

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

更新招募说明书摘要

(2012 年第 2 号)

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇一二年八月

重要提示

本基金经 2010 年 5 月 4 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2010]588 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2010 年 6 月 24 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只股票型基金，属证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本摘要根据《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、

《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2012 年 6 月 23 日(特别事项注明除外)，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

一、基金管理人	5
二、基金托管人	8
三、相关服务机构	12
四、基金的名称	24
五、基金的类型	24
六、基金的投资目标	24
七、基金的投资方向	24
八、基金的投资策略	24
九、基金的业绩比较基准	31
十、基金的风险收益特征	31
十一、基金投资组合报告	31
十二、基金的业绩	36
十三、基金的费用与税收	37
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	39

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
- 3、办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
- 4、法定代表人：唐步
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006 年 7 月 19 日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021- 68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：潘霄
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.2 亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 5,880 万元人民币，占公司注册资本的 49%；

国都证券有限责任公司出资 5,640 万元人民币，占公司注册资本的 47%；

万盛基业投资有限责任公司出资 480 万元人民币，占公司注册资本的 4%；

上述三个股东共出资 12,000 万元人民币。

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。21 年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部

总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

Gianluca Trombi 先生，中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行国际业务部主管，意大利籍。曾任摩根士丹利（米兰）投资银行部总监、意大利金融机构小组主管；摩根士丹利（伦敦/米兰）投资银行部执行总监；瑞士联合银行（苏黎世）金融机构小组副总裁；毕马威会计师事务所（咨询业务·米兰）公司/战略金融服务资深经理；毕马威会计师事务所（审计业务·米兰）资深审计师。

Guido Masella 先生，中欧基金管理有限公司董事，意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利籍。曾任意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

陈金占先生，中欧基金管理有限公司董事，国都证券有限责任公司副总经理，中国籍。历任中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

Barry Livett 先生，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司 (International Securities Consultancy Ltd.) 咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

刘桓先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

肖微先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

2、基金管理人监事会成员

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

刘中先生，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

刘玫女士，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商投资促进中心项目经理、加拿大DESROSIERS-LOMBARDI-DOLBEC注册会计师事务所审计师、美国GENERAL EASTERN TRADING公司财务经理。

3、公司高级管理人员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，16 年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长；中国证券监督管理委员会基金监管部副处长；上投摩根基金管理有限公司督察长。

朱彦先生，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学经济学学士，16年以上证券从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工，海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管，海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理，北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理，国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理、上海长阳路证券营业部总经理。

周蔚文先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2011年5月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自2011年8月起至今），中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自2012年3月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，12年以上证券从业经验。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自2006年11月起至2011年1月），中欧基金管理有限公司研究部总监。

黄桦先生，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理，中国籍。复旦大学经济学硕士，22年以上证券及基金从业经验。曾先后就职于上海爱建信托公司、上海万国证券公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券有限责任公司等金融机构。历任光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监、信诚基金管理有限公司运营

部总监及信息技术部总监。

4、本基金基金经理

(1) 现任基金经理

张大方先生，中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，中国籍。上海财经大学工商管理专业硕士，4年证券从业经验。历任天治基金管理有限公司系统管理员，光大保德信基金管理有限公司IT部高级经理、投资部研究员、高级研究员。现任中欧基金管理有限公司金融工程部副总监，中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理(2011年9月1日起至今)。

(2) 历任基金经理

林钟斌先生，于2010年6月24日至2012年4月25日期间担任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。

5、公司投资决策委员会成员

公司副总经理兼投资总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、研究部副总监杨坤女士、专户理财部副总监沈洋先生、基金经理王海先生。其中副总经理兼投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路 154 号
办公地址：福州市湖东路 154 号
法定代表人：高建平
注册日期：1988 年 7 月 20 日

