

中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 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 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧沪深 300 指数发起
基金主代码	021877
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2024 年 11 月 29 日
报告期末基金份额总额	139,222,009.97 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为

	指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
下属分级基金的交易代码	021877	021878	022899
报告期末下属分级基金的份额总额	92,997,377.67 份	40,825,684.01 份	5,398,948.29 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		
	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
1. 本期已实现收益	4,066,230.27	1,711,764.96	223,341.52
2. 本期利润	13,867,342.40	5,700,353.03	709,347.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1528	0.1569	0.1489
4. 期末基金资产净值	123,370,719.79	53,943,626.56	7,196,301.07
5. 期末基金份额净值	1.3266	1.3213	1.3329

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

中欧沪深 300 指数发起 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	13.14%	1.20%	11.30%	1.19%	1.84%	0.01%
过去六个月	9.36%	1.08%	7.20%	1.07%	2.16%	0.01%
过去一年	31.29%	0.98%	25.13%	0.97%	6.16%	0.01%

自基金合同 生效起至今	32.66%	0.95%	27.13%	0.96%	5.53%	-0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

中欧沪深 300 指数发起 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	13.08%	1.20%	11.30%	1.19%	1.78%	0.01%
过去六个月	9.23%	1.08%	7.20%	1.07%	2.03%	0.01%
过去一年	30.96%	0.98%	25.13%	0.97%	5.83%	0.01%
自基金合同 生效起至今	32.13%	0.95%	27.13%	0.96%	5.00%	-0.01%

中欧沪深 300 指数发起 Y

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	13.24%	1.20%	11.30%	1.19%	1.94%	0.01%
过去六个月	9.52%	1.08%	7.20%	1.07%	2.32%	0.01%
过去一年	31.70%	0.98%	25.13%	0.97%	6.57%	0.01%
自基金份额 起始运作日 至今	33.25%	0.96%	25.26%	0.96%	7.99%	0.00%

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

中欧沪深300指数发起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



中欧沪深300指数发起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



中欧沪深300指数发起Y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：本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额，图示日期为 2024 年 12 月 16 日至 2026 年 06 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		
宋巍巍	量化投资决策委员/基金经理	2024-11-29	-	9 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券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合规守信情况的说明

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 8 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

二季度沪深 300 指数上涨 11.90%，其中 4 月上涨 8.03%、5 月上涨 1.76%、6 月上涨 1.78%。全季呈现“中东局势缓和、油价回落启动—放量主升—利率冲击反复—季末修复”的节奏。

4 月，指数趋势反转。季初受美国宣布对进口专利药及制药成分加征 100% 关税等扰动，指数于 4 月 3-7 日缩量下探。4 月 8 日成为全季行情的总开关：盘前央行、金融监管总局与中央汇金联合发声，央行明确“坚定支持中央汇金增持指数基金、必要时提供再贷款”，叠加中东局势缓和、油价回落及 AI 产业链一季度业绩预增密集披露，指数放量长阳上涨 3.49% 并留下向上跳空缺口，4 月 10 日，盘前公布 3 月 PPI 同比+0.5% 转正，结束长达 41 个月的负增长，指数跳涨，14 日再度跳空上行。

5 月，指数放量确认主升后转入高位整固。5 月 6 日节后首日高开高走上涨 1.45%，5 月 11 日在沪深两市合计约 3.54 万亿元天量成交推动下上涨 1.64%、上证指数站上 4200 点创逾十年新高。5 月 13 日指数创阶段收盘高点后进入分歧：美国通胀数据超预期，年内降息预期由年初的 3-4 次压缩至 1 次，美债收益率与美元回升、外资呈“边涨边卖”特征；5 月 21 日再度放量下跌，前期领涨的半导体、算力板块获利资金集中兑现，叠加海外美债利率上行扰动风险偏好；月内低点逐步抬高，5 月 25 日跳空修复，全月上涨 1.76%。

6 月，海外利率冲击与国内政策催化交替主导，波动显著放大。6 月 5 日受美国宣布对中日等 60 个经济体加征 10%-12.5% 额外关税、叠加 6 月“超级央行月”（欧、日央行加息动机升温）预期共振，风险偏好回落、指数下跌，银行等防御板块逆势走强；6 月 8 日，前一交易日盘后公布的

美国 5 月非农新增就业 17.2 万人（预期约 8.5 万）大超预期，市场对美联储年内加息概率一度升至九成以上、10 年期美债收益率跳升至 4.5% 上方，同时海外芯片业绩指引偏弱引发“AI 资本开支见顶”担忧、隔夜费城半导体指数暴跌 10.26%、韩国开盘跌超 8% 触发熔断，外围“黑色星期五”情绪传导下指数低开留下全季唯一向下跳空缺口、收跌 2.14%，但当日实体收红、盘中承接有力，该缺口一周后即被回补吞没。6 月 15 日，美伊达成停战谅解备忘录、宣布 6 月 19 日重开霍尔木兹海峡，布伦特原油单日跌超 4%、通胀预期与美债收益率同步下行，高估值算力硬件迎来估值修复、北向资金大幅回流，指数放量长阳上涨 2.39%、一举回补上述缺口。6 月 17-18 日陆家嘴论坛推出一揽子资本市场改革举措（科创板第五套标准扩容至人工智能、主动管理型 ETF 获批、商业 REITs 试点、非银流动性支持工具等），端午假期后首个交易日（6 月 22 日）市场对政策组合拳集中定价、券商领涨，指数放量上涨 2.39%，创季度收盘高点；随后美联储 6 月会议取消降息指引、点阵图显示约半数官员预计年内需要加息，6 月 23 日指数下跌；6 月 26 日多因素共振下杀——美国 5 月 PCE 同比+4.1% 创阶段新高引发“AI 涨价抑制终端需求”担忧、智能手机全球提价加剧产业链利润分配焦虑、日经暴跌逾 3000 点与韩股再度触发熔断情绪外溢，叠加半年末银行 MPA 考核结算下的存量博弈、机构对上半年 AI 利润集中止盈，指数下跌 3.03%、为全季最大单日跌幅；6 月 29-30 日随美股半导体深 V 修复、央行开展大额隔夜逆回购呵护半年末流动性，指数两连阳收官。

