

中欧上证科创板 100 指数发起式证券投资  
基金  
2025 年第 4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

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

报告送出日期：2026 年 1 月 22 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 01 月 21 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 2025 年 10 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 中欧上证科创板 100 指数发起                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 021660                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型、开放式、发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2024 年 7 月 31 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 51,074,896.39 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       | <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</p> |

|                 |                                                                                                                                                         |                    |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|                 | 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          | 上证科创板 100 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。<br>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           | 招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 100 指数发起 A                                                                                                                                      | 中欧上证科创板 100 指数发起 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 021660                                                                                                                                                  | 021661             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 20,645,043.51 份                                                                                                                                         | 30,429,852.88 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（2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 日） |                    |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                 | 中欧上证科创板 100 指数发起 A                    | 中欧上证科创板 100 指数发起 C |
| 1. 本期已实现收益      | 2,309,066.25                          | 3,684,139.93       |
| 2. 本期利润         | -1,235,284.55                         | -2,586,054.28      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0589                               | -0.0766            |
| 4. 期末基金资产净值     | 38,765,639.76                         | 56,943,841.78      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.8777                                | 1.8713             |

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 100 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      | -2.26% | 1.60% | -2.94% | 1.61% | 0.68%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 35.13% | 1.64% | 34.23% | 1.65% | 0.90%  | -0.01% |
| 过去一年       | 53.66% | 1.77% | 51.64% | 1.78% | 2.02%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 87.77% | 2.23% | 95.39% | 2.31% | -7.62% | -0.08% |

中欧上证科创板 100 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      | -2.32% | 1.60%     | -2.94%     | 1.61%         | 0.62%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 34.96% | 1.64%     | 34.23%     | 1.65%         | 0.73%  | -0.01% |
| 过去一年       | 53.27% | 1.77%     | 51.64%     | 1.78%         | 1.63%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 87.13% | 2.23%     | 95.39%     | 2.31%         | -8.26% | -0.08% |

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

中欧上证科创板100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



注：本基金基金合同生效日期为 2024 年 7 月 31 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。

中欧上证科创板100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：本基金基金合同生效日期为 2024 年 7 月 31 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 | 量化投资决策委员/基金经理 | 2024-07-31  | -    | 9 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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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 22 次，其中 20 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，2 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，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

2025 年四季度，全球资本市场进入中美地缘政治与全球宏观政策博弈的密集窗口期。期间，A 股市场整体呈现“N”字走势：10 月在国内“十五五”规划定调及中美经贸关系阶段性缓和推动下震荡走高；11 月受美联储降息预期反复及 AI 泡沫担忧影响有所回调；12 月在美国联储降息落地、中央经济工作会议积极定调与人民币汇率升值的共振下强势反弹。

10 月上证科创板 100 指数下跌 5.11%。月初，市场主要受中美关税不确定性压制。10 月 10 日，特朗普威胁对中国输美商品加征新一轮关税，当日美股大幅下挫 3.56%，拖累全球风险资产。月中，市场迎来政策拐点。10 月 23 日，二十届四中全会《公报》正式发布，“十五五”规划为未来五年经济转型勾画宏伟蓝图，重点强调科技自立自强与内需扩容战略，政策底的明确有效对冲了外部不确定性。月末利好集中释放。10 月 30 日，中美元首于韩国釜山举行会晤；同日，商务部宣布中美双方在吉隆坡经贸磋商取得突破性进展——“芬太尼关税”税率下调 10 个百分点，“对等关税”中 24% 的部分获展期一年。与此同时，美联储宣布降息 25 个基点，将联邦基金利率下调至 3.75%-4.00% 区间，并明确自 12 月 1 日起结束缩表操作。关税政策不确定性的缓解叠加美联储降息落地，为市场情绪修复奠定了基础。