注册资本：人民币 107.86 亿元

托管部门联系人：刘峰

电话：021-62677777-212017

传真：021-62159217

兴业银行股份有限公司成立于 1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 107.86 亿元。

自开业以来，兴业银行始终坚持与客户“同发展、共成长”和“服务源自真诚”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2012 年一季度末，兴业银行资产总额达到 26293.98 亿元，股东权益 1239.57 亿元，不良贷款比率为 0.40%，一季度累计实现净利润 82.88 亿元。根据英国《银行家》杂志 2011 年发布的全球银行 1000 强排名，兴业银行按总资产排名列第 75 位，按一级资本排名第 83 位。

2、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、运营管理处、稽核监察处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等 9 个处室，共有员工 80 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

3、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2012 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 15 只——兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金，兴全保本混合型证券投资基金，中邮战略新兴产业股票型证

券投资基金5.78亿元，托管基金财产规模299.40亿元。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任

何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

(7) 审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设。

(8) 责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

4、内部控制制度及措施

(1) 制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

(6) 应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人

金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,立即报告中国证监会,同时,通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、场外发售机构

(1) 直销机构:

1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址:上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人:潘霄

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.lcfunds.com

2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址:www.lcfunds.com

(2) 代销机构

1) 兴业银行股份有限公司

住所:福州市湖东路 154 号

办公地址:福州市湖东路 154 号

法定代表人:高建平

电话: 021-52629999

联系人: 刘玲

客服电话: 95561

网址: <http://www.cib.com.cn>

2) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

电话: 95533

传真: 010-66275654

客服电话: 95533

联系人: 张静

网址: <http://www.ccb.com>

3) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 A 座 6 层

法定代表人: 李国华

传真: 010-68858117

联系人: 陈春林

客服电话: 95580

网址: <http://www.psbc.com/>

4) 中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 董文标

联系人: 董云巍

联系电话: 010-58560666

传真: 010-57092611

客户服务电话: 95568

网站: www.cmbc.com.cn

5) 招商银行股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195109

联系人: 邓炯鹏

客服电话: 95555

网址: www.cmbchina.com

6) 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人: 田国立

联系人: 王斌

电话: 010-65541585

传真: 010-65541230

客服电话: 95558

网址: bank.ecitic.com

7) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人: 宫少林

电话: 0755-82943666

传真: 0755-82943636

联系人: 林生迎

客服电话: 95565、4008888111

网址: <http://www.newone.com.cn>

8) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法人代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

9) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：林治海

电话：95575 或致电各地营业网点

传真：020-87555305

联系人：黄岚

公司网址：<http://www.gf.com.cn>

10) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：4008888108

传真：010-65182261

联系人：权唐

客服电话：4008888108

网址：<http://www.csc108.com>

11) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

网址：<http://www.guodu.com>

12) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄正大五道口广场 1 号楼 22 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565783

联系人：谢高得

客服电话：95562

网址：<http://www.xyzq.com.cn>

13) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服热线：010-66045678

传真：010-66045527

联系人：林爽

联系人电话：010-66045608

网址：<http://www.txsec.com>、<http://jijin.txsec.com>

14) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真： 021-22169134

联系人： 刘晨

客服电话: 4008888788, 10108998

网址： <http://www.ebscn.com>

15) 华福证券有限责任公司

住所： 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址： 福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人： 黄金琳

客服热线： 0591-96326

传真： 0591-87383610

联系人： 张腾

联系电话： 0591-87383623

网址： www.hfzq.com.cn

16) 宏源证券股份有限公司

住所： 新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址： 北京海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层

法定代表人： 汤世生

电话： 010-62267799-6416

传真： 010-62294601

联系人： 张智红

客服电话： 4008-000-562、010-62294600

网址： <http://www.hysec.com>

17) 中国银河证券股份有限公司

住所： 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址： 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人： 顾伟国

