# 中欧招益稳健一年持有期混合型证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中欧招益稳健一年持有混合 |
| 基金主代码 | 013912 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 1 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 113,235,842.55 份 |
| 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 | 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）。<br>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。<br>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 800 指数收益率×10% +中证港股通综合指数收益率*3%+中债综合财富（总值）指数收益率×87% | |
| 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。<br>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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧招益稳健一年持有混合 A | 中欧招益稳健一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013912 | 013913 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 91,597,161.84 份 | 21,638,680.71 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 中欧招益稳健一年持有混合 A | 中欧招益稳健一年持有混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 635,630.57 | 123,374.73 |
| 2.本期利润 | -577,315.06 | -162,699.99 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0062 | -0.0073 |
| 4.期末基金资产净值 | 104,400,402.57 | 24,199,203.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1398 | 1.1183 |

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.上述基金业绩指标不包括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

中欧招益稳健一年持有混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.57% | 0.18% | -0.37% | 0.16% | -0.20% | 0.02% |
| 过去六个月 | -0.74% | 0.21% | 1.74% | 0.16% | -2.48% | 0.05% |
| 过去一年 | 0.47% | 0.23% | 2.37% | 0.15% | -1.90% | 0.08% |
| 过去三年 | 14.63% | 0.24% | 15.24% | 0.15% | -0.61% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.98% | 0.21% | 18.32% | 0.15% | -4.34% | 0.06% |

中欧招益稳健一年持有混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.67% | 0.18% | -0.37% | 0.16% | -0.30% | 0.02% |
| 过去六个月 | -0.95% | 0.21% | 1.74% | 0.16% | -2.69% | 0.05% |
| 过去一年 | 0.05% | 0.23% | 2.37% | 0.15% | -2.32% | 0.08% |
| 过去三年 | 13.26% | 0.24% | 15.24% | 0.15% | -1.98% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.83% | 0.21% | 18.32% | 0.15% | -6.49% | 0.06% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较






# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 黄华 | 多资产投决会主席/投资总监/基金经理 | 2022-01-05 | - | 18 年 | 历任平安资产管理有限责任公司组合经理，中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理，中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016-11-10 加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理、固收投决会委员。 |

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 公平交易专项说明

### 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 6 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，海外宏观最大变量是美联储从“转鹰”走向“行动”，9 月中旬重启加息，为 2023 年 7 月以来首次，点阵图显示年内或仍有一次，再通胀压力成为海外定价主轴，十年期美债收益率一度升破 5%、创近二十年新高，中美利差再度走阔。全球风险资产的贴现率之锚被系统性抬升，成为本季度成长股估值压降的直接外因。与之相对，国内延续“弱现实、强呵护”，七月底政治局会议定调宽松，三季度央行先后重启 14 天逆回购、上调隔夜逆回购上限、超额续作 MLF，季末又有房贷贴息、PSL 降息等组合拳落地，资金利率中枢较二季度进一步下移并保持平稳，股市剧烈波动期间流动性呵护信号明确。内外政策周期的背离造就了国内市场股弱债强的资产格局。

股票方面，三季度市场深度调整，中证 800 指数下跌 13.97%，上半年领涨的 AI/TMT 主线成为重灾区，双创指数录得各自历史上最大单季跌幅，电子、通信等上半年翻倍级板块跌幅居前。经历了上半年的快速上涨，科技方向在三季度的估值和交易拥挤度均已处于较高水平，当价格出现松动，获利盘兑现和杠杆资金去化相互强化，下跌节奏远快于产业本身的变化。而与此相对应的，煤炭、石化、银行、农林牧渔等低估值高股息方向逆势明显上涨。

债券层面，在基本面弱现实与货币宽松预期的持续确认下，三季度债券市场延续了今年的债牛行情。由于票息失效的格局没有改变，信用利差也已压缩至近乎极致，收益来源进一步向资本利得倾斜，久期策略因此明显占优，市场在产品结构上也呈现出向长端和超长端集中的特征。利率债整体走出牛平走势：1Y 上行约 10BP，更多是前期抢跑定价的纠偏，而非流动性收紧所致；10Y

下行约 5BP，30Y 下行近 14BP，在债牛行情中形成典型的牛平格局。具体来看，三季度行情大致可分为三段：站在现在往回看，7 月上中旬的调整恰好成为最好的配置窗口；下旬存款降息预期与政治局会议共同带动市场走出下行的趋势性行情；9 月下旬公积金降息预期推动超长债率先突破，而月末政策组合拳叠加 PMI 回扩张则触发止盈。信用债方面，利差全面压缩，5Y AAA 中票下行约 11BP，利差保护不足，安全垫明显变薄。与此同时，三季度权益市场下跌，股债再平衡下的资金进一步加剧了纯债市场的资产荒行情，避险需求推动债券收益整体下行。

