中欧上证科创板综合指数证券投资基金
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：中国工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。

基金托管人中国工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	中欧上证科创板综合指数
基金主代码	023905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 9 日
报告期末基金份额总额	191,361,727.15 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	本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，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%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；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偏离度和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偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×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，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
下属分级基金的交易代码	023905	023906
报告期末下属分级基金的份额总额	94,839,453.78 份	96,522,273.37 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）	
	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
1.本期已实现收益	3,473,860.21	3,274,063.37
2.本期利润	-38,038,005.37	-36,941,916.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3849	-0.3845
4.期末基金资产净值	103,685,942.76	105,244,496.19
5.期末基金份额净值	1.0933	1.0904

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

中欧上证科创板综合指数 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	-25.69%	2.94%	-26.67%	2.96%	0.98%	-0.02%
过去六个月	13.50%	2.68%	11.78%	2.69%	1.72%	-0.01%

过去一年	7.32%	2.27%	5.79%	2.28%	1.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.33%	2.20%	16.20%	2.24%	-6.87%	-0.04%

中欧上证科创板综合指数 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	-25.73%	2.94%	-26.67%	2.96%	0.94%	-0.02%
过去六个月	13.35%	2.68%	11.78%	2.69%	1.57%	-0.01%
过去一年	7.05%	2.27%	5.79%	2.28%	1.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.04%	2.20%	16.20%	2.24%	-7.16%	-0.04%

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



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 9 日，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。



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 9 日，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	量化投决会委员/基金经理	2025-09-09	-	10 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

三季度，科创综指下跌 27.98%，其中 7 月下跌 27.79%、8 月上涨 8.78%、9 月下跌 8.31%。

2026 年三季度，A 股走出"急跌、修复、再回落"的走势：7 月上中旬在海外货币环境收紧与 AI 产业链预期转向的背景下快速下跌，7 月下旬至 8 月中旬在稳市资金入场与中报业绩验证中修复，8 月下旬至 9 月在美联储加息落地、国际油价二次上行与杠杆资金收缩中再度回落。理解三季度的行情，仍可把握两个周期锚——外部的美国货币政策周期（实际利率）与内部的中国经济周期（内需修复的力度）。与上半年相比，两者的组合出现了变化：外部，加息从市场预期走向政策落地，且与油价上行在时间上重叠，季内 10 年期美债实际利率上行 73 个基点至 2.93%；内部，出口与工业生产保持增长，消费、投资与地产数据偏弱，政策重心转向加大逆周期调节。产业周期层面，上半年领涨的全球 AI 算力与半导体存储周期，在三季度进入"交易拥挤后的出清与业绩验证"阶段，季内经历两轮杠杆资金集中退出，板块单日涨跌幅扩大，中报业绩的兑现程度出现分化；能源与高股息资产在油价两轮上行、利率上行的环境中季内上涨；新能源锂电与储能产业链在锂价回落和产能过剩的讨论中于 8 月下旬后走弱。按成分股总市值加权口径，季内石油石化、煤炭、银行板块分别上涨 25.1%、21.9%、17.5%，电子、电力设备板块分别下跌 28.6%、20.0%，上半年"产业趋势主导"的格局在三季度出现阶段性逆转。对科创综指而言，按科创板全部股票期初总市值估算，电子、通信行业合计占比约 67%，季内对指数的贡献约为-23.3 个百分点，指数走势与半导体及 AI 算力产业链基本一致；医药生物是少数贡献为正的行业。指数季内跌幅大于中证 A500 指数（-14.96%），与科创 50 指数（-30.70%）接近。