电话： 010-66568888

传真： 010-66568990

联系人： 田薇

客服电话: 4008-888-888

网址: <http://www.chinastock.com.cn>

18) 齐鲁证券有限公司

住所: 济南市经七路 86 号

办公地址: 济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人: 李玮

联系人: 吴阳

电话: 0531-68889155

传真: 0531-68889752

客服电话: 95538

网址: <http://www.qlzq.com.cn>

19) 申银万国证券股份有限公司

住所: 上海市常熟路 171 号

办公地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

电话: 021-54033888

传真: 021-54038844

联系人: 李清怡

客服电话: 95523 或 4008895523

网址: www.sywg.com

20) 海通证券股份有限公司

住所: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客服电话: 95553

网址: <http://www.htsec.com>

21) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法人代表：凤良志

联系人：李飞

联系电话：0551-2246298

联系传真：0551-2272100

客服电话：95578，4008888777

网址：<http://www.gyzq.com.cn>

22) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

联系电话：0755-22626391

网址：<http://www.pingan.com>

23) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服热线：4008888666

传真：021-38670666

联系人：吴倩

联系电话：021-38676666

网址：<http://www.gtja.com>

24) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

客服热线：4008-001-001

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

网址：<http://www.essences.com.cn>

25) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

客服热线：400-800-8899

传真：010-63080978

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

网址：<http://www.cindasc.com>

26) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

客服热线：95597

传真：025-51863323

联系人：万鸣

联系电话：025-83290979

网址：www.htsc.com.cn

27) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

客服热线：400-8888-128

传真：021-68767880

联系人：叶蕾

联系电话：021-68761616

网址：www.tebon.com.cn

28) 英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦西区 11 楼 1105B

法定代表人：赵文安

客服热线：4008-698-698

传真：0755-83007034

联系人：吴尔晖

联系电话：0755-83007159

网址：www.ydsc.com.cn

29) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客服热线：95558

传真：010-60833739

联系人：陈忠

联系电话：010-60838888

网址：www.citics.com

30) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

客服热线：021-63340678

传真：021-68728703

联系人：陈敏

联系电话：021-32229888-25113

网址：www.ajzq.com

31) 金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

客服热线：4008-888-228

联系人：马贤清

联系电话：0755-83025022

金元证券网址：www.jyzq.cn

32) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

客服热线：0532-96577

传真：0532-85022605

联系电话：0532-85022326

网址：www.zxwt.com.cn

33) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

办公地址：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

法定代表人：沈强

电话：0571-86078823

联系人：周研

客服电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构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。

2、场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

（二）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法人代表：金颖
联系人：朱立元
电话：010-59378839
传真：010-59378907

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人：韩炯
经办律师：吕红、黎明
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：吕红

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人：杨绍信
电话：021-23238888
传真：021-23238800

联系人：金毅

经办会计师：薛竞 金毅

四、基金的名称

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

五、基金的类型

上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金采用指数增强型投资策略。以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

(一) 投资策略

本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越

标的指数的投资收益。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期稳定增长为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在股票、债券、权证和现金等各类资产之间进行适度主动投资的调配。

在资产配置类别上，本基金投资于股票资产的比例为 90%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、股票投资策略

本基金被动投资组合采用复制标的指数的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资依据国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素对指数标的成份股及备选成份股进行优化；同时，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数沪深 300 指数成份股及备选成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

(1) 股票投资组合的构建

1) 指数跟踪部分的构建策略

本基金在建仓期内，将按照沪深 300 指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在有效跟踪业绩比较基准的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。

2) 指数增强部分投资策略

① 成份股及备选成份股的增强型策略

从定量分析和定性分析两个角度进行考察，依据行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行增强型配置。

由于沪深 300 指数成份股及备选成份股多为大盘蓝筹股，公司经营状况稳定，因而选择其中价值被低估的指数成份股及备选成份股进行个股增强型配置。在各行业内部根据成份股及备选成份股的价值因子的对比情况，将成份股及备选成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股及备选成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股及备选成份股以及价值被高估的负超额收益预期的

成份股及备选成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,有限度地增加价值被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限度地减少价值被高估的成份股及备选成份股的权重。

A. 定量分析方面,主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选,超配上述三项指标的数值均较好的行业。

B. 定性分析方面,以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础,结合对我国行业周期轮动特征的考察,从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势,超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

