

中欧基金管理有限公司中欧中证500指数量化增强型证券投资基金基金份额发售公告

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

二零二六年三月

重要提示

1.中欧中证500指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]3064号文准予注册。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、收益及市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2.本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为招商银行股份有限公司,登记机构为中欧基金管理有限公司。

3.本基金为中欧中证500指数量化增强型证券投资基金,基金运作方式为契约型开放式。

4.本基金A类基金份额的基金份额代码为O26774,C类基金份额的基金份额代码为O26775。

5.本基金通过本公司直销机构及其他基金销售机构的销售网点公开发售。

6.本基金的发售期自2026年4月13日起至2026年4月30日止。

7.本基金首次募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集期利息,下同)。

在募集期内任何一天(含第一天)当日募集截止时间后累计有效认购申请金额(不包括利息,下同)合计超过20亿元,基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者,由此产生的损失由投资者自行承担。

当发生部分确认时,末日基金份额投资者认购费率按照单笔认购申请金额所对应的费率计算,末日认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。

8.本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者人。

9.投资者办理认购时,本基金其他销售机构的销售网点每个账户首次认购单笔最低金额为1元(含认购费),追加认购单笔最低金额为0.01元(含认购费);直销机构每个账户首次最低认购金额为10,000元,追加认购单笔最低金额为10,000元,不设级差限制。在不违反前述规定的前提下,各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

10.本基金的最低募集份额总额为2亿份,最低募集金额总额为人民币2亿元。

11.投资者欲认购本基金,须开立本公司基金账户,已经有该类账户的投资者无须另行开立。

12.本基金的有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

13.销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

14.本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请阅读2026年3月25日刊登在本公司网站(www.zofund.com)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件。投资人亦可通过本公司网站了解本公司的详细情况和本基金发售的相关事宜。

15.各销售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。未开设销售网点的地方的投资人,请拨打本公司的客户服务热线021-68609700、400-700-9700(免长途话费)咨询认购事宜。

16.在募集期间,如出现调整发售机构的情形,本公司将及时在基金管理人网站公示。

17.本公司综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整。

18.风险提示:投资有风险,投资人在认购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或赎回导致的流动性风险、基金管理人或在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有的风险等。

基金资产如投资于港股,将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,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对港股的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情况下,港股不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。具体风险请查阅基金招募说明书的“风险提示”章节的具体内容。

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将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。

本基金可投资存托凭证,除与其他投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

基金合同生效后,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,不需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。

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资产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

为对冲信用风险,本基金可能投资于信用衍生品,信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启用侧袋机制,具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对相关基金简称进行特殊标识,并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品,股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险,包括杠杆风险、市场风险、流动性风险、保证金风险等,由此可能增加本基金净值的波动性。

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资、转融通证券出借业务,可能存在流动性风险、市场风险和信用风险等融资、转融通证券出借业务特有风险。

本基金可投资于科创板,会面临科创板机制下因投资标的、市场流动性以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

一、本次基金募集和基金份额发售的基本情况

(一)基金名称

中欧中证500指数量化增强型证券投资基金

(二)基金简称及代码

本基金A类基金份额的简称为“中欧中证500指数量化增强A”,代码:O26774

本基金C类基金份额的简称为“中欧中证500指数量化增强C”,代码:O26775

(三)基金类型

股票型证券投资基金

(四)基金的运作方式

契约型开放式

(五)基金投资目标

通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制,追求获得超越标的指数的回报。

(六)基金存续期限

不定期。

(七)基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

(八)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者人。

(九)基金投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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)、信用衍生品(不含合约类)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)。

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%,投资于标的指数成份股及其备选股成份的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构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。

(十)募集规模

本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于人民币2亿元。

本基金首次募集规模上限为20亿元人民币。

在募集期内任何一天(含第一天)当日募集截止时间后累计有效认购申请金额合计超过20亿元,基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者,由此产生的损失由投资者自行承担。

当发生部分确认时,末日基金份额投资者认购费率按照单笔认购申请金额所对应的费率计算,末日认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。

(十一)募集方式

通过各销售机构的基金销售网点或指定的其他方式公开发售,各销售机构的具体名单见本公告“一、本次基金募集和基金份额发售的基本情况”中的“(十三)基金份额发售机构”以及基金管理人网站公示的基金销售机构名录。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

