中欧安财定期开放债券型发起式证券投资基金
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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	中欧安财债券
基金主代码	005964
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2018 年 5 月 15 日
报告期末基金份额总额	4,185,996,989.67 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	本基金管理人将根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，"自上而下"在各类债券资产类别之间进行类属配置，"自下而上"进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。当市场收益率上行时，基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值，以回避一定的市场风险。
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	8,405,125.48
2.本期利润	10,050,958.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055
4.期末基金资产净值	4,327,285,399.12
5.期末基金份额净值	1.0338

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

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	0.58%	0.07%	0.52%	0.03%	0.06%	0.04%
过去六个月	1.37%	0.07%	1.15%	0.03%	0.22%	0.04%
过去一年	3.11%	0.08%	1.48%	0.04%	1.63%	0.04%
过去三年	13.21%	0.09%	5.66%	0.07%	7.55%	0.02%
过去五年	19.67%	0.08%	8.15%	0.07%	11.52%	0.01%
过去七年	29.92%	0.09%	10.36%	0.07%	19.56%	0.02%
自基金合同生效起至今	44.52%	0.08%	14.45%	0.07%	30.07%	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



§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		
胡阗洋	基金经理/基金经理助理	2022-03-01	-	10 年	历任中诚宝捷思货币经纪有限公司经纪人，上海光大证券资产管理有限公司交易员。2020-11-13 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，其中胡阗洋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 年三季度国内权益市场经历了一轮剧烈的风格切换与去杠杆过程，整体呈现“冲高回落、结构分化”特征：主要宽基指数全线收跌，其中科创 50 单季度大跌 30.7%、创业板指下跌 27.8%，双双创下历史最大季度跌幅，上证指数相对抗跌但也下跌 6.16%。行业表现同样极致分化，前期拥挤的科技成长赛道深度回调，而前期表现低迷的价值类、周期板块则承接了分流资金。资金面上，核心矛盾在于极致拥挤的算力交易遭遇全球性杠杆出清，北向资金季度末呈净流出态势。

与此相对，债券市场在基本面弱现实、货币宽松预期叠加避险资产较为稀缺的格局下走出债牛行情，长端收益率连创年内新低，信用利差普遍收窄。债市走强的核心支撑来自三方面：一是基本面“弱修复”格局延续，投资与消费数据降温，实体融资需求不足；二是货币政策维持适度宽松，央行三季度公开市场净投放超 7000 亿元，MLF 与买断式逆回购是投放主力，资金面整体稳定宽松，DR001 围绕 1.4%窄幅波动；三是机构优质资产较为稀缺的逻辑持续演绎，摊余成本法债基重启与信用债 ETF 规模增长为市场带来增量配置力量。除此之外，由于票息保护不足，机构进一步向久期要收益，长久期、高票息且能兼顾部分流动性的资产因此获得追捧。

转债市场整体跟随权益市场调整，且表现相对更弱。市场调整的核心逻辑在于正股走弱与估值压缩的“双杀”：9 月转债算术平均平价较上月下降 4.34%，而 90 至 125 元平价区间的平均转股溢价率压缩 7.41 个百分点，高价偏股型转债的估值修正幅度尤为显著。行业层面分化极致，通信、电子转债跌幅居前，而银行、医药等防御型品种凭借正股基本面支撑与债底防护逆势抗跌，公用事业等低波板块同样展现出较强防御属性。

组合操作层面，债券方面，三季度通过国债期货和长久期利率债的波段交易取得了较好的收

益增厚；除此之外，组合增配 5Y 附近高等级信用债和二永债，阶段性提高了 4-7Y 久期资产的占比，在兼顾流动性和久期上选择了恰当资产。转债层面，组合以等权指数为锚且配置较为均衡，仓位虽然低配，但在当前极致行情中仍形成一定拖累。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金份额净值增长率为 0.58%，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	5,895,162,454.89	98.37
	其中：债券	5,895,162,454.89	98.37
	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	97,347,311.41	1.62
8	其他资产	95,272.63	0.00
9	合计	5,992,605,038.93	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,274,047,088.17	52.55
	其中：政策性金融债	855,664,805.47	19.77
4	企业债券	988,806,043.86	22.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,329,158,883.84	53.82
7	可转债（可交换债）	303,150,439.02	7.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,895,162,454.89	136.23

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	250220	25 国开 20	2,200,000	222,449,052.05	5.14
2	250208	25 国开 08	1,500,000	151,071,164.38	3.49
3	232680011	26 建行二级资本债 01BC	1,300,000	131,406,913.42	3.04
4	260208	26 国开 08	1,300,000	130,561,315.07	3.02
5	245241	26 国保 02	1,200,000	120,596,843.83	2.79

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将根据风险管理的原则，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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					2,911,320.78
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以争取回避市场风险。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，以力争相应债券组合的超额收益。

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，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、国家外汇管理局北京市分局)的处罚。广发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、中国人民银行广东省分行(国家外汇管理局广东省分局、中国人民银行广东省分行营业管理部)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	95,272.63
2	应收证券清算款	-
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	95,272.63

