中欧中证A500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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 A500 指数发起
基金主代码	022432
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 4 日
报告期末基金份额总额	1,017,999,741.10 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	中证 A500 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	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
下属分级基金的交易代码	022432	022433	022898
报告期末下属分级基金的份额总额	289,544,686.02 份	675,910,411.89 份	52,544,643.19 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 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
1.本期已实现收益	8,496,626.95	20,326,368.13	1,527,373.93
2.本期利润	-49,543,488.15	-116,033,485.41	-8,436,144.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1755	-0.1679	-0.1731
4.期末基金资产净值	348,188,489.77	808,943,772.09	63,539,081.22
5.期末基金份额净值	1.2025	1.1968	1.2092

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 A500 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	-12.99%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.24%	0.00%
过去六个月	-0.19%	1.39%	-2.62%	1.40%	2.43%	-0.01%
过去一年	-0.96%	1.23%	-4.10%	1.24%	3.14%	-0.01%
自基金合同生效起至今	20.25%	1.10%	16.13%	1.14%	4.12%	-0.04%

中欧中证 A500 指数发起 C

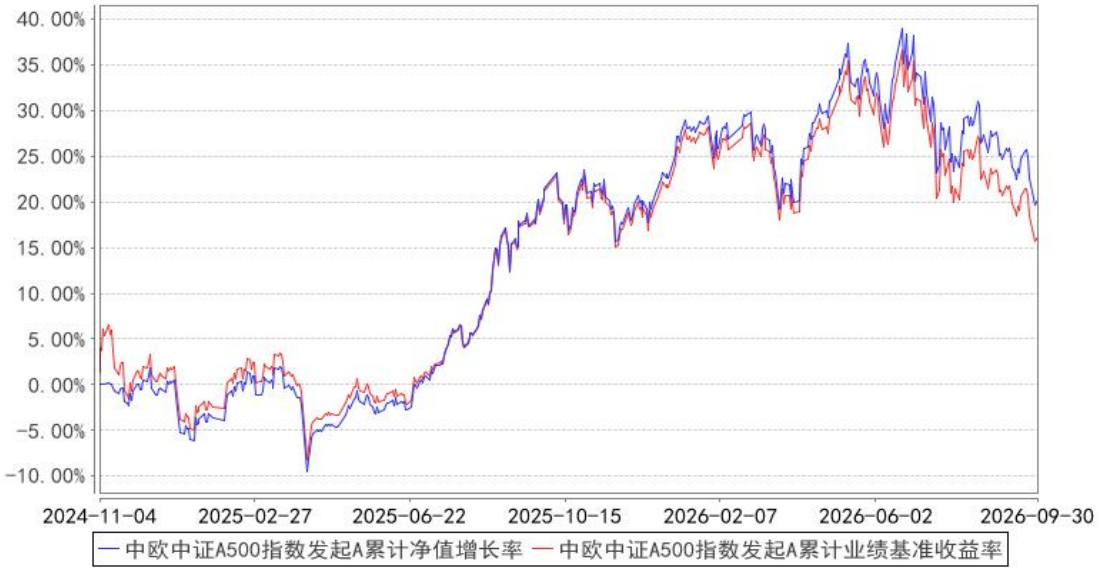
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.05%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.18%	0.00%
过去六个月	-0.31%	1.39%	-2.62%	1.40%	2.31%	-0.01%
过去一年	-1.21%	1.23%	-4.10%	1.24%	2.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	19.68%	1.11%	16.13%	1.14%	3.55%	-0.03%

中欧中证 A500 指数发起 Y

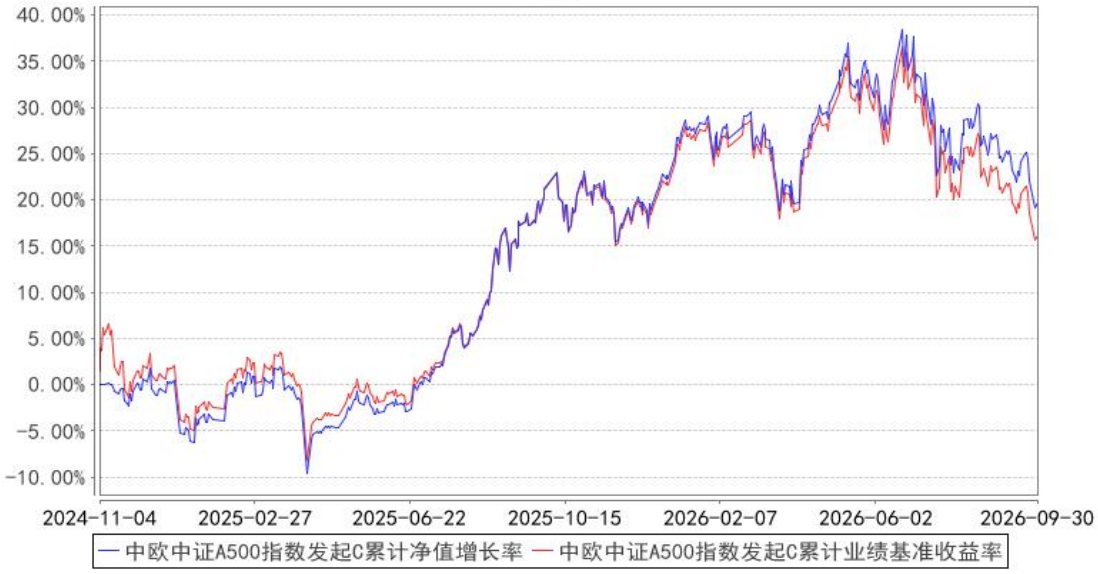
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-12.93%	1.43%	-14.23%	1.43%	1.30%	0.00%
过去六个月	-0.03%	1.39%	-2.62%	1.40%	2.59%	-0.01%
过去一年	-0.66%	1.23%	-4.10%	1.24%	3.44%	-0.01%
自基金份额起始运作日至今	21.42%	1.13%	14.87%	1.13%	6.55%	0.00%