(十二)单笔最低认购限制

本基金其他销售机构的销售网点每个账户首次认购单笔最低金额为1元(含认购费),追加认购单笔最低金额为0.01元(含认购费);直销机构每个账户首次最低认购金额为10,000元,追加认购单笔最低金额为10,000元,不设级差限制。在不违反前述规定的前提下,各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参见相关公告。

销售机构可根据市场行情,调整认购金额的数量限制,基金管理人必须最迟在调整实施前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

(十三)基金份额发售机构

(1)直销机构:

名称:中欧基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层、10层、16层

法定代表人:裘玉明

联系人:马云歌

电话:021-68609602

传真:021-68609601

客服热线:021-68609700、400-700-9700(免长途话费)

网址:www.zofund.com

(2)其他销售机构

各销售机构的具体名单见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。基金管理人可以根据情况针对某类基金份额变更、增加或者减少销售机构,并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变更、增加或者减少其销售机构、网点。各销售机构具体销售时间以及提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

(十四)募集时间安排

本基金的募集期限为自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

本基金的募集期为自2026年4月13日起至2026年4月30日止。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期内适当延长、缩短或调整基金的发售时间,并及时公告。

(十五)如突发事件及其它特殊情况,以上基金募集期的安排可以适当调整。

二、募集方式及相关规定

(一)认购账户

投资人欲认购本基金,须开立本公司基金账户,已经有该类账户的投资者无需另行开立。

(二)认购方式

1.投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

2.投资人在募集期内可多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。

3.投资人在T日规定时间内提交的认购申请,应于T+2日(包括该日)后及时在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购申请是否被成功受理。

4.销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

(三)认购费用

1.认购费用

通过直销机构认购本基金A类基金份额不收取认购费(对于投资者通过基金管理人的基金销售子公司认购时参照适用,不收取认购费用),通过其他销售机构认购本基金A类基金份额收取认购费用,C类基金份额不收取认购费用。通过其他销售机构认购本基金A类基金份额的,在投资者认购时收取认购费,认购费率随认购金额的增加而递减。基金认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。通过其他销售机构认购本基金A类基金份额的认购费用见下表:

认购费率	认购金额(M) 费率/费用
	M<500万元
	0.30%
	M≥500万元
	每笔1000元

投资人如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。

2.认购份额的计算

(1)若投资者选择认购A类基金份额,则认购份额的计算公式为:

1)若投资者通过直销机构认购A类基金份额:

认购份额=(认购金额+认购利息)/1.00元

认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人在认购期通过直销机构投资100,000元认购本基金A类基金份额,假设这100,000元在认购期间产生的利息为30.00元,则其可得到的A类基金份额数计算如下:

认购份额=(100,000+30.00)/1.00=100,030.00份

即:投资人通过直销机构投资100,000元认购本基金A类基金份额,在认购期结束时,假设这100,000元在认购期间产生的利息为30.00元,投资人账户登记有本基金A类基金份额100,030.00份。

2)若投资者通过其他销售机构认购A类基金份额:

当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算公式为:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/1.00元

当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购利息)/1.00元

认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人在认购期内通过其他销售机构投资100,000元认购本基金A类基金份额,其对应的认购费率为0.30%,假设这100,000元在认购期间产生的利息为29.50元,则其可得到的A类基金份额数计算如下:

净认购金额=100,000/(1+0.30%)=99,700.90元

认购费用=100,000-99,700.90=299.10元

认购份额=(99,700.90+29.50)/1.00=99,730.40份

即:投资人通过其他销售机构投资100,000元认购本基金A类基金份额,其对应的认购费率为0.30%,在认购期结束时,假设这100,000元在认购期间产生的利息为29.50元,投资人账户登记有本基金A类基金份额99,730.40份。

(2)若投资者选择认购C类基金份额,则认购份额的计算公式为:

认购份额=(认购金额+认购利息)/1.00元

认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人在认购期投资100,000元认购本基金C类基金份额,假设这100,000元在认购期间产生的利息为30.00元,则其可得到的C类基金份额数计算如下:

认购份额=(100,000+30.00)/1.00=100,030.00份

即:投资人投资100,000元认购本基金C类基金份额,在认购期结束时,假设这100,000元在认购期间产生的利息为30.00元,投资人账户登记有本基金C类基金份额100,030.00份。

(四)募集资金利息的处理

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

(五)发售机构

本基金的发售机构请参见本公告“一、本次基金募集和基金份额发售的基本情况”中的“(十三)基金份额发售机构”,如在募集期间调整销售机构,请见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。