组合操作层面，权益方面仍较多暴露于高股息等偏价值板块，在三季度的极端反转行情中相对获益。债券部分则以久期操作为重心，参与超长利率债的波段交易，力求为组合增厚收益。基金投资追求相对均衡和绝对收益，在红利和价值风格上适当暴露。

### 4.5 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-0.57%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%；基金 C 类份额净值增长率为-0.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 13,289,132.50 | 8.16 |
| | 其中：股票 | 13,289,132.50 | 8.16 |
| 2 | 基金投资 | 5,041,726.09 | 3.10 |
| 3 | 固定收益投资 | 144,179,937.59 | 88.55 |
| | 其中：债券 | 144,179,937.59 | 88.55 |
| | 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 | 295,675.62 | 0.18 |
| 8 | 其他资产 | 13,453.46 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 162,819,925.26 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,615,299.50 元，占基金资产净值比例 2.81%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,620,260.00 | 2.04 |
| C | 制造业 | 7,053,573.00 | 5.48 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 9,673,833.00 | 7.52 |

### 5.2.2 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 | 79,399.50 | 0.06 |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 1,686,000.00 | 1.31 |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | 1,849,900.00 | 1.44 |
| 公用事业 | - | - |
| 地产业 | - | - |
| 合计 | 3,615,299.50 | 2.81 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300750 | 宁德时代 | 17,000 | 4,948,870.00 | 3.85 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 5,000 | 1,849,900.00 | 1.44 |
| 3 | 00939 | 建设银行 | 200,000 | 1,686,000.00 | 1.31 |
| 4 | 601088 | 中国神华 | 33,000 | 1,577,400.00 | 1.23 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 16,900 | 1,353,690.00 | 1.05 |
| 6 | 600547 | 山东黄金 | 38,200 | 1,042,860.00 | 0.81 |
| 7 | 601600 | 中国铝业 | 84,100 | 751,013.00 | 0.58 |
| 8 | 03690 | 美团-W | 1,290 | 79,399.50 | 0.06 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 7,498,943.07 | 5.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 71,576,724.67 | 55.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,700,169.87 | 31.65 |
| 4 | 企业债券 | 30,964,858.08 | 24.08 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,469,424.66 | 23.69 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,669,987.11 | 2.85 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 144,179,937.59 | 112.12 |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 260203 | 26 国开 03 | 200,000 | 20,338,909.59 | 15.82 |
| 2 | 240376 | 陕煤 KY06 | 100,000 | 10,640,756.16 | 8.27 |
| 3 | 242480007 | 24 工行永续债 01 | 100,000 | 10,251,720.55 | 7.97 |
| 4 | 102580144 | 25 朝阳国资 MTN001 | 100,000 | 10,251,147.40 | 7.97 |
| 5 | 260205 | 26 国开 05 | 100,000 | 10,249,939.73 | 7.97 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货的投资。 国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的 判断、对债券市场进行定性和定量分析。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、国家外汇管理局北京市分局)的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2

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。

## 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 627.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,796.68 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 28.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 13,453.46 |

