中欧中证芯片产业指数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	中欧中证芯片产业指数发起
基金主代码	020478
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2024 年 2 月 2 日
报告期末基金份额总额	320,364,609.05 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%，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。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履

	行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。	
业绩比较基准	中证芯片产业指数收益率×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。 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	中欧中证芯片产业指数发起 A	中欧中证芯片产业指数发起 C
下属分级基金的交易代码	020478	020483
报告期末下属分级基金的份额总额	126,292,681.00 份	194,071,928.05 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）	
	中欧中证芯片产业指数发起 A	中欧中证芯片产业指数发起 C
1.本期已实现收益	10,228,519.20	16,280,429.75
2.本期利润	-178,061,052.07	-304,910,731.10
3.加权平均基金份额本期利润	-1.5080	-1.5747
4.期末基金资产净值	356,983,622.35	544,986,660.31
5.期末基金份额净值	2.8266	2.8082

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

中欧中证芯片产业指数发起 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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	-35.02%	3.68%	-36.07%	3.67%	1.05%	0.01%
过去六个月	31.52%	3.49%	28.77%	3.50%	2.75%	-0.01%
过去一年	17.83%	2.92%	13.58%	2.93%	4.25%	-0.01%
自基金合同生效起至今	182.66%	2.51%	176.55%	2.58%	6.11%	-0.07%

中欧中证芯片产业指数发起 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	-35.06%	3.68%	-36.07%	3.67%	1.01%	0.01%
过去六个月	31.35%	3.49%	28.77%	3.50%	2.58%	-0.01%
过去一年	17.54%	2.91%	13.58%	2.93%	3.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	180.82%	2.51%	176.55%	2.58%	4.27%	-0.07%

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		
宋巍巍	量化投决会委员/基金经理	2024-02-02	-	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，中证芯片产业指数下跌 37.72%，前三季度累计上涨 23.54%。其中 7 月下跌 33.41%、8 月上涨 4.52%、9 月下跌 10.51%，指数在二季度"逐月加速"上涨后出现剧烈的估值与筹码出清，季内单日涨跌幅超过 7%的交易日多达 7 个，波动率显著放大。

三季度，中证芯片产业指数整体呈现"产业景气延续、股价深度回撤"的背离走势。一方面，存储价格仍在上涨，DRAM 三季度合约价环比上涨约 20%，全球半导体销售额与国内半导体行业利润继续高增，海外云厂商持续上调资本开支指引；另一方面，存储价格涨幅较上半年明显收窄，"价格斜率见顶"的预期开始被市场定价，叠加全球 AI 资本开支回报受到质疑、海外利率持续上行、前期交易高度拥挤后的集中去杠杆，二季度涨幅最大的存储与算力环节率先、也最深度地回撤。指数季内最低于 8 月 3 日较二季度末回撤 38.2%，此后两度反弹均未能收复失地，季末收于季内低点附近。本季行情的本质，是一轮产业基本面尚未证伪、但定价核心由"价格水平"切换至"价格斜率"的估值重置。

7 月，中证芯片产业指数下跌 33.41%，为季内跌幅最大的月份。外部层面，美伊临时停火安排瓦解，美方恢复对伊朗航运的海上封锁并连续空袭，伊朗宣布封锁霍尔木兹海峡，布伦特原油月内上涨约 24%，通胀与加息预期重新抬头；全球半导体板块在 6 月高点后快速回落，费城半导体指数较高点回撤超过 20%、进入技术性调整，韩国市场的杠杆资金被动减仓，带动亚洲科技资产同步下跌。产业层面，市场集中审视 AI 高强度资本开支的回报周期——海外头部科技企业资本开支大幅增长挤压自由现金流，部分云厂商出租闲置算力、美国多地出现限制数据中心建设的动向，引发对算力需求斜率放缓的担忧。存储环节则面临三重压力：一是集邦咨询预计三季度 DRAM、NAND 合约价环比涨幅分别收敛至 13%—18%和 10%—15%，较二季度近 60%的涨幅大幅放缓，市场开始博