三、本基金账户的开户与认购程序

(一)使用账户说明

投资人认购本基金应开立本公司开放式基金基金账户。本基金份额发售期内各基金销售机构和直销机构同时为投资者办理开立基金账户的手续。

投资者可在不同销售机构开户,但每个投资者只允许开立一个基金账户。

投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

(二)本公司直销机构办理开户(或账户注册)与认购的程序

1.在本基金募集期间,本公司设在上海的直销机构为首次单笔认购金额不低于1万元的投资者办理开户(或账户注册)、认购手续,追加认购单笔最低认购金额为1万元。

2.办理开户(或账户注册)及认购的时间:

本基金募集期间每日9:30-16:30(周六、周日和节假日不受理申请)。

3.办理开户(或账户注册)须提交的材料:

投资人认购本基金,需开立本公司开放式基金基金账户,如已开立则不需重新办理。在基金募集期间,投资人的开户和认购申请可同时办理。办理基金账户开户(或账户注册)须提交以下材料:

(1)个人投资者必须提交以下材料(包括但不限于):

①本人现时有效的身份证明原件及复印件(如为第二代身份证,应提供正反面复印件);

②本公司开放式基金基金账号(若有)原件及复印件;

③填写的《开放式基金账户业务申请表》一式两份,并经本人有效签名;

④指定银行账户的存折或银行卡的原件及复印件(正反面,反面需有本人有效签名);

⑤承诺函;

⑥填写的《投资人风险承受能力测评问卷(自然人)》;

⑦填写并签署《个人税收居民身份声明文件》;

⑧填写并签署《投资者类型及风险匹配告知书及投资者确认函》。

注:根据《证券期货投资者适当性管理办法》第八条规定第(五)项认定为专业投资者的申请流程如下:

①填写并签署《普通投资者转化为专业投资者申请及确认书》;

②提供相关金融机构出具的资产证明或工作单位出具的收入证明;

③提供相关金融机构出具的最近2年投资记录原件;或者具有属于《证券期货投资者适当性管理办法》第八条第(一)项规定的专业投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师的从业经历,则可提供工作单位出具的在职证明。

(2)机构投资者必须提交以下材料(包括但不限于):

<1>本公司开放式基金基金账号(若有)原件及复印件;

<2>出示营业执照原件或事业法人、社会团体或其他组织的主管部门或民政部颁发的注册登记证书原件,提供加盖单位公章的复印件;

<3>基金业务授权委托书原件(加盖公章和法定代表人/负责人章/负责人章);

<4>提供法定代表人/负责人身份证件复印件(如为第二代身份证,应提供正反面复印件);

<5>业务经办人有效身份证明原件及复印件(如为第二代身份证,应提供正反面复印件);

<6>加盖预留印章(公章、私章各一枚,并加盖公章)的《预留印章卡》一式两份;

<7>指定银行账户的《开户许可证》原件或指定银行出具的开户证明原件,提供复印件;

<8>填写的《开放式基金账户业务申请表》,并加盖公章和法定代表人/负责人签章;

<9>承诺函;

<10>填写的《传真委托协议书》一式两份,并加盖公章和法定代表人/负责人签章;

<11>填写的《投资人风险承受能力测评问卷(机构版)》;

<12>提供加盖单位公章的《投资者类型及风险匹配告知书及投资者确认函》;

<13>提供填写并加盖单位公章和法人代表人签章的《机构投资者转化专业投资者申请及确认书》;

<14>若机构类型是消极非金融机构,还需提供填写妥及控制人签字的《控制人税收居民身份声明文件》;

<15>如以相关产品名义开立基金账户,还须提供相关产品的批复及证明文件;

<16>加盖单位公章的机构资质证明文件复印件;

<17>提供填写并加盖单位公章和经办人签章的《非自然人客户受益所有人信息收集表》及我可要求的其他反洗钱材料。

注:根据《证券期货投资者适当性管理办法》第八条规定,除(一)、(二)、(三)项列明的机构可直接认定为专业投资者以外,根据第(四)项认定为专业投资者的申请流程如下:

①填写并加盖单位公章及法人章《普通投资者转化为专业投资者申请及确认书》;

②提供加盖单位公章的最近1年经审计的财务报表;

③提供加盖单位公章的最近1年相关金融机构出具的资产证明;

④由相关金融机构出具的最近2年投资记录原件。

注:上述指定银行账户是指投资者开户时预留并确认的作为赎回、分红、退款的唯一结算账户,原则上银行账户名称必须同投资人基金账户的户名一致。