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 123172 | 漱玉转债 | 26,340.68 | 0.02 |
| 2 | 113056 | 重银转债 | 26,319.73 | 0.02 |
| 3 | 123119 | 康泰转 2 | 26,099.02 | 0.02 |
| 4 | 123113 | 仙乐转债 | 25,894.53 | 0.02 |
| 5 | 113042 | 上银转债 | 25,844.06 | 0.02 |
| 6 | 113054 | 绿动转债 | 25,781.71 | 0.02 |
| 7 | 118031 | 天 23 转债 | 25,761.16 | 0.02 |
| 8 | 118022 | 锂科转债 | 25,651.37 | 0.02 |
| 9 | 113647 | 禾丰转债 | 25,502.21 | 0.02 |
| 10 | 113049 | 长汽转债 | 25,443.68 | 0.02 |
| 11 | 113627 | 太平转债 | 25,298.14 | 0.02 |
| 12 | 111015 | 东亚转债 | 25,269.25 | 0.02 |
| 13 | 123117 | 健帆转债 | 25,177.72 | 0.02 |
| 14 | 113638 | 台 21 转债 | 25,174.56 | 0.02 |
| 15 | 123243 | 严牌转债 | 25,099.55 | 0.02 |
| 16 | 111004 | 明新转债 | 25,084.50 | 0.02 |
| 17 | 111000 | 起帆转债 | 25,016.31 | 0.02 |
| 18 | 127050 | 麒麟转债 | 24,960.23 | 0.02 |
| 19 | 123216 | 科顺转债 | 24,920.14 | 0.02 |
| 20 | 113634 | 珀莱转债 | 24,918.96 | 0.02 |
| 21 | 127049 | 希望转 2 | 24,915.39 | 0.02 |
| 22 | 113631 | 皖天转债 | 24,909.02 | 0.02 |
| 23 | 113066 | 平煤转债 | 24,750.61 | 0.02 |
| 24 | 111018 | 华康转债 | 24,626.19 | 0.02 |
| 25 | 123192 | 科思转债 | 24,594.44 | 0.02 |
| 26 | 113636 | 甬金转债 | 24,582.20 | 0.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 27 | 123183 | 海顺转债 | 24,519.73 | 0.02 |
| 28 | 110093 | 神马转债 | 24,518.21 | 0.02 |
| 29 | 113633 | 科沃转债 | 24,495.52 | 0.02 |
| 30 | 127040 | 国泰转债 | 24,300.57 | 0.02 |
| 31 | 113625 | 江山转债 | 24,268.95 | 0.02 |
| 32 | 123168 | 惠云转债 | 24,165.29 | 0.02 |
| 33 | 113058 | 友发转债 | 24,093.87 | 0.02 |
| 34 | 111009 | 盛泰转债 | 24,093.67 | 0.02 |
| 35 | 113062 | 常银转债 | 24,091.16 | 0.02 |
| 36 | 111002 | 特纸转债 | 24,033.91 | 0.02 |
| 37 | 110087 | 天业转债 | 24,000.90 | 0.02 |
| 38 | 111014 | 李子转债 | 23,957.73 | 0.02 |
| 39 | 123122 | 富瀚转债 | 23,929.90 | 0.02 |
| 40 | 127085 | 韵达转债 | 23,899.75 | 0.02 |
| 41 | 127059 | 永东转 2 | 23,866.19 | 0.02 |
| 42 | 113052 | 兴业转债 | 23,768.10 | 0.02 |
| 43 | 127044 | 蒙娜转债 | 23,751.35 | 0.02 |
| 44 | 123178 | 花园转债 | 23,724.71 | 0.02 |
| 45 | 127103 | 东南转债 | 23,706.72 | 0.02 |
| 46 | 110095 | 双良转债 | 23,637.08 | 0.02 |
| 47 | 127062 | 垒知转债 | 23,465.86 | 0.02 |
| 48 | 123225 | 翔丰转债 | 23,460.05 | 0.02 |
| 49 | 110100 | 龙建转债 | 23,301.05 | 0.02 |
| 50 | 123194 | 百洋转债 | 23,288.11 | 0.02 |
| 51 | 118005 | 天奈转债 | 23,241.65 | 0.02 |
| 52 | 118035 | 国力转债 | 23,223.19 | 0.02 |
| 53 | 127110 | 广核转债 | 23,210.72 | 0.02 |
| 54 | 113661 | 福 22 转债 | 23,200.03 | 0.02 |
| 55 | 123149 | 通裕转债 | 23,104.14 | 0.02 |
| 56 | 118032 | 建龙转债 | 23,069.90 | 0.02 |
| 57 | 113649 | 丰山转债 | 22,984.35 | 0.02 |
| 58 | 123179 | 立高转债 | 22,962.23 | 0.02 |
| 59 | 127034 | 绿茵转债 | 22,948.69 | 0.02 |
| 60 | 127054 | 双箭转债 | 22,907.40 | 0.02 |
| 61 | 111017 | 蓝天转债 | 22,884.21 | 0.02 |
| 62 | 123155 | 中陆转债 | 22,871.52 | 0.02 |
| 63 | 113655 | 欧 22 转债 | 22,774.33 | 0.02 |
| 64 | 113650 | 博 22 转债 | 22,743.62 | 0.02 |
| 65 | 127102 | 浙建转债 | 22,738.86 | 0.02 |
| 66 | 123144 | 裕兴转债 | 22,641.90 | 0.02 |
| 67 | 113048 | 晶科转债 | 22,601.15 | 0.02 |
| 68 | 110085 | 通 22 转债 | 22,556.80 | 0.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 69 | 113679 | 芯能转债 | 22,495.54 | 0.02 |
