

中欧上证科创板 100 指数发起式证券投资基金  
基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 5 月 30 日

送出日期：2025 年 6 月 3 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                |                 |
|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|
| 基金简称    | 中欧上证科创板 100 指数发起                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 基金代码           | 021660          |
| 下属基金简称  | 中欧上证科创板 100 指数发起 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 下属基金交易代码       | 021660          |
| 下属基金简称  | 中欧上证科创板 100 指数发起 C                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 下属基金交易代码       | 021661          |
| 基金管理人   | 中欧基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 基金托管人          | 招商银行股份有限公司      |
| 基金合同生效日 | 2024 年 7 月 31 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 上市交易所及上市日期     | —               |
| 基金类型    | 股票型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 交易币种           | 人民币             |
| 运作方式    | 普通开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 开放频率           | 每个开放日           |
| 基金经理    | 宋巍巍                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 7 月 31 日 |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 证券从业日期         | 2016 年 7 月 21 日 |
| 其他      | <p>基金合同生效满 3 年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。</p> <p>若基金管理人注册并成立追踪标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该 ETF 的联接基金。该联接基金将其绝大部</p> |                |                 |

|  |                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。 |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 二、基金投资与净值表现

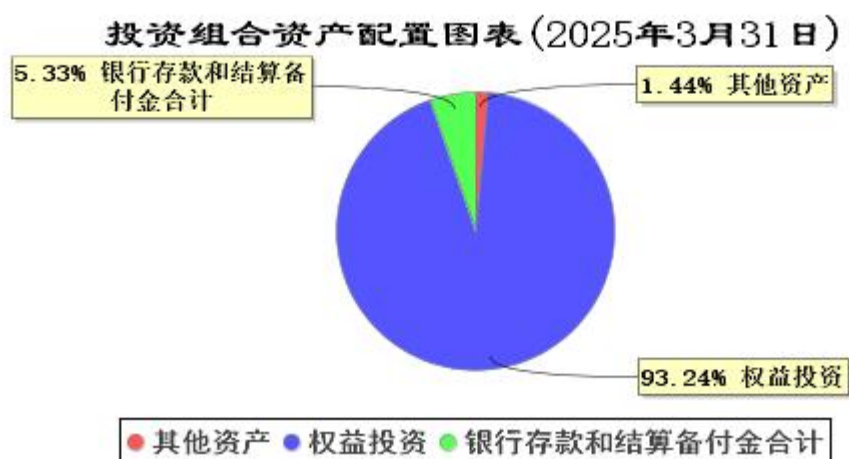
### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况

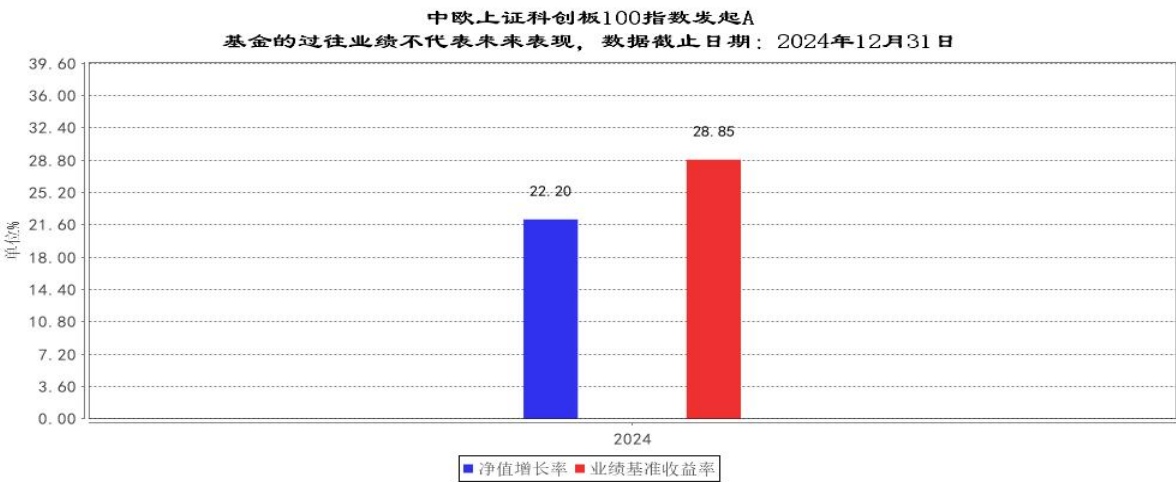
|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|---------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>投资目标</b>   | 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>投资范围</b>   | <p>本基金的标的指数为上证科创板 100 指数。</p> <p>本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权）、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>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）或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| <b>主要投资策略</b> | <p><b>1、资产配置策略</b></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p><b>2、股票投资策略</b></p> <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致</p>                                                                                  |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>3、港股通标的股票投资策略</p> <p>在特殊情况下，本基金将少量投资于港股通标的股票以进行替代复制。对于同时有 A 股、H 股的指数成份公司，如果该公司 A 股长期停牌，组合无法买入该股票时，可以买入该公司 H 股进行替代。</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | 上证科创板 100 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>风险收益特征</b> | <p>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。</p> <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                     |