② 成份股及备选成份股以外的股票增强型策略

A. 进行一级市场股票投资

本基金适当参与一级市场股票的投资,以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

B. 精选具有投资潜力的股票

本基金管理人的股票选择策略旨在通过依托专业的研究力量,综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法,以“自下而上”的方式遴选出估值合理,具有持续成长能力的股票,将其纳入投资组合,分享中国经济高速增长的收益,力争实现高于指数的投资收益和基金资产的稳定增值。

a. 行业精选

本基金依据行业相对投资价值评估结果,精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业,在行业内部进行个股精选。

i. 定量分析方面,主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选,超配上述三项指标的数值均较好的行业。

ii. 定性分析方面,以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础,结合对我国行业周期轮动特征的考察,从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势,超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

b. 个股精选

本基金的非成份股选择策略旨在通过依托专业的研究力量,综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法,在精选的行业内部遴选出估值合理,具有持续成长能力的股票,将其纳入投资组合。选股程序包括历史财务数据数量选股和基本面选股。

i. 历史财务数据数量选股

本基金将使用上市公司过往 3 年的历史财务数据,选取主营收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、总资产周转率、股息率 5 个具有代表性的指标,力图获得高质量的成长股。在以上指标的计算过程中,4 月底时使用年报数据;8 月底时,存量指标(如总资产)使用半年报数据,流量指标(如净利润)使用当年上半年与前一年下半年相加的数据。

ii. 基本面选股

本基金对备选股票池的股票进行基本面分析,着重分析其成长性,将主要从短期业绩成长性、成长可持续性、公司治理、风险因素和投资价值五个方面来对上市公司进行综合分析。

最后,基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断,集合投研团队的集体智慧,对股票备选库中的股票做出合适的投资判断,重点选择那些具有持续成长能力的公司,并在其价值被市场低估时进行投资,追求有效控制跟踪误差条件下高于指数的投资收益。

(2) 投资组合调整策略

本基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,力争使基金净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最小化。

本基金采用定期调整和不定期调整相结合的方法对投资组合进行跟踪调整。

1) 定期调整:本基金股票指数化投资组合将根据标的指数的调整规则和备选成份股票的预期调整,对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法,以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

2) 不定期调整:

① 当成份股发生增发、送配等情况而影响其在指数中权重时，本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

② 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪业绩比较基准；

③ 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重构建投资组合时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

④ 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

3、跟踪误差调整策略

本基金以指数化投资为主，增强型投资为辅，为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金选择以跟踪偏离度为标准，对积极投资行为予以约束，以控制基金相对业绩比较基准的偏离风险。

本基金以日跟踪偏离度为测算基础，将该指标的最大容忍值设定为 0.5%，以每周为基金投资效益评价的单位时间，n 选定为 30 个交易日，计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当日）。如该指标接近或超过 0.5%，则基金经理必须通过归因分析，将跟踪误差分解，找出跟踪误差的来源。

如果跟踪误差源于积极投资的操作，则在适当时机进行必要的组合调整，以使跟踪偏离度回归到最大容忍值之内。当跟踪偏离度在最大容忍值之内时，由基金经理对最佳偏离度的选择做出判断。

综上所述，在本基金运作过程中，基金管理人将对指数基金的跟踪误差进行分析、计算和调整，具体措施如下：

(1) 确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；

(2) 计算跟踪误差及其相关指标的实际值：以每周为单位时间计算跟踪误差及其相关指标的具体指标值，如达到或超过预警阈值，就发出警戒信号，提示基金经理关注和调整；

(3) 将跟踪误差及其相关指标的实际值与控制目标值进行比较, 若符合条件, 则根据实际情况判断是否维持组合; 若不符合条件, 则对投资组合进行调整。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要, 将投资于国债、金融债等流动性好的债券。债券投资的目的是保证基金资产流动性, 在股票市场整体走势不看好的前提下, 为本基金提供较为安全的投资渠道, 从而有效利用基金资产、提高基金资产的投资收益。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上, 本基金主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例, 降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例, 获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

(二) 投资决策

1、投资决策依据

投资决策依据包括: 国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定; 宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势; 证券市场走势。

2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易, 及严格控制。

3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室, 投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。

其中, 投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构, 主要负责评价并批准不同基金的资产配置提案; 协同风险控制委员会, 审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险, 并在必要时做出修改。

