

## 中欧沪深 300 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	中欧沪深 300 指数发起	基金代码	021877
下属基金简称	中欧沪深 300 指数发起 A	下属基金交易代码	021877
下属基金简称	中欧沪深 300 指数发起 C	下属基金交易代码	021878
下属基金简称	中欧沪深 300 指数发起 Y	下属基金交易代码	022899
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
基金合同生效日	2024 年 11 月 29 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	宋魏魏	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 11 月 29 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。若届时的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。</p> <p>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。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</p>		

	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。
--	---

注：2024年12月13日起，本基金增设中欧沪深300指数发起Y。Y类份额是本基金针对个人养老金投资基金业务设立的单独份额类别，Y类基金份额的申赎安排、资金账户管理等事项还应同时遵守个人养老金账户管理的相关规定。

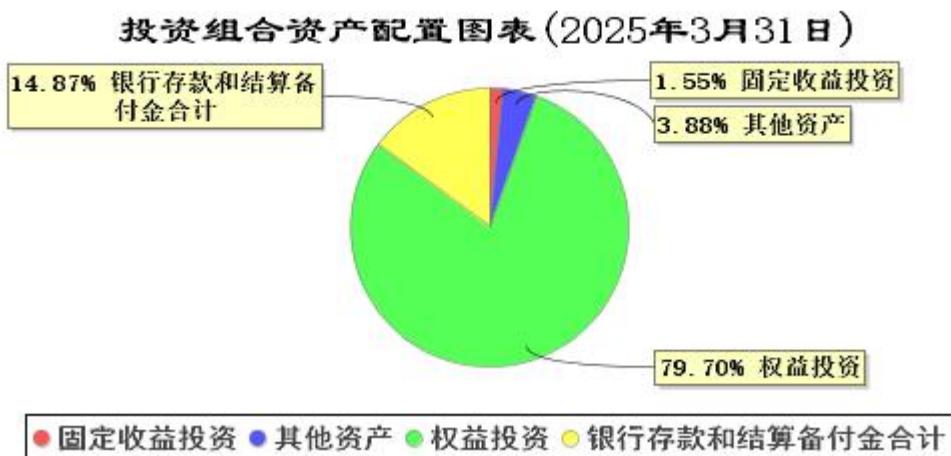
## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

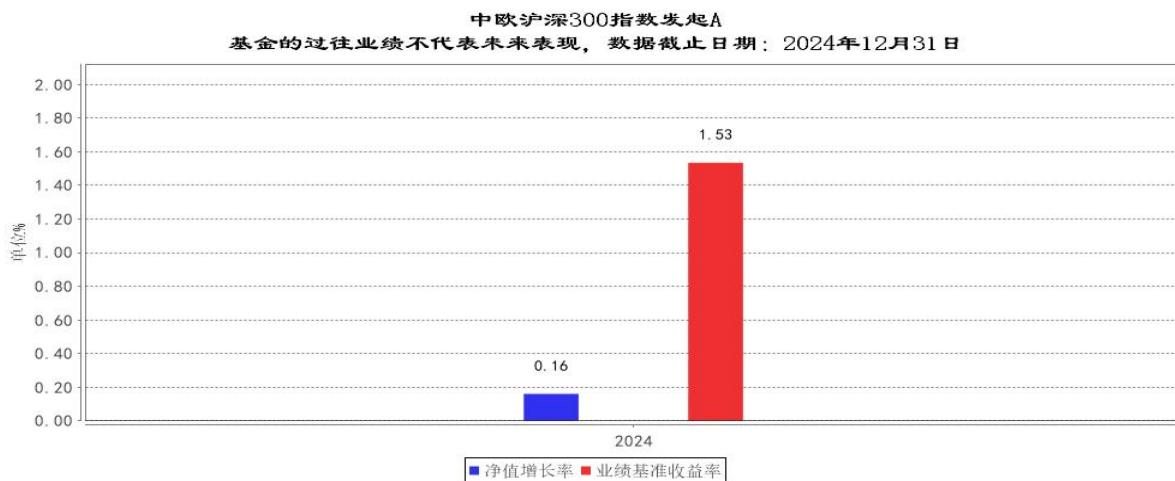
请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况

