741	华域汽车	19,100	296,432.00	0.12
157	300016	北陆药业	38,500	295,295.00	0.12
158	600869	远东股份	8,800	294,536.00	0.12
159	600329	达仁堂	7,900	294,038.00	0.12
160	603799	华友钴业	6,000	289,560.00	0.12
161	600398	海澜之家	55,300	289,219.00	0.12
162	002041	登海种业	36,600	288,042.00	0.11
163	600919	江苏银行	26,500	285,670.00	0.11
164	601699	潞安环能	19,900	284,172.00	0.11
165	000568	泸州老窖	3,600	279,072.00	0.11
166	601009	南京银行	28,000	276,920.00	0.11
167	600908	无锡银行	53,600	272,288.00	0.11
168	603816	顾家家居	12,100	270,556.00	0.11
169	600346	恒力石化	14,900	263,879.00	0.11
170	688151	华强科技	17,724	263,555.88	0.11
171	300307	慈星股份	34,800	256,476.00	0.10
172	000708	中信特钢	20,200	254,924.00	0.10
173	603508	思维列控	11,700	249,912.00	0.10
174	600566	济川药业	11,100	246,309.00	0.10
175	601963	重庆银行	24,300	244,944.00	0.10
176	301339	通行宝	23,800	243,474.00	0.10
177	002867	周大生	21,800	243,070.00	0.10
178	002132	恒星科技	44,800	242,368.00	0.10
179	300219	鸿利智汇	22,800	237,804.00	0.09
180	600955	维远股份	16,000	235,520.00	0.09
181	603118	共进股份	19,400	234,934.00	0.09
182	600023	浙能电力	44,500	234,070.00	0.09
183	600015	华夏银行	35,800	228,762.00	0.09
184	002563	森马服饰	45,300	228,312.00	0.09
185	000001	平安银行	22,700	228,135.00	0.09
186	601838	成都银行	12,600	223,020.00	0.09
187	600461	洪城环境	24,200	219,252.00	0.09
188	600210	紫江企业	34,800	215,760.00	0.09
189	600285	羚锐制药	11,100	215,118.00	0.09
190	000895	双汇发展	9,500	212,800.00	0.08
191	600685	中船防务	8,300	211,152.00	0.08
192	002938	鹏鼎控股	2,000	210,760.00	0.08

193	002067	景兴纸业	57,200	210,496.00	0.08
194	000783	长江证券	20,700	201,825.00	0.08
195	601916	浙商银行	75,200	197,776.00	0.08
196	600177	雅戈尔	26,200	197,286.00	0.08
197	600428	中远海特	25,200	196,812.00	0.08
198	002008	大族激光	1,300	195,143.00	0.08
199	300443	金雷股份	9,000	194,220.00	0.08
200	000848	承德露露	26,100	193,140.00	0.08
201	00388	香港交易所	600	189,170.19	0.08
202	605007	五洲特纸	14,100	188,799.00	0.08
203	601098	中南传媒	18,800	184,992.00	0.07
204	600203	福日电子	15,100	183,465.00	0.07
205	600808	马钢股份	72,300	180,750.00	0.07
206	601339	百隆东方	26,600	180,082.00	0.07
207	600886	国投电力	13,500	179,685.00	0.07
208	002876	三利谱	5,100	179,571.00	0.07
209	002737	葵花药业	16,000	179,360.00	0.07
210	600350	山东高速	15,600	173,628.00	0.07
211	600168	武汉控股	42,500	171,700.00	0.07
212	002293	罗莱生活	17,100	169,119.00	0.07
213	000429	粤高速 A	12,200	166,530.00	0.07
214	001872	招商港口	8,500	165,155.00	0.07
215	000828	东莞控股	17,300	161,928.00	0.06
216	002216	三全食品	14,000	161,420.00	0.06
217	603511	爱慕股份	14,000	161,000.00	0.06
218	000045	深纺织 A	15,200	160,208.00	0.06
219	000088	盐田港	38,800	158,692.00	0.06
220	300773	拉卡拉	10,320	157,896.00	0.06
221	002142	宁波银行	5,200	154,388.00	0.06
222	002958	青农商行	56,300	154,262.00	0.06
223	601939	建设银行	16,000	154,080.00	0.06
224	000612	焦作万方	14,400	152,496.00	0.06
225	603587	地素时尚	13,700	152,207.00	0.06
226	002274	华昌化工	31,700	146,771.00	0.06
227	600066	宇通客车	5,300	142,093.00	0.06
228	603068	博通集成	3,500	140,805.00	0.06
229	603305	旭升集团	11,600	140,592.00	0.06
230	603013	亚普股份	8,700	137,373.00	0.05
231	600008	首创环保	49,900	135,728.00	0.05
232	002595	豪迈科技	2,800	130,480.00	0.05
233	601518	吉林高速	46,500	130,200.00	0.05
234	01888	建滔积层板	1,500	129,175.10	0.05
235	600323	瀚蓝环境	4,700	129,062.00	0.05

