中欧聚瑞债券型证券投资基金
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	中欧聚瑞债券		
基金主代码	005419		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 8 月 2 日		
报告期末基金份额总额	421,346,881.16 份		
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。		
业绩比较基准	中债综合指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。		
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	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
下属分级基金的交易代码	005419	005420	019474
报告期末下属分级基金的份额总额	307,726,458.18 份	1,788,805.43 份	111,831,617.55 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）		
	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
1.本期已实现收益	-1,155,984.86	-5,009.49	-480,469.28
2.本期利润	-778,310.17	-7,097.57	-354,904.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0025	-0.0080	-0.0032
4.期末基金资产净值	328,239,252.24	1,839,707.56	118,903,568.17
5.期末基金份额净值	1.0667	1.0285	1.0632

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

中欧聚瑞债券 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	-0.24%	0.13%	0.52%	0.03%	-0.76%	0.10%
过去六个月	-0.70%	0.15%	1.15%	0.03%	-1.85%	0.12%
过去一年	0.38%	0.11%	1.48%	0.04%	-1.10%	0.07%
过去三年	6.12%	0.08%	5.66%	0.07%	0.46%	0.01%
过去五年	12.37%	0.07%	8.15%	0.07%	4.22%	0.00%
过去七年	17.12%	0.06%	10.36%	0.07%	6.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.21%	0.06%	13.02%	0.07%	4.19%	-0.01%

中欧聚瑞债券 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	-0.37%	0.13%	0.52%	0.03%	-0.89%	0.10%

过去六个月	-0.94%	0.15%	1.15%	0.03%	-2.09%	0.12%
过去一年	-0.20%	0.11%	1.48%	0.04%	-1.68%	0.07%
过去三年	4.48%	0.08%	5.66%	0.07%	-1.18%	0.01%
过去五年	9.54%	0.07%	8.15%	0.07%	1.39%	0.00%
过去七年	13.43%	0.06%	10.36%	0.07%	3.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.26%	0.06%	13.02%	0.07%	0.24%	-0.01%

中欧聚瑞债券 D

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	-0.30%	0.13%	0.52%	0.03%	-0.82%	0.10%
过去六个月	-0.80%	0.15%	1.15%	0.03%	-1.95%	0.12%
过去一年	0.23%	0.11%	1.48%	0.04%	-1.25%	0.07%
过去三年	5.78%	0.08%	5.66%	0.07%	0.12%	0.01%
自基金份额起始运作日至今	5.95%	0.08%	5.47%	0.07%	0.48%	0.01%

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


中欧聚瑞债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
18.00%
16.00%
14.00%
12.00%
10.00%
8.00%
6.00%
4.00%
2.00%
0.00%
2018-08-02
2019-12-11
2021-04-20
2022-08-29
2024-01-07
2025-05-17
2026-09-30
中欧聚瑞债券A累计净值增长率
中欧聚瑞债券A累计业绩基准收益率


中欧聚瑞债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
14.00%
12.00%
10.00%
8.00%
6.00%
4.00%
2.00%
0.00%
-2.00%
2018-08-02
2019-12-11
2021-04-20
2022-08-29
2024-01-07
2025-05-17
2026-09-30
中欧聚瑞债券C累计净值增长率
中欧聚瑞债券C累计业绩基准收益率



注：本基金于 2023 年 9 月 9 日新增 D 类份额，图示日期为 2023 年 9 月 14 日至 2026 年 09 月 30 日。

§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		
李波	基金经理/基金经理助理	2026-02-09	-	9 年	历任海通证券股份有限公司研究所固定收益分析师。2020-04-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员。
袁田	基金经理/基金经理助理	2026-07-29	-	9 年	历任上海光大证券资产管理有限公司信用研究员。2020-08-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理助理。
苏佳	基金经理/基金经理助理	2025-05-21	2026-07-29	10 年	历任广发银行股份有限公司总行金融机构部行员，易方达基金管理有限公司投资支持专员，易方达基金管理有限公司投资经理助理。2023-05-24 加入中欧基金管理有限公司。
雷志强	固收投决会委员/利率组组长/指数组组长/基金经理	2025-08-13	-	15 年	历任交通银行股份有限公司总行资产负债管理部高级定价管理经理，兴业基金管理有限公司固定收益投资部货币与利率团队副总监、基金经理。2024-01-25 加入中欧基金管理有限公司。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起