| 70 | 127030 | 盛虹转债 | 22,481.21 | 0.02 |
| 71 | 123151 | 康医转债 | 22,451.18 | 0.02 |
| 72 | 127099 | 盛航转债 | 22,406.91 | 0.02 |
| 73 | 110097 | 天润转债 | 22,203.97 | 0.02 |
| 74 | 113686 | 泰瑞转债 | 22,067.92 | 0.02 |
| 75 | 113659 | 莱克转债 | 22,067.23 | 0.02 |
| 76 | 127068 | 顺博转债 | 22,060.74 | 0.02 |
| 77 | 127105 | 龙星转债 | 22,020.84 | 0.02 |
| 78 | 127072 | 博实转债 | 21,978.54 | 0.02 |
| 79 | 110084 | 贵燃转债 | 21,961.75 | 0.02 |
| 80 | 123133 | 佩蒂转债 | 21,739.69 | 0.02 |
| 81 | 113640 | 苏利转债 | 21,703.06 | 0.02 |
| 82 | 118024 | 冠宇转债 | 21,679.99 | 0.02 |
| 83 | 123114 | 三角转债 | 21,621.28 | 0.02 |
| 84 | 113648 | 巨星转债 | 21,523.98 | 0.02 |
| 85 | 127084 | 柳工转 2 | 21,519.69 | 0.02 |
| 86 | 113691 | 和邦转债 | 21,478.47 | 0.02 |
| 87 | 113692 | 保隆转债 | 21,428.55 | 0.02 |
| 88 | 127069 | 小熊转债 | 21,420.68 | 0.02 |
| 89 | 111021 | 奥锐转债 | 21,300.40 | 0.02 |
| 90 | 110090 | 爱迪转债 | 21,230.67 | 0.02 |
| 91 | 113674 | 华设转债 | 21,212.04 | 0.02 |
| 92 | 113682 | 益丰转债 | 21,199.42 | 0.02 |
| 93 | 113665 | 汇通转债 | 21,102.68 | 0.02 |
| 94 | 123150 | 九强转债 | 21,087.81 | 0.02 |
| 95 | 127060 | 湘佳转债 | 21,004.97 | 0.02 |
| 96 | 110098 | 南药转债 | 20,997.68 | 0.02 |
| 97 | 113696 | 伯 25 转债 | 20,982.48 | 0.02 |
| 98 | 113656 | 嘉诚转债 | 20,955.87 | 0.02 |
| 99 | 113059 | 福莱转债 | 20,921.16 | 0.02 |
| 100 | 123165 | 回天转债 | 20,880.72 | 0.02 |
| 101 | 113670 | 金 23 转债 | 20,716.04 | 0.02 |
| 102 | 113660 | 寿 22 转债 | 20,715.43 | 0.02 |
| 103 | 127082 | 亚科转债 | 20,671.56 | 0.02 |
| 104 | 127095 | 广泰转债 | 20,574.03 | 0.02 |
| 105 | 127056 | 中特转债 | 20,570.76 | 0.02 |
| 106 | 127083 | 山路转债 | 20,567.95 | 0.02 |
| 107 | 123154 | 火星转债 | 20,563.18 | 0.02 |
| 108 | 127109 | 电化转债 | 20,553.93 | 0.02 |
| 109 | 113053 | 隆 22 转债 | 20,517.00 | 0.02 |
| 110 | 110086 | 精工转债 | 20,515.45 | 0.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 111 | 123193 | 海能转债 | 20,467.55 | 0.02 |
| 112 | 113652 | 伟 22 转债 | 20,459.52 | 0.02 |
| 113 | 123257 | 安克转债 | 20,454.53 | 0.02 |
| 114 | 113680 | 丽岛转债 | 20,331.21 | 0.02 |
| 115 | 123252 | 银邦转债 | 20,247.05 | 0.02 |
| 116 | 127111 | 金威转债 | 20,033.64 | 0.02 |
| 117 | 127078 | 优彩转债 | 19,969.05 | 0.02 |
| 118 | 118042 | 奥维转债 | 19,952.15 | 0.02 |
| 119 | 113695 | 华辰转债 | 19,812.84 | 0.02 |
| 120 | 113694 | 清源转债 | 19,760.69 | 0.02 |
| 121 | 113067 | 燃 23 转债 | 19,707.77 | 0.02 |
| 122 | 111020 | 合顺转债 | 19,556.17 | 0.02 |
| 123 | 113643 | 风语转债 | 19,463.20 | 0.02 |
| 124 | 127108 | 太能转债 | 19,413.43 | 0.02 |
| 125 | 123199 | 山河转债 | 19,359.89 | 0.02 |
| 126 | 123215 | 铭利转债 | 19,354.24 | 0.02 |
| 127 | 123214 | 东宝转债 | 19,320.58 | 0.02 |
| 128 | 123160 | 泰福转债 | 19,319.57 | 0.02 |
| 129 | 113693 | 志邦转债 | 19,317.74 | 0.02 |
| 130 | 118016 | 京源转债 | 19,209.10 | 0.01 |
| 131 | 113666 | 爱玛转债 | 19,152.53 | 0.01 |
| 132 | 123262 | 神宇转债 | 19,130.83 | 0.01 |
| 133 | 123253 | 永贵转债 | 19,126.06 | 0.01 |
| 134 | 118010 | 洁特转债 | 19,013.22 | 0.01 |
| 135 | 127112 | 尚太转债 | 18,984.43 | 0.01 |
| 136 | 123266 | 博士转债 | 18,900.44 | 0.01 |
| 137 | 127045 | 牧原转债 | 18,873.86 | 0.01 |