236	000623	吉林敖东	7,200	127,656.00	0.05
237	600064	南京高科	17,900	127,627.00	0.05
238	002745	木林森	9,900	124,245.00	0.05
239	000598	兴蓉环境	19,200	123,264.00	0.05
240	603025	大豪科技	9,000	122,760.00	0.05
241	000685	中山公用	10,800	120,528.00	0.05
242	00992	联想集团	6,000	119,964.13	0.05
243	600648	外高桥	14,200	113,458.00	0.05
244	00669	创科实业	1,000	112,477.23	0.04
245	688188	柏楚电子	1,021	108,940.70	0.04
246	002056	横店东磁	3,500	106,680.00	0.04
247	600827	百联股份	14,300	105,963.00	0.04
248	300628	亿联网络	3,100	104,842.00	0.04
249	600269	赣粤高速	26,200	104,276.00	0.04
250	03692	翰森制药	4,000	102,905.80	0.04
251	600563	法拉电子	500	95,400.00	0.04
252	02899	紫金矿业	4,000	95,193.08	0.04
253	600007	中国国贸	4,900	93,002.00	0.04
254	000921	海信家电	3,400	92,888.00	0.04
255	603323	苏农银行	23,850	92,299.50	0.04
256	000719	中原传媒	7,800	89,154.00	0.04
257	002690	美亚光电	6,200	88,846.00	0.04
258	000737	北方铜业	6,700	88,574.00	0.04
259	300213	佳讯飞鸿	14,300	86,658.00	0.03
260	02020	安踏体育	1,400	86,394.67	0.03
261	600704	物产中大	17,900	84,488.00	0.03
262	002014	永新股份	8,000	84,480.00	0.03
263	09633	农夫山泉	2,400	82,588.68	0.03
264	603026	石大胜华	900	80,433.00	0.03
265	300832	新产业	1,900	79,800.00	0.03
266	603071	物产环能	7,200	79,632.00	0.03
267	603515	欧普照明	4,800	78,432.00	0.03
268	603906	龙蟠科技	2,900	76,937.00	0.03
269	300487	蓝晓科技	1,300	76,505.00	0.03
270	001286	陕西能源	7,500	76,050.00	0.03
271	601033	永兴股份	5,600	75,040.00	0.03
272	601665	齐鲁银行	12,900	74,433.00	0.03
273	603298	杭叉集团	3,100	73,966.00	0.03
274	600558	大西洋	14,900	73,606.00	0.03
275	000423	东阿阿胶	1,600	72,576.00	0.03
276	01088	中国神华	2,000	69,692.45	0.03
277	301500	飞南资源	2,600	67,730.00	0.03
278	603233	大参林	4,300	64,629.00	0.03

279	603156	养元饮品	1,300	63,791.00	0.03
280	000513	丽珠集团	2,200	63,558.00	0.03
281	603167	渤海轮渡	7,400	63,418.00	0.03
282	601156	东航物流	3,800	61,256.00	0.02
283	603985	恒润股份	2,500	60,050.00	0.02
284	002780	三夫户外	4,800	58,272.00	0.02
285	688121	*ST 卓然	8,905	57,704.40	0.02
286	301246	宏源药业	2,100	56,490.00	0.02
287	600035	楚天高速	16,600	55,942.00	0.02
288	09987	百胜中国	200	55,517.72	0.02
289	01308	海丰国际	2,000	54,510.20	0.02
290	688475	萤石网络	1,933	52,867.55	0.02
291	603338	浙江鼎力	1,200	51,000.00	0.02
292	03808	中国重汽	1,500	50,210.88	0.02
293	688221	前沿生物	2,226	49,862.40	0.02
294	300737	科顺股份	7,300	47,961.00	0.02
295	01929	周大福	5,000	47,335.98	0.02
296	688617	惠泰医疗	257	46,660.92	0.02
297	600433	冠豪高新	14,500	46,545.00	0.02
298	301048	金鹰重工	5,400	46,494.00	0.02
299	600230	沧州大化	3,500	45,570.00	0.02
300	603111	康尼机电	7,900	44,714.00	0.02
301	02057	中通快递-W	300	44,712.95	0.02
302	01209	华润万象生活	1,200	38,230.10	0.02
303	00291	华润啤酒	2,000	36,965.49	0.01
304	01093	石药集团	6,000	36,322.76	0.01
305	01177	中国生物制药	9,000	34,472.75	0.01
306	00322	康师傅控股	4,000	33,977.68	0.01
307	00135	昆仑能源	6,000	33,508.66	0.01
308	002372	伟星新材	3,900	31,941.00	0.01
309	02382	舜宇光学科技	600	31,788.93	0.01
310	301026	浩通科技	1,480	29,925.60	0.01
311	06862	海底捞	3,000	27,672.00	0.01
312	603927	中科软	2,100	26,691.00	0.01
313	06690	海尔智家	1,400	24,295.08	0.01
314	02313	申洲国际	700	23,930.29	0.01
315	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.00
316	002354	天娱数科	300	2,790.00	0.00
317	605016	百龙创园	100	2,585.00	0.00
318	002582	好想你	200	1,690.00	0.00
319	603818	曲美家居	400	1,188.00	0.00
320	603900	莱绅通灵	200	1,126.00	0.00
321	002398	垒知集团	300	1,125.00	0.00