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

中欧中证A500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



中欧中证A500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





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 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		
宋巍巍	量化投决会委员/基金经理	2024-11-04	-	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A500指数下跌14.96%，其中7月下跌10.85%、8月上涨1.78%、9月下跌6.28%。

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。按成份股总市值加权口径，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。对中证A500指数而言，电子、通信行业期初合计权重约37%，季内对指数的贡献约为-12.4个百分点，新能源相关的电力设备行业贡献约为-2.3个百分点，银行、石油石化、煤炭合计贡献约1.2个百分点。指数季内跌幅大于沪深300指数（-12.49%），小于中证500指数（-17.67%）。

7 月，中证 A500 指数下跌 10.85%。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%。上半年涨幅居前、交易拥挤度处于高位的 AI 算力与存储产业链在全球范围内集中调整，7 月 1 日至 17 日中证 A500 指数下跌 11.68%，其中电子、通信行业的贡献约为-9.2 个百分点，银行、石油石化、煤炭等高股息板块逆势上涨。7 月 20 日证监会召开投资者座谈会，7 月 21 日指数上涨 3.86%。7 月下旬，科技硬件板块中此前相对抗跌的部分出现补跌，资金向新能源、资源、金融、消费等大市值权重方向集中，7 月 17 日至 8 月 3 日指数下跌 0.11%；两市两融余额从 7 月 10 日的 2.94 万亿元降至 7 月 31 日的 2.60 万亿元。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，中证 A500 指数上涨 1.78%。8 月上中旬，A 股中报进入密集披露期，AI 算力、光通信、创新药研发外包等方向公布的上半年业绩与订单数据较好，海外光通信与半导体设备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；海外方面，美伊就霍尔木兹海峡谈判传出进展，国际油价回落，美国 7 月非农就业减少 2.3 万人，通胀较前期高点回落。8 月 3 日至 18 日中证 A500 指数上涨 5.76%，电子、通信行业的贡献约为 5.2 个百分点，银行、非银金融等 7 月上涨的板块回调，资金在两类资产之间的配置方向与 7 月相反；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，中证 A500 指数下跌 3.58%，科技硬件板块领跌，银行与能源板块逆势上涨，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，中证 A500 指数下跌 6.28%。8 月下旬至 9 月中旬，新能源产业链走弱：碳酸锂价格回落，储能与动力电池产能过剩的讨论增多，据媒体报道各地已基本暂停受理新增电池产能备案，8 月 19 日至 9 月 15 日中证 A500 指数下跌 3.45%，电力设备行业的贡献约为-1.2 个百分点；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，中东输油设施遇袭后布伦特原油现货 9 月 15 日升至 130.80 美元/桶。9 月 16 日，美联储加息 25 个基点，加息落地后科技硬件板块反弹，9 月 15 日至 22 日指数上涨 2.64%。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；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 2.51%。9 月 22 日至 30 日指数下跌 4.62%，电子、通信行业的贡献约为-3.1 个百分点，两市两融余额从 9 月 22 日的 2.65 万亿元降至 9 月 30 日的 2.56 万亿元。季末中证 A500 指数收于 5370.26 点，季内收盘低点出现在 9 月 28 日，季内最大回撤 15.30%。

在投资策略方面，本基金作为跟踪中证 A500 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。

复盘三季度的行情，可以按照美国加息周期、中国经济复苏周期两个维度看：就美国加息周期而言，三季度的变化是加息从市场预期走向政策落地，落地的时间与油价的第二轮上涨重叠。与上半年相比，三季度美国利率上行与油价上涨在时间上重叠；季内 A 股两次集中下跌，分别出现在 7 月中旬（韩国加息、杠杆 ETF 监管收紧前后）与 9 月下旬（美联储加息、美方拒绝伊朗停火方案之后）。中国经济周期在三季度呈现"外需强、内需弱"的结构分化，政策重心转向加大逆周期调节。