7 月，科创综指下跌 27.79%。月初，海外市场围绕算力需求与存储景气的预期出现转向：海外大型科技公司计划对外出售富余算力，韩国存储厂商的盈利预测被下修，市场开始讨论算力过剩与存储需求见顶；同期新西兰、韩国央行相继加息，韩国收紧杠杆 ETF 监管，30 年期美债收益率自 7 月 7 日起站上 5%。科创板是上半年 AI 算力与半导体存储行情的集中区域，7 月 1 日至 17 日科创综指下跌 23.08%，其中电子、通信行业的贡献约为-16.7 个百分点，7 月 13 日、17 日指数分别下跌 4.36%、下跌 8.13%，同期科创板两融余额从 6 月 30 日的 4182.53 亿元降至 7 月 10 日的 4056.61 亿元。7 月 19 日国有资本运营平台公告增持进展，增持范围延伸到科技方向，7 月 21 日指数上涨 8.75%。7 月下旬，半导体板块中此前相对抗跌的部分出现补跌，7 月 17 日至 8 月 3 日指数下跌 9.31%。7 月 30 日，中央政治局会议提出加大逆周期调节力度、提升资本市场韧性和信心。

8 月，科创综指上涨 8.78%。8 月上中旬，中报进入密集披露期，AI 芯片、半导体设备与材料等方向公布的上半年业绩较好，上交所 8 月 30 日披露科创板公司上半年合计营业收入同比增长 38.6%、净利润同比增长 437.6%；海外半导体设备与光通信公司的季度营收同比继续高增，市场关注点从预期回到业绩验证。8 月 3 日至 18 日科创综指上涨 19.71%，电子、通信行业的贡献约为 13.9 个百分点；同期两市两融余额从 8 月 3 日的 2.59 万亿元回升至 8 月 18 日的 2.69 万亿元。8 月 19 日，科创综指下跌 7.16%，科技硬件板块领跌，当日两市两融余额减少约 303 亿元。8 月 28 日，美联储主席沃什在杰克逊霍尔年会重申 2%的通胀目标，并表示将减少对前瞻指引的依赖。

9 月，科创综指下跌 8.31%。8 月下旬至 9 月中旬，科创板成交额继续回落，9 月 10 日科创板日成交额降至 1943.22 亿元，为季内低点；同期海外加息预期升温，美国 8 月非农就业新增 16.2 万人，欧央行 9 月 10 日加息，布伦特原油现货 9 月 15 日升至 130.80 美元/桶，8 月 19 日至 9 月 15 日科创综指下跌 6.63%。9 月 16 日，美联储加息 25 个基点，加息落地后半导体、光模块等方向反弹，9 月 15 日至 22 日科创综指上涨 7.58%。9 月 23 日至 25 日，中美元首会晤达成八点成果共识，会晤未释放芯片出口管制放松的信号，半导体板块再度回落；9 月 26 日美方拒绝伊朗提出的七天停火方案，9 月 28 日节后首个交易日指数下跌 4.31%。9 月 22 日至 30 日指数下跌 7.52%，电子、通信行业的贡献约为-6.0 个百分点；科创板两融余额于 9 月 30 日降至 3390.25 亿元。季末科创综指收于 1815.22 点，季内收盘低点出现在 7 月 30 日，季内最大回撤 30.36%。

在投资策略方面，本基金作为跟踪上证科创板综合指数的被动指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

科创板流动性在季内逐月收缩，杠杆资金回落幅度大于两市整体：科创综指覆盖科创板全部

上市股票，其成交额可视作科创板整体成交额。季内科创板日成交额在 7 月 1 日达到 6303.90 亿元的高点，7 月、8 月、9 月日均成交额分别为 4577.8 亿元、3465.0 亿元和 2549.9 亿元，9 月 10 日降至 1943.22 亿元的季内低点，9 月日均成交额约为 7 月的 56%。杠杆资金方面，科创板两融余额 6 月 30 日为 4182.53 亿元，7 月 10 日为 4056.61 亿元，9 月 30 日为 3390.25 亿元，较 7 月 10 日下降 16.4%；同期两市两融余额从 2.94 万亿元降至 2.56 万亿元，降幅 12.7%。科创板个股涨跌幅限制为 20%，季内科创综指单日涨跌幅超过 5%的交易日有 7 个：7 月 2 日下跌 5.64%，7 月 9 日上涨 6.68%，7 月 17 日下跌 8.13%，7 月 21 日上涨 8.75%，7 月 28 日、7 月 30 日分别下跌 5.93%、5.70%，8 月 19 日下跌 7.16%。