即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中李波担任本基金的基金经理;袁田担任本基金的基金经理;苏佳担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 年三季度权益市场震荡下行，风格相比二季度大幅逆转。以双创为代表的科技板块单季度有比较大的跌幅，而价值风格有所回暖，市场的结构分化出现再平衡。我们认为，三季度市场受到了外部环境和宏观层面的压力，但并非主要矛盾。尽管三季度油价触底反弹，但并未超出上半年的高点；美联储加息落地，但也没有完全进入加息周期。市场三季度整体表现不佳，核心还是 A 股本身的微观结构，或者说流动性层面的压力。在缺乏增量资金的背景下，科技的筹码经历了一个季度的出清，资金则流向其他板块。市场从极致的景气交易回到相对均衡的状态，三季度

的热点行业中，既有煤炭、石油等短期景气方向，也有银行等防御性板块，整体风险偏好相对二季度有明显的回落。

展望四季度，我们认为围绕科技和价值之间风格的再平衡可能又会重现。经历一个季度的消化后，科技的拥挤度已经大幅下降，筹码层面的压力有一定的缓解。而且季度层面来看，成长和价值的分化程度也来到历史极值附近（成长大幅跑输价值），和二季度基本是镜像关系。从这个角度来看，四季度我们对科技板块并不悲观。只不过在外部环境不确定，市场缺乏增量资金的背景下，信心的修复需要时间，反弹也很难一蹴而就。

转债层面，三季度整体出现比较大幅度的下跌，尤其是估值端有比较明显的下降。转债三季度的表现反映出了其在高估值背景下的困境，而相对高的估值加大了其对于权益预期的敏感性。三季度虽然转债对应的权益风格并未出现明显下跌，但预期的转弱使得估值的支撑下降，转债也出现了一段独立于权益的下跌。

操作层面，组合三季度转债仓位有一定的下降。但对于四季度的转债市场我们并不悲观，转债的估值消化已经接近尾声，结合对权益的判断，四季度可能会有一轮交易性的机会，仓位可能会择机提升。

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-0.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；基金 C 类份额净值增长率为-0.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；基金 D 类份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	497,620,027.29	99.05
	其中：债券	497,620,027.29	99.05
	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	4,317,521.80	0.86
8	其他资产	438,416.78	0.09
9	合计	502,375,965.87	100.00

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	50,403,887.76	11.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	113,008,077.81	25.17
	其中：政策性金融债	31,210,410.96	6.95
4	企业债券	65,949,347.13	14.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	202,553,817.54	45.11
7	可转债（可交换债）	50,187,945.97	11.18
8	同业存单	-	-
9	其他	15,516,951.08	3.46
10	合计	497,620,027.29	110.83

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	2600006	26 超长特别国债 06	250,000	25,288,328.80	5.63
2	019827	26 国债 01	249,000	25,115,558.96	5.59
3	232480003	24 恒丰银行二级资本债 01	200,000	21,008,986.30	4.68
4	102482187	24 长春轨交 MTN001B	200,000	20,745,937.53	4.62

5	102482884	24 张家国资 MTN001	200,000	20,459,698.63	4.56

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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9.2 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。

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行(国家外汇管理局宁波市分局)的处罚。中国工商银行股份有限公司在

报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、国家外汇管理局北京市分局)的处罚。

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

5.11.2

截止本报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,418.96
2	应收证券清算款	409,997.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	438,416.78

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	127103	东南转债	582,131.56	0.13
2	127055	精装转债	558,020.99	0.12
3	123178	花园转债	541,481.64	0.12
4	123176	精测转 2	487,500.34	0.11
5	118059	颀中转债	474,134.68	0.11
6	123245	集智转债	473,629.98	0.11
7	123255	鼎龙转债	446,070.60	0.10
8	118062	天准转债	441,047.56	0.10
9	123158	宙邦转债	436,599.49	0.10
10	118056	路维转债	418,590.63	0.09
11	113677	华懋转债	384,384.81	0.09
12	118058	微导转债	345,091.42	0.08
13	113633	科沃转债	335,143.30	0.07
14	127111	金威转债	325,880.58	0.07
15	123172	漱玉转债	316,088.22	0.07
16	113056	重银转债	313,330.14	0.07
17	123243	严牌转债	311,234.46	0.07
18	123113	仙乐转债	308,482.71	0.07