展望四季度，从周期定位看，国内经济处在"外需强、内需弱"的结构中，7 月政治局会议提出的增量政策的出台与落地节奏，以及消费、投资数据能否企稳，是国内基本面的主要观测变量。中证 A500 在各行业选取市值较大的公司，行业覆盖较全，三季度科技硬件、新能源与高股息资产之间的分化在指数内部同时存在；四季度三季报披露期，AI 算力与半导体产业链的业绩兑现程度、新能源产业链的供需与价格变化，将影响指数中权重最高的两类资产。外部方面，美联储 9 月点阵图显示年内可能还有一次加息，10 年期美债实际利率处在 2.9%附近的高位，美国通胀与就业数据的变化、国际油价的方向，是成长类资产估值的外部约束项。四季度 A 股定价仍处在"国内政策与盈利"与"海外利率与油价"两个变量的相互作用中。

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-12.99%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%；基金 C 类份额净值增长率为-13.05%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%；基金 Y 类份额净值增长率为-12.93%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

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	1,159,066,510.57	94.32
	其中：股票	1,159,066,510.57	94.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	65,128,245.86	5.30
	其中：债券	65,128,245.86	5.30

	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	3,613,312.98	0.29
8	其他资产	1,077,264.91	0.09
9	合计	1,228,885,334.32	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	5,102,516.00	0.42
B	采矿业	65,790,980.00	5.39
C	制造业	741,205,688.76	60.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,611,221.00	2.51
E	建筑业	15,395,016.00	1.26
F	批发和零售业	8,355,829.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	31,550,893.00	2.58
H	住宿和餐饮业	608,127.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,884,443.37	5.15
J	金融业	140,723,961.15	11.53
K	房地产业	8,487,965.00	0.70
L	租赁和商务服务业	9,428,669.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	21,667,182.00	1.78
N	水利、环境和公共设施管理业	2,218,956.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	464,720.00	0.04
Q	卫生和社会工作	2,522,502.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	1,006,321.00	0.08
S	综合	2,136,292.00	0.18
	合计	1,150,161,282.28	94.22

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	44,369.32	0.00
C	制造业	8,452,493.11	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	381,467.20	0.03

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	24,391.14	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	2,507.52	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	8,905,228.29	0.73

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	46,000	37,188,240.00	3.05
2	600519	贵州茅台	25,800	32,472,396.00	2.66
3	300750	宁德时代	109,000	31,730,990.00	2.60
4	601318	中国平安	439,400	23,415,626.00	1.92
5	300502	新易盛	57,500	22,367,500.00	1.83
6	600036	招商银行	510,100	21,046,726.00	1.72
7	601899	紫金矿业	679,100	20,230,389.00	1.66
8	603259	药明康德	101,900	17,051,946.00	1.40
9	000333	美的集团	200,500	16,060,050.00	1.32
10	600900	长江电力	504,400	14,395,576.00	1.18

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	168,163	6,499,499.95	0.53
2	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.03

3	001248	华润新能源	40,780	380,885.20	0.03
4	688808	联讯仪器	241	360,866.17	0.03
5	688820	盛合晶微	1,923	216,260.58	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	65,128,245.86	5.34
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	65,128,245.86	5.34

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	258,000	26,023,350.25	2.13
2	019835	26国债09	200,000	20,082,350.68	1.65
3	019846	26国债14	190,000	19,022,544.93	1.56

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

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	1,077,264.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,077,264.91

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	688825	长鑫科技	6,499,499.95	0.53	新股流通受限
2	301666	大普微	403,990.80	0.03	新股流通受限
3	001248	华润新能源	380,885.20	0.03	新股流通受限
4	688808	联讯仪器	360,866.17	0.03	新股流通受限
5	688820	盛合晶微	216,260.58	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	中欧中证 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证 A500 指数发起 Y
报告期期初基金份额总额	267,538,406.25	613,255,887.79	43,626,605.35
报告期期间基金总申购份额	40,439,614.99	202,970,458.37	11,146,549.70
减:报告期期间基金总赎回份额	18,433,335.22	140,315,934.27	2,228,511.86
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	289,544,686.02	675,910,411.89	52,544,643.19

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 A500 指数发起 A	中欧中证 A500 指数发起 C	中欧中证A500指数发起 Y
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（%）	3.45	-	-

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	0.98%	10,000,000.00	0.98%	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	0.98%	10,000,000.00	0.98%	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 07 月 01 日至 2026 年 07 月 21 日;2026 年 08 月 05 日至 2026 年	212,098,880.74	0.00	0.00	212,098,880.74	20.83%

		09 月 30 日					
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