11 月上证科创板 100 指数下跌 3.68%。市场主线围绕美联储 12 月降息预期摇摆及 AI 泡沫讨论升温展开。受益于中美吉隆坡共识的稳步落实，叠加国内 10 月 CPI 同比转正、PPI 环比回升等经济数据利好，上证指数于 11 月 14 日创下年内新高 4034 点。随后市场承压回调。一方面，受美

国联邦政府临时停摆影响，官方就业数据发布延期，美联储降息路径失去关键数据指引，叠加部分鹰派官员发言，12 月降息预期一度跌至 20%；另一方面，海外市场传出“AI 泡沫论”，引发市场对 AI 资本开支可持续性的质疑，全球科技股普遍回调。月末市场企稳反弹。美联储理事沃勒发表鸽派言论支持 12 月降息，中美元首通话进一步提振市场风险偏好，全球风险资产价格企稳回升。产业端，国内商业航天企业新型运载火箭成功发射并入轨，商业航天成为新的市场主线。

12 月上证科创板 100 指数上涨 5.97%。国产算力龙头登陆科创板，存储龙头 IPO 获受理。国内方面，据外媒报道，国内科技巨头计划加大顶级芯片采购及 AI 基础建设投入，同时增加国产算力芯片的采购规模，国产算力板块显著回温。海外方面，美国 11 月 CPI 数据显著低于预期，12 月 10 日美联储如期降息 25BP，同时上调了明年的经济增长预期，温和下调了通胀预期。

展望 2026 年，全球主要经济体有望形成财政货币双宽松的共振格局，中国经济在政策持续发力下迎来新一轮扩张周期。海外方面，美联储 12 月议息会议将利率降至 3.5%-3.75% 区间，市场预期 2026 年仍有 1-2 次降息空间。叠加 5 月美联储主席换届，新任主席需支持低利率政策以配合财政债务融资需求，美国货币宽松格局有望延续。在降息与财政赤字双重压力下，美元大概率维持偏弱走势——2025 年美元指数全年下跌约 9.5%，创 2017 年以来最大年度跌幅。宽松货币环境已在美元定价的商品市场充分体现，文华商品指数创出历史新高，黄金等贵金属价格屡破纪录；2025 年第三季度美国 GDP 环比折年率跃升至 4.3%，远超市场预期。预计 2026 年美国将延续宽松的货币与财政政策组合，为中期选举营造有利环境。国内方面，2026 年作为“十五五”规划开局之年，财政端稳增长政策有望持续加码。需求端，扩大内需位列中央经济工作会议 2026 年八大任务之首，政府投资特别是中央预算内投资和地方政府专项债券将发挥关键支撑作用。供给端，反内卷政策限制新增产能、加速落后产能出清，有助于改善供需格局、推动 PPI 转正，企业盈利有望伴随 PPI 回升进入扩张周期。市场层面，随着国内长端利率下探至 2% 以下，股债性价比显著提升，居民财富有望从债市向股市迁移；与此同时，人民币汇率企稳升值将增强外资流入动能，A 股市场有望迎来内外资金共振的有利窗口。上证科创板 100 指数作为新质生产力的核心代表，其走势将继续锚定国内产业政策支持与全球科技周期演进。在人工智能技术浪潮、商业航天产业爆发及半导体自主化攻坚等多重主线的驱动下，有望持续体现中国新质生产力的增长动能与市场价值。

#### 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-2.26%，同期业绩比较基准收益率为-2.94%；基金 C 类份额净值增长率为-2.32%，同期业绩比较基准收益率为-2.94%。

#### 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              | 89,496,314.52 | 90.85        |
|    | 其中：股票             | 89,496,314.52 | 90.85        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 5,051,329.09  | 5.13         |
|    | 其中：债券             | 5,051,329.09  | 5.13         |
|    | 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      | 80,456.32     | 0.08         |
| 8  | 其他资产              | 3,884,496.93  | 3.94         |
| 9  | 合计                | 98,512,596.86 | 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              | 73,640,114.77 | 76.94        |
| 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  | 15,089,586.30 | 15.77        |
| 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       | 518,133.94    | 0.54         |
| 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        | 89,247,835.01 | 93.25 |