19	113054	绿动转债	308,152.84	0.07
20	113049	长汽转债	307,444.49	0.07
21	123183	海顺转债	305,851.42	0.07
22	118022	锂科转债	305,484.46	0.07
23	118031	天 23 转债	304,450.03	0.07
24	113042	上银转债	304,255.11	0.07
25	123168	惠云转债	302,702.09	0.07
26	123192	科思转债	301,281.87	0.07
27	127030	盛虹转债	300,124.09	0.07
28	127049	希望转 2	300,067.95	0.07
29	118035	国力转债	297,547.11	0.07
30	113052	兴业转债	296,535.33	0.07
31	113634	珀莱转债	295,467.70	0.07
32	113636	甬金转债	293,692.60	0.07
33	127040	国泰转债	291,606.81	0.06
34	123119	康泰转 2	290,648.20	0.06
35	111004	明新转债	290,452.14	0.06
36	123117	健帆转债	290,091.14	0.06
37	113647	禾丰转债	289,797.81	0.06
38	113627	太平转债	288,178.82	0.06
39	113625	江山转债	287,760.43	0.06
40	113638	台 21 转债	287,709.30	0.06
41	111015	东亚转债	287,271.42	0.06
42	113631	皖天转债	285,798.18	0.06
43	111000	起帆转债	285,712.60	0.06
44	127031	洋丰转债	285,271.25	0.06
45	127050	麒麟转债	285,259.79	0.06
46	113066	平煤转债	283,257.00	0.06
47	111018	华康转债	283,201.21	0.06
48	113655	欧 22 转债	282,881.11	0.06
49	111002	特纸转债	281,730.84	0.06
50	127085	韵达转债	279,866.11	0.06
51	127062	垒知转债	279,120.22	0.06
52	110093	神马转债	279,040.62	0.06
53	123216	科顺转债	277,859.53	0.06
54	113062	常银转债	277,682.34	0.06
55	127059	永东转 2	277,601.43	0.06
56	111009	盛泰转债	277,077.22	0.06
57	123122	富瀚转债	275,823.60	0.06
58	111014	李子转债	275,513.85	0.06
59	113058	友发转债	275,177.40	0.06
60	127044	蒙娜转债	272,574.96	0.06

61	123160	泰福转债	272,083.98	0.06
62	127110	广核转债	271,701.95	0.06
63	123149	通裕转债	270,831.91	0.06
64	118032	建龙转债	270,767.82	0.06
65	123179	立高转债	270,712.59	0.06
66	127054	双箭转债	270,066.24	0.06
67	123194	百洋转债	269,868.14	0.06
68	110097	天润转债	269,223.10	0.06
69	118005	天奈转债	269,113.82	0.06
70	123225	翔丰转债	269,100.53	0.06
71	123151	康医转债	268,232.53	0.06
72	113640	苏利转债	268,096.64	0.06
73	113679	芯能转债	267,446.94	0.06
74	123133	佩蒂转债	267,270.35	0.06
75	113649	丰山转债	266,873.82	0.06
76	123155	中陆转债	266,834.34	0.06
77	110087	天业转债	266,410.04	0.06
78	110095	双良转债	264,510.21	0.06
79	113048	晶科转债	264,433.46	0.06
80	123154	火星转债	263,692.50	0.06
81	127034	绿茵转债	263,306.07	0.06
82	123144	裕兴转债	262,897.66	0.06
83	113659	莱克转债	262,210.67	0.06
84	113650	博 22 转债	262,150.20	0.06
85	127102	浙建转债	260,898.52	0.06
86	110085	通 22 转债	260,531.04	0.06
87	127099	盛航转债	259,656.52	0.06
88	127069	小熊转债	259,568.18	0.06
89	110100	龙建转债	258,641.62	0.06
90	113059	福莱转债	258,027.62	0.06
91	113661	福 22 转债	257,778.08	0.06
92	127046	百润转债	256,995.41	0.06
93	127083	山路转债	254,074.68	0.06
94	127060	湘佳转债	253,295.19	0.06
95	118024	冠宇转债	252,933.21	0.06
96	110084	贵燃转债	251,914.20	0.06
97	127068	顺博转债	249,634.73	0.06
98	113674	华设转债	249,553.42	0.06
99	111017	蓝天转债	249,183.66	0.06
100	113670	金 23 转债	247,373.85	0.06
101	113691	和邦转债	247,002.36	0.06
102	113696	伯 25 转债	246,544.13	0.05