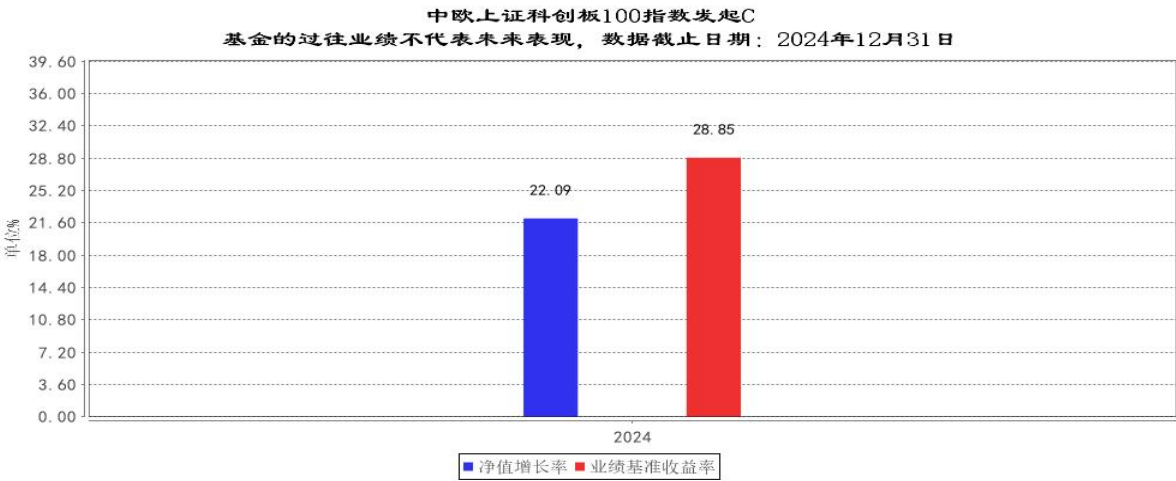
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表



## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金合同生效/增加份额当年期间的相关数据按实际存续期计算。



注：基金合同生效/增加份额当年期间的相关数据按实际存续期计算。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

中欧上证科创板 100 指数发起 A

| 费用类型         | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率      |
|--------------|-----------------------------|--------------|
| 申购费<br>(前收费) | M<500 万                     | 1.00%        |
|              | M≥500 万                     | 1,000.00 元/笔 |
| 赎回费          | N<7 天                       | 1.50%        |
|              | 7 天≤N<30 天                  | 0.30%        |
|              | N≥30 天                      | 0.00%        |

注：上表适用于投资者（通过基金管理人的直销中心认申购本基金 A 类基金份额的养老金客户除外）申购本基金 A 类基金份额的情形，通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户费率适用情况详见本基金招募说明书及相关公告。

中欧上证科创板 100 指数发起 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费  | N<7 天                       | 1.50%   |
|      | N≥7 天                       | 0.00%   |

**认购费**

本基金 C 类基金份额不收取认购费。

**申购费**

本基金 C 类基金份额不收取申购费。

**(二) 基金运作相关费用**

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别  | 收费方式/年费率或金额           |       | 收取方        |
|-------|-----------------------|-------|------------|
| 管理费   | 0.50%                 |       | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                 |       | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 中欧上证科创板<br>100 指数发起 C | 0.25% | 销售机构       |
| 审计费用  | 40,000.00 元           |       | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 120,000.00 元          |       | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 详见招募说明书的基金费用与税收章节。    |       | 相关服务机构     |

注：1. 年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

2. 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

**(三) 基金运作综合费用测算**

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

中欧上证科创板 100 指数发起 A

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 0.67%        |

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

中欧上证科创板 100 指数发起 C

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 0.92%        |

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

**四、风险揭示与重要提示**

**(一) 风险揭示**

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：

-市场风险

1、政策风险，2、利率风险，3、信用风险，4、通货膨胀风险，5、再投资风险，6、法律风险；

-管理风险；

-流动性风险；

-其它风险；

-特有风险

#### 1、指数化投资的风险

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%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

##### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### （2）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

##### （3）部分成份股权重较大的风险

根据本基金标的指数编制方案，存在个别成份股权重较大、集中度较高的情况，可能使基金面临较大波动风险或流动性风险。

##### （4）基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险

以下因素可能使基金收益率与业绩比较基准收益率发生偏离：

1）标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2）标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3）成份股派发现金红利、送配等所获收益导致基金收益率偏离业绩比较基准收益率，从而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4）由于成份股停牌或流动性差等因素，基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5）基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等，可能导致本基金在跟踪业绩比较基准时产生收益上的偏离。