弈"涨价见顶"；二是海外存储企业宣布大规模扩产，2027—2028 年远期供给宽松的预期升温；三是国产 DRAM 企业 7 月下旬登陆科创板，此前作为"影子标的"的相关公司估值溢价随之回落，叠加巨额 IPO 对存量资金的分流。7 月 21 日，在海外存储股大幅反弹、国内稳市举措密集出台的带动下，指数单日大涨 12.07%，但随后在海外存储股再度暴跌的冲击下重回跌势。

8 月，中证芯片产业指数上涨 4.52%，走出"深 V 反弹—再度受挫"的震荡格局。月初，在超跌后的估值修复、国内稳市资金持续流入以及国产算力芯片订单能见度延伸至明年的催化下，指数自 8 月 3 日的季内低点至 8 月 17 日反弹 21.1%；同期半导体中报密集披露，国内存储模组与利基存储厂商二季度营收、利润同比大幅增长，国内半导体行业二季度归母净利润同比增长超过 200%，基本面数据对板块形成支撑。但 8 月 19 日，美国长端国债收益率创近二十年新高，海外存储与算力股集体重挫，叠加国内两融资金集中涌入的科技方向触发止盈与降杠杆，指数单日下跌 7.91%。此后半导体内部出现明显的结构性切换，资金由存储、算力转向半导体设备、封测与功率等前期涨幅较小、业绩更具支撑的方向。

9 月，中证芯片产业指数下跌 10.51%。宏观层面，美国全面封锁伊朗原油出口、胡塞武装加大对曼德海峡的控制，布伦特原油重返 100 美元/桶上方，9 月 16 日美联储一致决议再度加息至 3.75%—4.0%，点阵图显示利率"更高更久"，全球成长资产的折现率持续承压。产业层面，海外大模型与 AI 芯片厂商上调收入预期、海外云厂商资本开支继续上修，月中曾带动指数一周内反弹 9.5%；但随着国庆长假前资金避险，以及市场对四季度存储涨价进一步放缓的担忧，指数在月末再度回落，季末收于 3912 点。

从时间轴看，三季度芯片行情的演绎呈现"存储领跌→全面去杠杆→内部轮动"的路径。7 月的下跌以存储环节为起点，"涨价斜率放缓+远期扩产+国产 DRAM 龙头上市"三重因素叠加，令此前以价格水平定价的存储资产率先重估，并经由全球科技股的杠杆出清扩散至算力、代工、设备、材料全链条，指数在一个月内回吐二季度六成以上的涨幅。8 月，超跌反弹与中报业绩验证使指数一度修复，但海外长端利率冲高再度打断反弹，市场交易逻辑由"选主线"转向"找业绩、找低拥挤"，设备、封测、功率等环节获得相对收益。9 月，海外加息落地与油价冲高维持了高折现率环境，国内科技风险偏好未能有效修复，指数二次探底。

在投资策略方面，本基金作为跟踪中证芯片产业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。

三季度的回撤揭示了本轮芯片行情的定价规律：由供给刚性收缩驱动的存储周期，股价对价格的"斜率"远比对价格的"水平"敏感。三季度存储价格仍在上涨、企业盈利仍在高增，但涨幅由

二季度的六成左右收敛至两成左右，市场即开始提前交易周期的拐点；而当海外利率与地缘风险同步抬升折现率、前期交易又高度集中于少数高弹性环节时，估值收缩与杠杆出清会相互强化，形成远超基本面变化幅度的股价波动。与之对应，设备、模拟、SoC 等对价格周期依赖度较低、由国产替代与订单驱动的环节，回撤幅度明显更小，显示市场正在从"涨价弹性"转向"盈利确定性与国产化进度"重新给芯片资产分层定价。

展望四季度，地缘政治重塑全球供应链的方向没有改变，"自主可控""国产替代"的战略将继续深入。国内存储产能扩张、先进逻辑与先进封装扩产对国产设备与材料的需求拉动仍在持续，国产算力芯片订单能见度已延伸至明年，国内云厂商资本开支保持高增，本土供应商在 AI 芯片、成熟制程代工、模拟芯片等领域的份额提升进程有望延续。