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。
投资范围	<p>本基金标的指数为：沪深300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、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%；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>
主要投资策略	<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%；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。</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>
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。

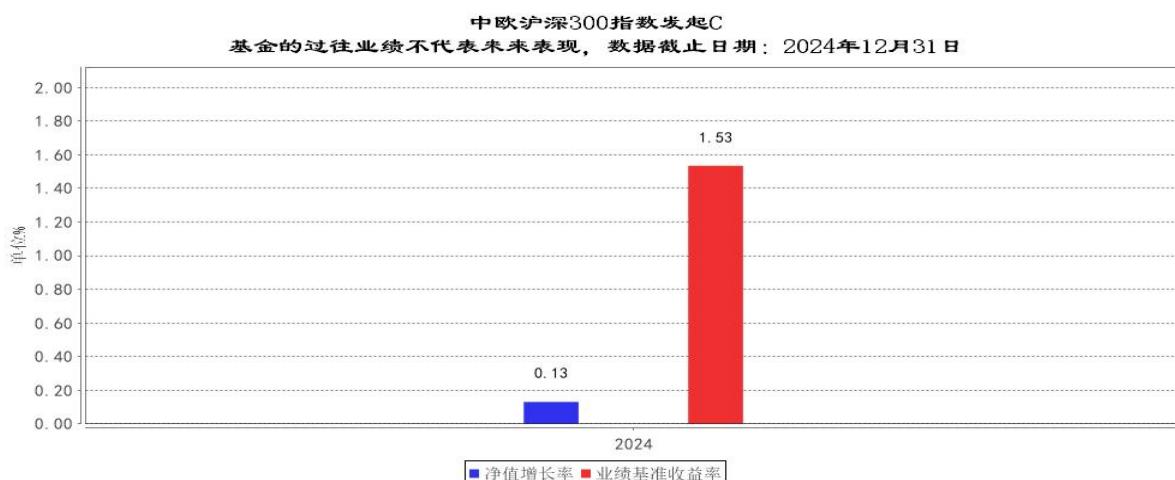
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



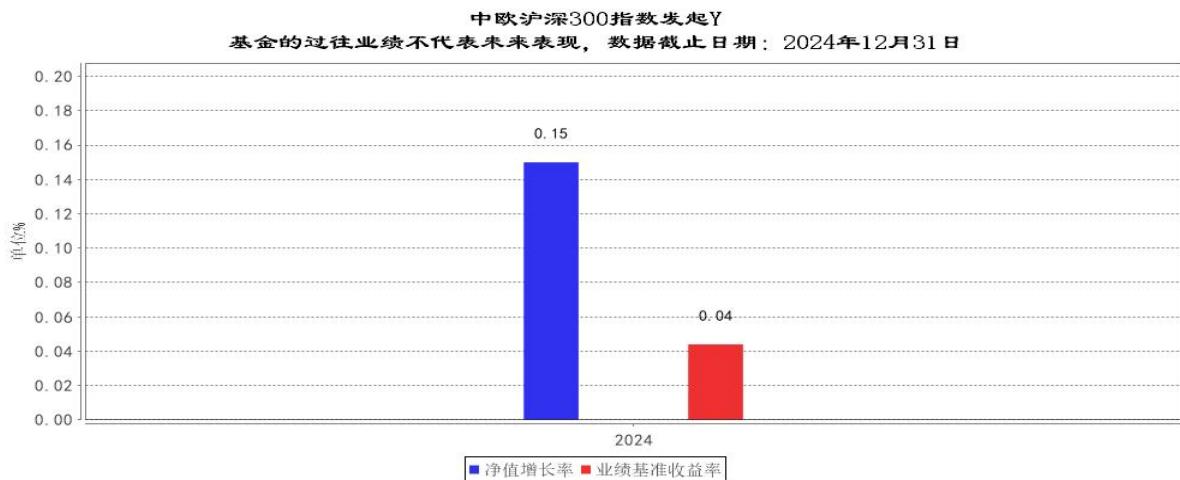
## (三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