103	123150	九强转债	246,463.80	0.05
104	123107	温氏转债	244,174.80	0.05
105	113682	益丰转债	243,169.81	0.05
106	123252	银邦转债	242,964.64	0.05
107	127109	电化转债	242,242.78	0.05
108	123165	回天转债	241,433.36	0.05
109	113680	丽岛转债	241,263.64	0.05
110	127105	龙星转债	240,933.85	0.05
111	127084	柳工转 2	240,751.57	0.05
112	113652	伟 22 转债	240,700.22	0.05
113	123114	三角转债	240,236.44	0.05
114	113648	巨星转债	240,162.31	0.05
115	110098	南药转债	240,160.93	0.05
116	113665	汇通转债	239,577.51	0.05
117	113660	寿 22 转债	238,836.74	0.05
118	113656	嘉诚转债	238,664.09	0.05
119	111021	奥锐转债	238,298.19	0.05
120	113053	隆 22 转债	238,225.19	0.05
121	127108	太能转债	237,814.53	0.05
122	118050	航宇转债	237,284.58	0.05
123	123193	海能转债	236,656.05	0.05
124	113692	保隆转债	235,714.01	0.05
125	110086	精工转债	235,324.29	0.05
126	127056	中特转债	234,748.72	0.05
127	113694	清源转债	234,658.17	0.05
128	127095	广泰转债	234,543.93	0.05
129	113686	泰瑞转债	233,919.93	0.05
130	127082	亚科转债	233,847.04	0.05
131	123214	东宝转债	230,558.87	0.05
132	110090	爱迪转债	229,790.79	0.05
133	123257	安克转债	229,382.98	0.05
134	127078	优彩转债	228,876.00	0.05
135	127045	牧原转债	228,845.59	0.05
136	118042	奥维转债	228,202.75	0.05
137	113643	风语转债	227,997.52	0.05
138	118016	京源转债	227,553.99	0.05
139	123196	正元转 02	227,274.01	0.05
140	113693	志邦转债	225,776.12	0.05
141	113067	燃 23 转债	225,407.67	0.05
142	123199	山河转债	224,021.59	0.05
143	113695	华辰转债	222,186.87	0.05
144	123262	神宇转债	220,642.26	0.05

145	113666	爱玛转债	220,254.05	0.05
146	113070	渝水转债	219,404.47	0.05
147	111020	合顺转债	219,029.15	0.05
148	127064	杭氧转债	218,121.02	0.05
149	123253	永贵转债	218,037.13	0.05
150	118010	洁特转债	218,018.25	0.05
151	123189	晓鸣转债	217,413.06	0.05
152	123215	铭利转债	216,525.51	0.05
153	123109	昌红转债	215,805.46	0.05
154	123180	浙矿转债	214,845.07	0.05
155	110099	福能转债	212,554.27	0.05
156	113700	海天转债	211,492.41	0.05
157	123224	宇邦转债	211,360.80	0.05
158	123092	天壕转债	210,199.98	0.05
159	123237	佳禾转债	209,876.81	0.05
160	123266	博士转债	207,904.89	0.05
161	118012	微芯转债	207,233.56	0.05
162	111003	聚合转债	205,570.99	0.05
163	118037	上声转债	204,385.16	0.05
164	127098	欧晶转债	203,147.68	0.05
165	113688	国检转债	202,935.26	0.05
166	123264	双乐转债	202,274.24	0.05
167	123235	亿田转债	201,578.74	0.04
168	113671	武进转债	201,179.29	0.04
169	113698	凯众转债	198,708.20	0.04
170	123211	阳谷转债	198,040.93	0.04
171	118051	皓元转债	196,738.84	0.04
172	123213	天源转债	195,922.92	0.04
173	111024	澳弘转债	192,279.24	0.04
174	123247	万凯转债	134,310.62	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
报告期期初基金份额总额	307,154,344.17	794,738.25	111,839,426.81
报告期期间基金总申购份额	23,334,131.64	994,077.76	312.50
减:报告期期间基金总赎回份额	22,762,017.63	10.58	8,121.76
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	307,726,458.18	1,788,805.43	111,831,617.55

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	中欧聚瑞债券 A	中欧聚瑞债券 C	中欧聚瑞债券 D
报告期期初管理人持有的本基金份额	139,242.01	151,607.03	140,884.76
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	139,242.01	151,607.03	140,884.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.05	8.48	0.13

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09	158,767,188.96	0.00	0.00	158,767,188.96	37.68%

		月 30 日					
	2	2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日	185,717,336.80	0.00	0.00	185,717,336.80	44.08%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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