| 138 | 127064 | 杭氧转债 | 18,849.96 | 0.01 |
| 139 | 123196 | 正元转 02 | 18,834.86 | 0.01 |
| 140 | 110099 | 福能转债 | 18,797.32 | 0.01 |
| 141 | 118012 | 微芯转债 | 18,708.58 | 0.01 |
| 142 | 123189 | 晓鸣转债 | 18,673.51 | 0.01 |
| 143 | 113070 | 渝水转债 | 18,385.85 | 0.01 |
| 144 | 113688 | 国检转债 | 18,329.64 | 0.01 |
| 145 | 127098 | 欧晶转债 | 18,246.80 | 0.01 |
| 146 | 123109 | 昌红转债 | 18,200.46 | 0.01 |
| 147 | 123264 | 双乐转债 | 18,168.35 | 0.01 |
| 148 | 123235 | 亿田转债 | 18,160.25 | 0.01 |
| 149 | 123263 | 鼎捷转债 | 17,953.63 | 0.01 |
| 150 | 123180 | 浙矿转债 | 17,797.82 | 0.01 |
| 151 | 113700 | 海天转债 | 17,729.90 | 0.01 |
| 152 | 111003 | 聚合转债 | 17,698.16 | 0.01 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 153 | 123245 | 集智转债 | 17,672.76 | 0.01 |
| 154 | 123224 | 宇邦转债 | 17,501.21 | 0.01 |
| 155 | 118037 | 上声转债 | 17,447.51 | 0.01 |
| 156 | 123213 | 天源转债 | 17,360.26 | 0.01 |
| 157 | 113698 | 凯众转债 | 17,336.96 | 0.01 |
| 158 | 113671 | 武进转债 | 17,279.20 | 0.01 |
| 159 | 123237 | 佳禾转债 | 17,268.35 | 0.01 |
| 160 | 111024 | 澳弘转债 | 16,801.10 | 0.01 |
| 161 | 123211 | 阳谷转债 | 16,136.67 | 0.01 |
| 162 | 118051 | 皓元转债 | 14,904.46 | 0.01 |
| 163 | 118062 | 天准转债 | 12,423.88 | 0.01 |
| 164 | 123247 | 万凯转债 | 10,744.85 | 0.01 |

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 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。

## §6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 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 | 166002 | 中欧新蓝筹混合 A | 契约型开放式 | 730,000.00 | 2,298,259.00 | 1.79 | 是 |
| 2 | 001810 | 中欧潜力价值灵活配置混合 A | 契约型开放式 | 800,000.00 | 1,778,000.00 | 1.38 | 是 |
| 3 | 004814 | 中欧红利优享灵活配置混合 A | 契约型开放式 | 484,550.61 | 965,467.09 | 0.75 | 是 |

注：本基金为混合型基金，本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金，本基金管理人根据基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期投资基金的情况。

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日 | 其中：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 |
|---|---|---|
| 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） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 15,940.52 | 15,940.52 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 2,656.80 | 2,656.80 |

### 6.3 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。 |

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中欧招益稳健一年持有混合 A | 中欧招益稳健一年持有混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 93,870,794.90 | 22,257,878.51 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,081,290.63 | 311,014.28 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,354,923.69 | 930,212.08 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 91,597,161.84 | 21,638,680.71 |

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。

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无交易本基金的情况。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §10 备查文件目录

## 10.1 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

## 10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 10.3 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 10 月 27 日**