从周期定位看，芯片板块的定价核心仍是全球存储周期所处的阶段，但关注点已由"是否涨价"转向"涨价的斜率与持续时间"：据产业跟踪，DRAM 四季度合约价预计环比再涨 10%—15%、NAND 预计上涨 15%—20%，高带宽存储与服务器存储的紧缺状态或延续至 2027 年，但涨幅收窄的趋势已较为明确，存储价格同比增速可能在四季度前后见顶；海外存储龙头的资本开支投放节奏、国产存储产能的爬坡进度以及终端厂商对高价存储的承受能力，将决定周期高位能持续多久。国内产业层面，存储与先进逻辑扩产的设备招标节奏、国产算力芯片从验证走向规模商用的进度、先进封装产能的扩张，以及三季报对涨价向全产业链盈利传导程度的验证，构成观察国内 AI 产业化周期的核心线索。

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-35.02%，同期业绩比较基准收益率为-36.07%；基金 C 类份额净值增长率为-35.06%，同期业绩比较基准收益率为-36.07%。

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	855,211,954.28	92.06
	其中：股票	855,211,954.28	92.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	53,517,558.93	5.76
	其中：债券	53,517,558.93	5.76

	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	16,552,947.92	1.78
8	其他资产	3,687,364.48	0.40
9	合计	928,969,825.61	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	730,217,235.78	80.96
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	116,361,652.53	12.90
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	846,578,888.31	93.86

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	40,978.57	0.00
C	制造业	8,218,576.86	0.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	269,047.78	0.03

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,994.24	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,454.80	0.01
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	8,013.72	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	8,633,065.97	0.96

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	71,490	72,134,124.90	8.00
2	002371	北方华创	98,700	60,796,239.00	6.74
3	688012	中微公司	170,909	54,443,061.95	6.04
4	603986	兆易创新	152,500	53,683,730.00	5.95
5	688008	澜起科技	263,594	53,327,702.14	5.91
6	688981	中芯国际	464,509	52,020,362.91	5.77
7	688041	海光信息	211,982	48,077,517.60	5.33
8	688072	拓荆科技	45,028	28,817,920.00	3.19
9	300604	长川科技	101,200	24,266,748.00	2.69
10	600584	长电科技	326,400	20,980,992.00	2.33

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	172,784	6,678,101.60	0.74
2	688808	联讯仪器	203	303,966.11	0.03

3	301666	大普微	863	285,773.82	0.03
4	001248	华润新能源	28,769	268,702.46	0.03
5	688820	盛合晶微	827	93,004.42	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	53,517,558.93	5.93
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	53,517,558.93	5.93

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	315,000	31,629,702.33	3.51
2	019827	26 国债 01	217,000	21,887,856.60	2.43

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

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，以套期保值为主要目的。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，适度参与国债期货投资。

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，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	220,113.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,467,251.31
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,687,364.48

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	603986	兆易创新	6,084,180.00	0.67	大宗交易流通受限

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	6,678,101.60	0.74	新股流通受限
2	688808	联讯仪器	303,966.11	0.03	新股流通受限
3	301666	大普微	285,773.82	0.03	新股流通受限
4	001248	华润新能源	268,702.46	0.03	新股流通受限
5	688820	盛合晶微	93,004.42	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	中欧中证芯片产业指数发起 A	中欧中证芯片产业指数发起 C
报告期期初基金份额总额	99,999,541.19	189,575,429.95
报告期期间基金总申购份额	69,006,136.42	158,620,265.13
减:报告期期间基金总赎回份额	42,712,996.61	154,123,767.03
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	126,292,681.00	194,071,928.05

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	中欧中证芯片产业指数发起 A	中欧中证芯片产业指数发起 C

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
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	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.92	-

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 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	10,000,000.00	3.12%	10,000,000.00	3.12%	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	10,000,000.00	3.12%	10,000,000.00	3.12%	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

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