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	113056	重银转债	2,173,257.83	0.05
2	118031	天 23 转债	2,148,714.62	0.05
3	123172	漱玉转债	2,148,082.86	0.05
4	123113	仙乐转债	2,134,610.30	0.05
5	123119	康泰转 2	2,134,188.20	0.05
6	118022	锂科转债	2,132,561.38	0.05
7	127049	希望转 2	2,121,057.95	0.05
8	113634	珀莱转债	2,107,432.25	0.05
9	111015	东亚转债	2,097,347.35	0.05
10	113042	上银转债	2,095,718.56	0.05
11	113638	台 21 转债	2,094,283.98	0.05
12	113049	长汽转债	2,093,803.01	0.05
13	113627	太平转债	2,084,346.84	0.05
14	127040	国泰转债	2,081,748.58	0.05
15	113054	绿动转债	2,077,269.33	0.05
16	110093	神马转债	2,077,042.94	0.05
17	111000	起帆转债	2,076,353.81	0.05
18	113636	甬金转债	2,071,373.80	0.05
19	123117	健帆转债	2,066,762.56	0.05
20	113633	科沃转债	2,045,376.19	0.05
21	111004	明新转债	2,045,047.09	0.05
22	111002	特纸转债	2,042,882.41	0.05
23	113631	皖天转债	2,042,539.28	0.05
24	113647	禾丰转债	2,041,335.76	0.05
25	111018	华康转债	2,029,198.20	0.05
26	127050	麒麟转债	2,028,910.27	0.05
27	110087	天业转债	2,020,876.13	0.05
28	123192	科思转债	2,013,300.72	0.05

29	113066	平煤转债	2,004,799.53	0.05
30	123225	翔丰转债	2,002,383.98	0.05
31	113058	友发转债	2,001,059.64	0.05
32	127059	永东转 2	2,000,991.30	0.05
33	123183	海顺转债	2,000,294.11	0.05
34	123122	富瀚转债	1,996,257.56	0.05
35	127085	韵达转债	1,990,849.46	0.05
36	123243	严牌转债	1,987,884.63	0.05
37	123168	惠云转债	1,986,641.47	0.05
38	127044	蒙娜转债	1,984,481.44	0.05
39	127103	东南转债	1,983,461.83	0.05
40	113625	江山转债	1,979,653.09	0.05
41	113062	常银转债	1,979,279.14	0.05
42	123216	科顺转债	1,976,166.86	0.05
43	110095	双良转债	1,969,756.85	0.05
44	113052	兴业转债	1,964,829.53	0.05
45	113650	博 22 转债	1,949,966.56	0.05
46	127054	双箭转债	1,947,129.40	0.04
47	111009	盛泰转债	1,944,359.27	0.04
48	123178	花园转债	1,935,657.30	0.04
49	118032	建龙转债	1,934,229.33	0.04
50	113686	泰瑞转债	1,922,851.24	0.04
51	123144	裕兴转债	1,919,530.32	0.04
52	111014	李子转债	1,917,815.97	0.04
53	123155	中陆转债	1,912,312.79	0.04
54	110100	龙建转债	1,907,190.66	0.04
55	123149	通裕转债	1,906,091.89	0.04
56	127110	广核转债	1,903,279.00	0.04
57	127062	垒知转债	1,900,734.57	0.04
58	127072	博实转债	1,897,911.24	0.04
59	123179	立高转债	1,896,196.68	0.04
60	123194	百洋转债	1,893,186.65	0.04
61	111017	蓝天转债	1,891,761.67	0.04
62	118035	国力转债	1,891,238.46	0.04
63	113048	晶科转债	1,886,066.02	0.04
64	113649	丰山转债	1,884,716.53	0.04
65	123151	康医转债	1,881,172.62	0.04
66	127034	绿茵转债	1,869,714.69	0.04
67	127105	龙星转债	1,863,998.99	0.04
68	110085	通 22 转债	1,857,552.48	0.04
69	113661	福 22 转债	1,856,002.19	0.04
70	127099	盛航转债	1,851,865.06	0.04