投资总监全面负责公司基金投资管理业务, 协调所有基金的投资活动, 并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理负责通过与研究部的通力合作, 拟定资产配置提案提交投资决策委员会; 并负责投资组合的构建和日常管理, 向中央交易室下达投资指令并监控组

合仓位。

4、投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：为基金管理人的最高投资决策机构，由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部对标的指数成份股和备选成份股，以及其他投资标的进行独立研究，并依据研究成果建立基金股票池。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划。

（4）投资组合管理会议：由投资总监主持，基金经理、研究部总监等参加。按照投资决策委员会会议决议，审查基金投资计划或基金资产配置和投资组合，分析基金投资风格和交易特征，并对基金投资计划提出建议。当会议对所议事项达成一致意见时，可形成决议。如果会议对所议事项不能达成一致意见，由投资总监做出最终决策或提交投资决策委员会讨论。

（5）基金经理根据投资决策委员会会议和投资组合管理会议的决议进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须从基金股票池中选择投资标的，并严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（6）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

5、风险分析与绩效评估

数量分析师负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及股票市场的发展变化，结合基

金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

九、基金的业绩比较基准

业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人兴业银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2012 年第 1 季度报告，所载数据截至 2012 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	183,510,615.21	93.09
	其中：股票	183,510,615.21	93.09
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	13,605,602.70	6.90
6	其他各项资产	11,326.76	0.01

7	合计	197,127,544.67	100.00
---	----	----------------	--------

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,012,002.09	0.52
B	采掘业	17,599,139.43	9.04
C	制造业	56,749,216.73	29.15
C0	食品、饮料	11,451,619.37	5.88
C1	纺织、服装、皮毛	542,987.81	0.28
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,161,133.59	1.62
C5	电子	2,053,539.00	1.05
C6	金属、非金属	13,485,626.98	6.93
C7	机械、设备、仪表	19,199,431.29	9.86
C8	医药、生物制品	6,780,166.69	3.48
C99	其他制造业	74,712.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,713,475.64	1.91
E	建筑业	4,624,073.34	2.38
F	交通运输、仓储业	4,668,160.47	2.40
G	信息技术业	5,185,474.22	2.66
H	批发和零售贸易	4,430,267.83	2.28
I	金融、保险业	46,747,526.95	24.01
J	房地产业	8,435,977.11	4.33

K	社会服务业	1,902,584.08	0.98
L	传播与文化产业	346,130.37	0.18
M	综合类	2,791,961.83	1.43
	合计	158,205,990.09	81.26

2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	352,520.00	0.18
C	制造业	16,607,482.54	8.53
C0	食品、饮料	2,658,170.00	1.37
C1	纺织、服装、皮毛	543,375.00	0.28
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	939,960.00	0.48
C5	电子	2,971,404.00	1.53
C6	金属、非金属	1,158,224.42	0.59
C7	机械、设备、仪表	6,846,606.69	3.52
C8	医药、生物制品	1,489,742.43	0.77
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	804,685.00	0.41
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,087,647.58	1.07
H	批发和零售贸易	1,840,750.00	0.95

I	金融、保险业	691,240.00	0.36
J	房地产业	1,829,320.00	0.94
K	社会服务业	1,090,980.00	0.56
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	25,304,625.12	13.00

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

3.1 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	600016	民生银行	861,373	5,400,808.71	2.77
2	600036	招商银行	412,671	4,910,784.90	2.52
3	601318	中国平安	111,794	4,089,424.52	2.10
4	601328	交通银行	764,150	3,599,146.50	1.85
5	600000	浦发银行	373,373	3,334,220.89	1.71
6	601088	中国神华	110,070	2,818,892.70	1.45
7	600519	贵州茅台	13,861	2,730,062.56	1.40
8	000002	万科A	322,861	2,673,289.08	1.37
9	600030	中信证券	229,808	2,663,474.72	1.37
10	600837	海通证券	274,489	2,473,145.89	1.27