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。



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：

#### 中欧沪深 300 指数发起 A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M<500 万	1. 00%
	M≥500 万	1, 000 元/笔
赎回费	N<7 日	1. 50%
	7 日≤N<30 日	0. 30%
	N≥30 日	0. 00%

注：上表适用于投资者（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。

#### 中欧沪深 300 指数发起 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N<7 日	1. 50%
	N≥7 日	0. 00%

#### 申购费

本基金 C 类基金份额不收取申购费。

#### 中欧沪深 300 指数发起 Y

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M<500 万	1. 00%
	M≥500 万	1, 000 元/笔
赎回费	N<7 日	1. 50%

N≥7 日	0. 00%
-------	--------

注:上表适用于投资者通过个人养老金资金账户申购、赎回 Y 类基金份额的情形。

## (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	中欧沪深 300 指数发起 A 0. 50%	基金管理人和销售机构
	中欧沪深 300 指数发起 C 0. 50%	基金管理人和销售机构
	中欧沪深 300 指数发起 Y 0. 25%	基金管理人和销售机构
托管费	中欧沪深 300 指数发起 A 0. 10%	基金托管人
	中欧沪深 300 指数发起 C 0. 10%	基金托管人
	中欧沪深 300 指数发起 Y 0. 05%	基金托管人
销售服务费	中欧沪深 300 指数发起 C 0. 25%	销售机构
审计费用	50,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 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。

## 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

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响, 可能导致市场价格波动, 从而影响基金收益。

2、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及利息收益的价格和收益率的变动, 同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券, 收益水平会受到利率变化的影响。

3、信用风险

基金在交易过程发生交收违约, 或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 或者上市公司信息披露不真实、不完整, 都可能导致基金资产损失和收益变化。

4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

#### 5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

#### 6、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

- 管理风险
- 流动性风险
- 其它风险
- 本基金特有的风险

包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数值计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险、标的指数编制方案带来的风险、标的指数变更的风险、成份股停牌的风险、参与股指期货交易的风险、投资股票期权的风险、参与国债期货交易的风险、投资资产支持证券的风险、科创板的投资风险、基金无法存续的风险、融资业务的主要风险、参与转融通证券出借业务的风险、存托凭证投资风险、基金转型的风险、发起式基金的特有风险等。

投资于 Y 类基金份额的特有风险：

(1) Y 类份额是本基金针对个人养老金投资基金业务设立的单独份额类别，Y 类基金份额的申赎安排、资金账户管理等事项还应同时遵守关于个人养老金账户管理的相关规定。除另有规定外，投资者购买 Y 类份额的款项应来自其个人养老金资金账户，基金份额赎回等款项也需转入个人养老金资金账户，投资人未达到领取基本养老金年龄或者政策规定的其他领取条件时不可领取个人养老金。

(2) 个人养老金可投资的基金产品需符合《个人养老金投资基金业务规定》要求的相关条件，具体名录由中国证监会确定，每季度通过相关网站及平台等公布。本基金运作过程中可能出现不符合相关条件从而被移出名录的情形，届时本基金将暂停办理 Y 类份额的申购，投资者由此可能面临无法继续投资 Y 类份额的风险。

(3) 个人养老金投资基金业务具有自愿参加、自主选择、自担风险等业务属性。本基金不保证本金、不保证收益、追求长期收益。

-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价值和收益作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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为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。任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人都有约束力。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、《中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金基金合同》  
《中欧沪深 300 指数发起式证券投资基金托管协议》  
《中欧沪深 300 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