321	603797	联泰环保	300	1,125.00	0.00
322	605001	威奥股份	200	1,090.00	0.00
323	605122	四方新材	100	1,078.00	0.00
324	000605	渤海股份	200	1,070.00	0.00
325	603041	美思德	100	1,037.00	0.00
326	002381	双箭股份	200	1,036.00	0.00
327	300771	智莱科技	100	1,032.00	0.00
328	000757	浩物股份	300	1,023.00	0.00
329	003003	天元股份	100	995.00	0.00
330	300694	蠡湖股份	100	960.00	0.00
331	600354	敦煌种业	200	952.00	0.00
332	002893	京能热力	100	925.00	0.00
332	300800	力合科技	100	925.00	0.00
333	600833	第一医药	100	902.00	0.00
334	603617	君禾股份	100	712.00	0.00
335	600883	博闻科技	100	700.00	0.00
336	300387	富邦科技	100	679.00	0.00
337	002566	益盛药业	100	604.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	8,426,260.43	1.25
2	09988	阿里巴巴-W	6,879,673.51	1.02
3	603259	药明康德	5,812,259.00	0.86
3	02359	药明康德	111,728.76	0.02
4	601872	招商轮船	4,490,367.00	0.67
5	300857	协创数据	4,207,068.00	0.62
6	301216	万凯新材	4,174,101.50	0.62
7	300308	中际旭创	4,132,703.00	0.61
8	600395	盘江股份	4,053,384.00	0.60
9	002493	荣盛石化	4,034,858.00	0.60
10	600502	安徽建工	4,015,362.00	0.59
11	600596	新安股份	3,980,447.00	0.59
12	000581	威孚高科	3,897,047.00	0.58
13	600066	宇通客车	3,734,576.00	0.55
14	300750	宁德时代	3,527,436.00	0.52
14	03750	宁德时代	126,791.08	0.02
15	600037	歌华有线	3,483,580.00	0.52
16	688002	睿创微纳	3,480,667.82	0.52
17	002497	雅化集团	3,322,739.00	0.49
18	600329	达仁堂	3,321,371.00	0.49
19	000709	河钢股份	3,284,191.00	0.49

20	300502	新易盛	3, 206, 466. 00	0. 47
----	--------	-----	-----------------	-------

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	603259	药明康德	5, 506, 418. 00	0. 82
1	02359	药明康德	86, 246. 79	0. 01
2	00700	腾讯控股	5, 524, 457. 75	0. 82
3	09988	阿里巴巴-W	5, 217, 194. 99	0. 77
4	300857	协创数据	5, 134, 634. 80	0. 76
5	601872	招商轮船	4, 457, 592. 00	0. 66
6	300861	美畅股份	4, 001, 841. 00	0. 59
7	600502	安徽建工	3, 928, 052. 00	0. 58
8	300681	英搏尔	3, 884, 486. 32	0. 58
9	600596	新安股份	3, 858, 693. 00	0. 57
10	000581	威孚高科	3, 823, 996. 00	0. 57
11	688002	睿创微纳	3, 728, 450. 30	0. 55
12	600064	南京高科	3, 596, 408. 00	0. 53
13	301216	万凯新材	3, 558, 549. 00	0. 53
14	600066	宇通客车	3, 440, 975. 00	0. 51
15	300750	宁德时代	3, 355, 033. 00	0. 50
15	03750	宁德时代	61, 067. 13	0. 01
16	300975	商络电子	3, 390, 331. 00	0. 50
17	600057	厦门象屿	3, 348, 147. 00	0. 50
18	603733	仙鹤股份	3, 296, 367. 00	0. 49
19	300502	新易盛	3, 292, 986. 00	0. 49
20	600329	达仁堂	3, 236, 391. 00	0. 48