6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度。

7）基金现金资产的拖累会影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度。

8）特殊情况下，如果本基金采取成份股替代策略，基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与业绩比较基准收益率产生偏离。

9）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因基金分红带来的证券买卖价格波动、证券交易成本、基金仓位变动等；因指数编制机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

##### （5）跟踪误差控制未达约定目标的风险

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，但因标的指

数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### （6）标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

#### （7）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### （8）标的指数编制方案带来的风险

本基金标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，指数编制机构有权停止编制标的指数、变更标的指数编制方案。而指数编制方案基于其样本空间仅能选取部分证券予以构建，其表征性与可投资性可能存在不成熟或不完备之处。

当指数编制机构变更标的指数编制方案，导致指数成份股样本与权重发生调整，基金管理人需调整投资组合，从而可能增加基金运作难度、跟踪误差和组合调整的风险与成本，并可能导致基金风险收益特征发生较大变化；此外，当市场环境发生变化，但指数编制机构未能及时对指数编制方案进行调整时，可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，从而影响投资收益。投资人需关注并承担上述风险，谨慎作出投资决策。

#### （9）标的指数变更的风险

如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险。

#### （10）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。2）在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能根据基金合同的约定采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

2、本基金可投资股指期货。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

3、本基金可投资股票期权。股票期权作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股票期权所面临的主要风险是衍生品价格波动带来的市场风险；衍生品基础资产交易量大于市场可报价的交易量而产生的流动性风险；衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动而造成基差风险；无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的保证金风险；交易对手不愿或无法履行契约而产生的信用风险；以及各类操作风险。

4、本基金可投资国债期货。国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的的价格波动不一致而面临基差风险。

5、本基金可投资资产支持证券。基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但仍或面临信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险，所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或由于资产支持证券信用质量降低、市场利率波动导致证券价格下降，造成基金财产损失。受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券存在一定的流动性风险。

6、港股交易失败风险：港股通业务存在每日额度限制。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

7、汇率风险：本基金可投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

#### 8、境外市场的风险。

(1) 本基金可通过“港股通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

(2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1) 港股市场股价波动较大的风险：香港市场证券实行 T+0 回转交易，且对个股交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此港股可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；

2) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险：只有内地与香港两地均为交易日才可进行港股通交易，因此在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

5) 代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

9、基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股，存在不对港股进行投资的可能。

#### 10、科创板的投资风险

(1) 流动性风险。科创板投资者门槛较高，流动性可能弱于 A 股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常成交的风险。

(2) 退市风险。科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

(3) 投资集中风险。因科创板上市企业均为科技创新成长性企业，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

#### 11、基金无法存续的风险

基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。因而，本基金存在着无法存续的风险。

## 12、融资业务的主要风险

### （1）市场风险

1）可能放大投资损失的风险：融资业务具有杠杆效应，它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资交易时，既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险，又得承担融资买入股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

2）利率变动带来的成本加大风险：在从事融资交易期间，如中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资成本增加的风险。

3）强制平仓风险：融资交易中，投资组合与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对投资组合信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对投资组合担保资产执行强制平仓，且平仓的品种、数量、价格、时机将不受投资组合的控制，平仓的数额可能超过全部负债，由此给投资组合带来损失。

4）外部监管风险：在融资交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资交易采取相应措施，例如提高融资保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

### （2）流动性风险

融资业务的流动性风险主要指当基金不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与融资债务之间的比例低于平仓维持担保比例，且不能按照约定的时间追加担保物时面临强制平仓的风险。

### （3）信用风险

信用风险主要指交易对手违约产生的风险。一方面，如果证券公司没有按照融资合同的要求履行义务可能带来风险；另一方面，若在从事融资交易期间，证券公司融资业务资格、融资业务交易权限被取消或被暂停，证券公司可能无法履约，则投资组合可能会面临一定的风险。

## 13、本基金参与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在转融通证券出借业务特有风险，包括但不限于以下风险：

### （1）流动性风险

面对大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现、支付赎回款项的风险；

### （2）信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；

### （3）市场风险

证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的风险。

## 14、存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

## 15、基金转型的风险

若基金管理人注册并成立追踪标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的

前提下，本基金可变更为该 ETF 的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。因此，本基金存在自动转型的风险。

#### 16、发起式基金的特有风险

基金合同生效满 3 年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。故投资者还可能面临本基金自动终止的风险。

-本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金的基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交仲裁。任何一方应将争议提交深圳国际仲裁院仲裁，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）管辖并从其解释。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.zofund.com][客服电话：400-700-9700]

- 1、《中欧上证科创板 100 指数发起式证券投资基金基金合同》
- 《中欧上证科创板 100 指数发起式证券投资基金托管协议》
- 《中欧上证科创板 100 指数发起式证券投资基金招募说明书》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

## 六、其他情况说明

无