整体看，二季度指数上行由 4 月 8 日、5 月 6 日、5 月 11 日等未回补向上缺口逐级推进，6 月的三次外生冲击（关税与央行月、非农、美联储转鹰与监管新规）均未破坏上行结构，每次冲击后的修复动能递增，显示中长期配置资金的承接力量在增强。更深层的原因在于加息预期的性质已经改变：6 月的利率冲击发生在“战争结束、油价回落、经济数据偏强”的组合之下，市场将其解读为经济韧性的确认而非滞胀的前奏，利率脉冲因此只放大波动、不逆转趋势，与季初的单边下探形成本质区别。

展望后市，国内经济延续温和复苏态势，PPI 同比持续加速上行，工业企业盈利修复趋势渐明。4 月政治局会议定调供给侧改革深化与产业升级加速，为企业盈利改善提供结构性支撑。海外方面，美伊停战协议落地缓解了全球通胀的供给端压力，美联储或将在年末进入加息周期，市场的驱动力将从单纯的流动性宽松转向周期盈利驱动。

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 13.14%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%；基金 C 类份额净值增长率为 13.08%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%；基金 Y 类份额净值增长率为 13.24%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%。

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	175,297,468.05	92.28
	其中：股票	175,297,468.05	92.28
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,480,862.52	4.99
	其中：债券	9,480,862.52	4.99
	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	4,402,482.96	2.32
8	其他资产	789,627.38	0.42
9	合计	189,970,440.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	984,733.00	0.53
B	采矿业	7,415,879.90	4.02
C	制造业	111,718,046.38	60.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,366,577.78	2.37
E	建筑业	2,010,224.00	1.09
F	批发和零售业	268,352.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,225,195.00	2.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,463,583.70	5.13
J	金融业	30,561,799.00	16.56
K	房地产业	593,565.00	0.32
L	租赁和商务服务业	801,302.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,929,905.00	1.05
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	246,974.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	105,355.00	0.06
S	综合	—	—
	合计	174,691,491.76	94.68

5.2.2 报告期末积极投资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	14,538.74	0.01
C	制造业	510,168.42	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,088.75	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,277.88	0.00
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	2,902.50	0.00
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	605,976.29	0.33

5.2.3 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 报告期末指数投资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	300308	中际旭创	6,800	8,636,000.00	4.68
2	300750	宁德时代	16,200	6,366,762.00	3.45
3	300502	新易盛	8,500	5,159,500.00	2.80

4	600519	贵州茅台	3,900	4,623,411.00	2.51
5	603986	兆易创新	4,400	3,586,000.00	1.94
6	688256	寒武纪	1,996	3,184,717.80	1.73
7	601318	中国平安	66,000	3,150,840.00	1.71
8	600036	招商银行	76,800	2,726,400.00	1.48
9	601899	紫金矿业	105,000	2,639,700.00	1.43
10	002371	北方华创	2,600	2,299,856.00	1.25

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301666	大普微	244	113,052.52	0.06
2	001248	N 华润新能源	7,625	77,088.75	0.04
3	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.03
4	688818	电科蓝天	528	37,033.92	0.02
5	688820	盛合晶微	236	33,391.64	0.02

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	9,480,862.52	5.14
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,480,862.52	5.14

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	019827	26 国债 01	56,000	5,636,298.74	3.05
2	019785	25 国债 13	22,000	2,227,776.05	1.21
3	019792	25 国债 19	16,000	1,616,787.73	0.88

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持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货交易。

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，招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规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	19,134.28
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	770,493.10
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	789,627.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	113,052.52	0.06	新股流通受限
2	001248	N 华润新能源	77,088.75	0.04	新股未上市
3	688808	联讯仪器	63,373.20	0.03	新股流通受限
4	688818	电科蓝天	37,033.92	0.02	新股流通受限
5	688820	盛合晶微	33,391.64	0.02	新股流通受限

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	中欧沪深 300 指数发起 A	中欧沪深 300 指数发起 C	中欧沪深 300 指数发起 Y
报告期期初基金份额总额	89,260,453.59	34,406,776.64	4,336,405.98
报告期期间基金总申购份额	9,161,885.39	25,807,455.46	2,343,050.08
减：报告期期间基金总赎回份额	5,424,961.31	19,388,548.09	1,280,507.77
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	92,997,377.67	40,825,684.01	5,398,948.29

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	中欧沪深 300 指数发 起 A	中欧沪深 300 指数发 起 C	中欧沪深 300 指数发 起 Y
报告期期初管理人持有的本基 金份额	10,001,350.14	-	-
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	10,001,350.14	-	-
报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例（%）	10.75	-	-

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申购、赎回本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金 总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固 有资金	10,001,350.14	7.18%	10,001,350.14	7.18%	三年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,350.14	7.18%	10,001,350.14	7.18%	三年

§ 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 04 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	30,705,781.33	0.00	0.00	30,705,781.33	22.06%
	2	2026 年 06 月 02 日至 2026 年 06 月 30 日	20,626,185.18	18,188,996.18	0.00	38,815,181.36	27.88%
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 7 月 21 日