### 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              | —          | —            |
| C  | 制造业              | 136,760.64 | 0.14         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 108,127.62 | 0.11         |
| 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  | —          | —            |
| 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       | 3,591.25   | 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               | 248,479.51 | 0.26         |

### 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  | 688347 | 华虹公司 | 28,857 | 3,112,804.59 | 3.25         |
| 2  | 688110 | 东芯股份 | 21,970 | 2,885,759.50 | 3.02         |
| 3  | 688498 | 源杰科技 | 4,226  | 2,713,049.74 | 2.83         |
| 4  | 688002 | 睿创微纳 | 25,188 | 2,538,950.40 | 2.65         |
| 5  | 688361 | 中科飞测 | 14,692 | 2,247,729.08 | 2.35         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 6  | 688027 | 国盾量子 | 4,405  | 2,219,194.95 | 2.32 |
| 7  | 688235 | 百济神州 | 8,129  | 2,183,449.40 | 2.28 |
| 8  | 688313 | 仕佳光子 | 22,919 | 2,034,748.82 | 2.13 |
| 9  | 688385 | 复旦微电 | 26,397 | 1,945,458.90 | 2.03 |
| 10 | 688019 | 安集科技 | 8,071  | 1,758,832.32 | 1.84 |

### 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  | 600930 | 华电新能 | 17,328 | 108,127.62 | 0.11         |
| 2  | 688795 | 摩尔线程 | 74     | 30,797.32  | 0.03         |
| 3  | 688783 | 西安奕材 | 1,671  | 30,679.56  | 0.03         |
| 4  | 688759 | 必贝特  | 581    | 14,588.91  | 0.02         |
| 5  | 688729 | 屹唐股份 | 394    | 9,566.32   | 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      | 5,051,329.09 | 5.28         |
| 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        | 5,051,329.09 | 5.28         |

### 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  | 019773 | 25 国债 08 | 42,000 | 4,242,405.04 | 4.43         |
| 2  | 019766 | 25 国债 01 | 8,000  | 808,924.05   | 0.85         |

### 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规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   | 15,719.35    |
| 2  | 应收证券清算款 | 354,122.52   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 3,514,655.06 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | —            |
| 7 | 其他    | —            |
| 8 | 合计    | 3,884,496.93 |

#### 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  | 600930 | 华电新能 | 108,014.40     | 0.11         | 新股流通受限   |
| 2  | 688795 | 摩尔线程 | 30,797.32      | 0.03         | 新股流通受限   |
| 3  | 688783 | 西安奕材 | 30,679.56      | 0.03         | 新股流通受限   |
| 4  | 688759 | 必贝特  | 14,588.91      | 0.02         | 新股流通受限   |
| 5  | 688729 | 屹唐股份 | 9,566.32       | 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 100 指数发起 A | 中欧上证科创板 100 指数发起 C |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 23,200,224.16      | 38,247,753.69      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,951,807.85       | 26,416,266.88      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 7,506,988.50       | 34,234,167.69      |
| 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               | 20,645,043.51      | 30,429,852.88      |

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                       | 中欧上证科创板 100 指数发起 A | 中欧上证科创板 100 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（%） | 48.44              | —                  |

注：买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，卖出/赎回总份额含转换出份额。

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申购、赎回本基金的情况。

§ 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 | 19.58%       | 10,000,000.00 | 19.58%       | 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 | 19.58%       | 10,000,000.00 | 19.58%       | 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              | 2025 年 12 月 30 日至 2025 年 12 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 19.58% |

|                                                                                                                                |  |        |  |  |  |  |  |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------|--|--|--|--|--|
|                                                                                                                                |  | 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 1 月 22 日