展望四季度，科创综指的走势与半导体及 AI 算力产业链的景气和交易结构相关。产业层面，上半年积累的拥挤交易在三季度经历了两轮出清，四季度三季报披露期，AI 芯片、半导体设备与材料、存储等方向的业绩兑现程度，是检验产业周期的主要观测变量；海外大型科技公司的资本开支指引、存储价格的变化，以及中美在芯片出口管制上的政策动向，会影响产业链的景气预期。交易层面，科创板日均成交额从 7 月的 4577.8 亿元降至 9 月的 2549.9 亿元，两融余额回落 16.4%，成交与杠杆资金能否企稳，与指数的波动幅度相关。外部方面，美联储 9 月点阵图显示年内还有一次加息，10 年期美债实际利率处在 2.9%附近的高位，是长久期成长资产估值的外部约束项。此外，大市值新股上市满三个月后纳入指数，将改变指数的成分与权重结构。

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-25.69%，同期业绩比较基准收益率为-26.67%；基金 C 类份额净值增长率为-25.73%，同期业绩比较基准收益率为-26.67%。

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	197,202,149.71	94.17
	其中：股票	197,202,149.71	94.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,549,621.37	5.52
	其中：债券	11,549,621.37	5.52
	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	525,274.08	0.25
8	其他资产	136,353.77	0.07
9	合计	209,413,398.93	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	159,263,540.93	76.23
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	31,668,937.90	15.16
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	3,865,691.26	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	807,617.43	0.39
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	195,605,787.52	93.62

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	2,909.88	0.00
C	制造业	1,589,496.99	0.76
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	3,955.32	0.00
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	1,596,362.19	0.76

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	688256	寒武纪	10,653	10,748,983.53	5.14
2	688041	海光信息	39,873	9,043,196.40	4.33
3	688012	中微公司	16,075	5,120,691.25	2.45
4	688981	中芯国际	43,690	4,892,843.10	2.34
5	688808	联讯仪器	2,617	4,039,993.93	1.93
6	688008	澜起科技	19,056	3,855,219.36	1.85
7	688820	盛合晶微	31,581	3,654,383.14	1.75
8	688498	源杰科技	2,097	3,382,461.00	1.62
9	688802	沐曦股份	6,720	3,340,377.60	1.60
10	688795	摩尔线程	7,969	3,139,307.86	1.50

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	688825	长鑫科技	37,869	1,463,636.85	0.70
2	688813	泰金新能	234	29,973.06	0.01
3	688811	有研复材	834	15,353.94	0.01
4	688835	高凯技术	59	14,811.95	0.01

5	688836	宇树科技	44	14,001.68	0.01

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	11,549,621.37	5.53
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	11,549,621.37	5.53

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	019835	26 国债 09	110,000	11,045,292.88	5.29
2	019827	26 国债 01	5,000	504,328.49	0.24

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，澜起科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到其他公司的处罚。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	136,353.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	136,353.77

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

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	688808	联讯仪器	229,097.61	0.11	新股流通受限
2	688820	盛合晶微	69,950.12	0.03	新股流通受限

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	688825	长鑫科技	1,463,636.85	0.70	新股流通受限
2	688813	泰金新能	29,973.06	0.01	新股流通受限
3	688811	有研复材	15,353.94	0.01	新股流通受限
4	688835	高凯技术	14,811.95	0.01	新股流通受限
5	688836	宇树科技	14,001.68	0.01	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	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
报告期期初基金份额总额	104,427,425.88	98,289,227.61
报告期期间基金总申购份额	9,193,680.00	27,859,253.96
减:报告期期间基金总赎回份额	18,781,652.10	29,626,208.20
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	94,839,453.78	96,522,273.37

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 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

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。

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