71	127102	浙建转债	1,851,422.05	0.04
72	113640	苏利转债	1,851,143.49	0.04
73	113655	欧 22 转债	1,844,720.45	0.04
74	123133	佩蒂转债	1,844,037.50	0.04
75	118005	天奈转债	1,837,313.48	0.04
76	110097	天润转债	1,835,990.53	0.04
77	127030	盛虹转债	1,831,094.19	0.04
78	113679	芯能转债	1,829,637.01	0.04
79	110084	贵燃转债	1,818,949.68	0.04
80	127060	湘佳转债	1,812,605.10	0.04
81	127084	柳工转 2	1,807,654.22	0.04
82	127068	顺博转债	1,798,298.95	0.04
83	113674	华设转债	1,796,784.66	0.04
84	111021	奥锐转债	1,790,564.60	0.04
85	113691	和邦转债	1,789,424.68	0.04
86	127095	广泰转债	1,777,596.09	0.04
87	113659	莱克转债	1,774,465.25	0.04
88	123165	回天转债	1,773,556.43	0.04
89	123114	三角转债	1,772,944.92	0.04
90	127056	中特转债	1,767,875.64	0.04
91	113696	伯 25 转债	1,766,462.44	0.04
92	113648	巨星转债	1,764,966.43	0.04
93	113665	汇通转债	1,757,729.29	0.04
94	110090	爱迪转债	1,752,154.81	0.04
95	118024	冠宇转债	1,734,399.12	0.04
96	113652	伟 22 转债	1,734,245.08	0.04
97	123252	银邦转债	1,731,502.68	0.04
98	127069	小熊转债	1,730,034.54	0.04
99	113059	福莱转债	1,724,833.28	0.04
100	127111	金威转债	1,722,893.25	0.04
101	123150	九强转债	1,718,656.64	0.04
102	113692	保隆转债	1,716,804.73	0.04
103	127082	亚科转债	1,711,863.70	0.04
104	113670	金 23 转债	1,704,807.98	0.04
105	113682	益丰转债	1,704,682.71	0.04
106	113656	嘉诚转债	1,698,589.78	0.04
107	113053	隆 22 转债	1,692,652.64	0.04
108	127083	山路转债	1,684,152.20	0.04
109	110098	南药转债	1,682,438.85	0.04
110	123154	火星转债	1,681,342.10	0.04
111	123193	海能转债	1,674,501.49	0.04
112	113660	寿 22 转债	1,670,638.62	0.04

113	123257	安克转债	1,652,434.07	0.04
114	123262	神宇转债	1,651,628.45	0.04
115	113067	燃 23 转债	1,638,208.73	0.04
116	127078	优彩转债	1,637,461.86	0.04
117	118042	奥维转债	1,637,323.59	0.04
118	127109	电化转债	1,636,973.96	0.04
119	110086	精工转债	1,624,341.00	0.04
120	113694	清源转债	1,621,611.48	0.04
121	111020	合顺转债	1,619,251.20	0.04
122	113680	丽岛转债	1,617,008.54	0.04
123	123214	东宝转债	1,613,912.06	0.04
124	123196	正元转 02	1,608,497.30	0.04
125	127045	牧原转债	1,599,559.89	0.04
126	113643	风语转债	1,586,251.02	0.04
127	123199	山河转债	1,586,128.16	0.04
128	113070	渝水转债	1,586,085.93	0.04
129	127108	太能转债	1,583,407.98	0.04
130	127064	杭氧转债	1,578,011.30	0.04
131	113695	华辰转债	1,565,214.53	0.04
132	113693	志邦转债	1,563,529.78	0.04
133	123253	永贵转债	1,563,237.00	0.04
134	118016	京源转债	1,558,892.57	0.04
135	113666	爱玛转债	1,557,339.77	0.04
136	123109	昌红转债	1,550,939.22	0.04
137	123189	晓鸣转债	1,545,900.24	0.04
138	118012	微芯转债	1,544,177.82	0.04
139	123215	铭利转债	1,543,500.29	0.04
140	110099	福能转债	1,542,825.87	0.04
141	118010	洁特转债	1,536,268.11	0.04
142	123224	宇邦转债	1,536,067.97	0.04
143	127112	尚太转债	1,529,602.92	0.04
144	113700	海天转债	1,524,771.66	0.04
145	111003	聚合转债	1,519,319.34	0.04
146	123235	亿田转债	1,516,380.59	0.04
147	123237	佳禾转债	1,508,987.70	0.03
148	113688	国检转债	1,500,411.65	0.03
149	123160	泰福转债	1,497,266.88	0.03
150	123180	浙矿转债	1,496,287.85	0.03
151	123263	鼎捷转债	1,493,143.35	0.03
152	123245	集智转债	1,480,977.31	0.03
153	127098	欧晶转债	1,480,423.48	0.03
154	123266	博士转债	1,467,484.55	0.03

155	118037	上声转债	1,461,852.37	0.03
156	123264	双乐转债	1,458,312.51	0.03
157	113671	武进转债	1,434,173.83	0.03
158	123211	阳谷转债	1,433,229.56	0.03
159	118051	皓元转债	1,424,866.14	0.03
160	113698	凯众转债	1,417,629.61	0.03
161	111024	澳弘转债	1,308,618.93	0.03
162	123213	天源转债	1,284,659.16	0.03
163	118062	天准转债	1,020,310.74	0.02
164	123247	万凯转债	931,220.27	0.02
165	127027	能化转债	329.77	0.00

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

报告期期初基金份额总额	1,714,621,917.31
报告期期间基金总申购份额	2,471,375,085.19
减：报告期期间基金总赎回份额	12.83
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	4,185,996,989.67

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

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立已满三年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§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

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 09 月 28 日至 2026 年 09 月 30 日	0.00	967,585,776.49	0.00	967,585,776.49	23.11%
	2	2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日	1,460,509,035.67	483,725,514.24	0.00	1,944,234,549.91	46.45%
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。

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