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	822, 167, 148. 05
卖出股票收入（成交）总额	777, 621, 624. 77

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	82,139,918.91	32.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,378,884.46	2.94
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	89,518,803.37	35.72

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	184576	22 徐工 01	200,000	20,788,726.58	8.29
2	148067	22 广发 12	200,000	20,698,547.95	8.26
3	241622	24 平证 03	200,000	20,396,430.68	8.14
4	244168	25 中证 12	200,000	20,256,213.70	8.08
5	113658	密卫转债	6,730	947,159.00	0.38

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

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	应收清算款	-
3	应收股利	52,718.01
4	应收利息	-
5	应收申购款	952,810.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,005,528.66

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	113658	密卫转债	947,159.00	0.38
2	123216	科顺转债	944,354.55	0.38
3	127067	恒逸转2	915,028.38	0.37
4	123178	花园转债	442,538.24	0.18
5	118040	宏微转债	442,487.82	0.18
6	123251	华医转债	439,995.72	0.18
7	113624	正川转债	436,061.17	0.17
8	118031	天23转债	424,667.95	0.17
9	123253	永贵转债	367,863.09	0.15
10	127105	龙星转债	359,126.47	0.14
11	123188	水羊转债	62,724.23	0.03
12	127034	绿茵转债	62,376.91	0.02
13	123213	天源转债	61,720.16	0.02
14	123117	健帆转债	61,591.79	0.02
15	123225	翔丰转债	60,999.45	0.02

16	113042	上银转债	60,073.75	0.02
17	113049	长汽转债	58,917.13	0.02
18	113627	太平转债	58,050.63	0.02
19	123113	仙乐转债	57,609.60	0.02
20	127040	国泰转债	57,436.97	0.02
21	113056	重银转债	57,301.25	0.02
22	123183	海顺转债	57,119.48	0.02
23	111015	东亚转债	56,985.37	0.02
24	111004	明新转债	56,888.61	0.02
25	123243	严牌转债	56,700.57	0.02
26	113647	禾丰转债	56,637.22	0.02
27	127030	盛虹转债	56,586.54	0.02
28	113636	甬金转债	56,547.53	0.02
29	127044	蒙娜转债	56,140.80	0.02
30	113655	欧 22 转债	56,085.57	0.02
31	123122	富瀚转债	55,718.12	0.02
32	110077	洪城转债	55,270.38	0.02
33	118022	锂科转债	55,227.19	0.02
34	123119	康泰转 2	54,958.39	0.02
35	127031	洋丰转债	54,778.31	0.02
36	110086	精工转债	54,278.24	0.02
37	111018	华康转债	54,152.84	0.02
38	110084	贵燃转债	53,467.60	0.02
39	113062	常银转债	53,257.44	0.02

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
中欧多元 平衡混合	2,517	43,430.51	13,097,385.70	11.98%	96,217,217.79	88.02%

A						
中欧多元平衡混合 C	1,923	78,131.21	16,147,565.56	10.75%	134,098,741.91	89.25%
合计	4,440	58,459.66	29,244,951.26	11.27%	230,315,959.70	88.73%

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	中欧多元平衡混合 A	0.00	0.00%
	中欧多元平衡混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	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	中欧多元平衡混合 A	0
	中欧多元平衡混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧多元平衡混合 A	0
	中欧多元平衡混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧多元平衡混合 A	中欧多元平衡混合 C
基金合同生效日 （2025 年 12 月 5 日） 基金份额总额	182,901,682.88	491,201,221.57
本报告期期初基金份额总额	182,901,682.88	491,201,221.57
本报告期基金总申购份额	48,476,450.20	41,639,570.60
减：本报告期基金总赎回份额	122,063,529.59	382,594,484.70
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份	109,314,603.49	150,246,307.47

额总额		
-----	--	--

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，经基金托管人中国国际金融股份有限公司研究决定，聘任刘晴川同志为本公司资产托管部负责人，严格同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员没有受到调查或处罚。

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 (%)	
中信证券	3	975,448,126.36	60.97	428,415.21	61.15	本报告期新增3个
财通证券	3	624,340,646.46	39.03	272,175.44	38.85	本报告期新增3个

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 (%)
中信证券	217,727,993.10	60.31	—	—	—	—
财通证券	143,257,813.93	39.69	—	—	—	—

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	中欧多元平衡混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-02-02
2	中欧多元平衡混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-03
3	中欧多元平衡混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2026-03-06
4	中欧多元平衡混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-03-09
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	中欧多元平衡混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧多元平衡混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理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