3.2 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	300007	汉威电子	70,800	1,057,044.00	0.54
2	002089	新海宜	97,786	1,055,110.94	0.54
3	600199	金种子酒	50,500	1,013,030.00	0.52
4	002146	荣盛发展	70,000	723,800.00	0.37
5	000002	万科A	84,000	695,520.00	0.36

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他各项资产构成

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	5,311.33
4	应收利息	5,023.28
5	应收申购款	992.15

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,326.76

(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。

(5.1) 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。

(5.2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(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。

十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日2010年6月24日，基金业绩截止日2012年3月31日。

1. 本报告期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

阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010.6.24—2010.12.31	4.93%	1.07%	12.83%	1.51%	-7.90%	-0.44%
2011.1.1—2011.12.31	-22.95%	1.21%	-23.83%	1.23%	0.88%	-0.02%
2012.1.1—2012.3.31	3.66%	1.46%	4.45%	1.44%	-0.79%	0.02%
2010.6.24-2012.3.31	-16.20%	1.21%	-10.23%	1.35%	-5.97%	-0.14%

数据来源：中欧基金 中证指数

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



数据来源：中欧基金 中证指数

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金上市费；
- 9、指数许可使用费用；
- 10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、指数许可使用费用

本基金管理人与指数许可方签订书面协议，约定指数许可使用的费用及支付方式。指数许可使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是基金管理人为获取指数许可方授予的使用指数开发基金的权利而支付的一次性费用，不列入基金费用；指数许可使用基点费是指基金设立后每个季度按照基金资产规模的一定比例收取的费用，列入基金费用。根据《中证指数有限公司指数使用许可协议》，在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。

自基金合同生效日起，指数许可使用基点费每季度支付一次，指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元整（即不足 5 万元时按照 5 万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。

4、除管理费、托管费和指数许可使用基点费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费和指数许可使用固定费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2011 年 8 月刊登的《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“重要提示”部分

更新了本更新招募说明书所载内容的截止时间。

(二) “二、释义” 部分

更新了《销售办法》的释义

(三) “三、基金管理人” 部分

- 1、更新了“（一）基金管理人概况” 中联系人信息。
- 2、更新了“（二）主要人员情况” 的以下信息：
 - (1) 更新了董事长的从业经验信息
 - (2) 更新了高级管理人员和基金经理的信息
 - (3) 更新了投资决策委员会成员的相关信息

(四) “四、基金托管人” 部分

更新了基金托管人的信息。

(五) “五、相关服务机构” 部分

- 1、更新了直销机构和代销机构的信息。
- 2、更新了会计师事务所和经办注册会计师的信息。

(六) “十二、基金的投资” 部分

更新了“（十一）基金投资组合报告” 的内容，数据截至 2012 年 3 月 31 日。

(七) “十三、基金的业绩” 部分

更新了基金业绩的有关信息，数据截至 2012 年 3 月 31 日。

(八) “二十五、其他应披露事项” 部分

更新了涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自 2011 年 12 月 24 日至 2012 年 6 月 23 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行有限责任公司开展的基金网上申购费率延期优惠活动的公告	2011.12.31

2	中欧基金管理有限公司旗下基金 2011 年 12 月 31 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2012.1.4
3	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2011 年第 4 季度报告	2012.1.18
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“深发展 A”股票估值方法的公告	2012.1.20
5	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2012 年第 1 号）	2012.2.6
6	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	2012.2.6
7	中欧基金管理有限公司关于新增中信证券（浙江）有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告	2012.2.13
8	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券（浙江）有限责任公司开通基金转换业务的公告	2012.2.13
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券（浙江）有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	2012.2.13
10	中欧基金管理有限公司关于调整《中欧基金管理有限公司直销网上交易定期定额申购业务规则》的公告	2012.3.1
11	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2011 年年度报告（正文）	2012.3.27
12	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2011 年年度报告（摘要）	2012.3.27
13	中欧基金管理有限公司关于开通上海银联兴业银行卡基金网上直销定期定额投资业务并实施费率优惠的公告	2012.4.13
14	中欧基金管理有限公司关于网上直销平台新增上海银联相关银行借记卡支付业务的公告	2012.4.13
15	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2012 年第 1 季度报告	2012.4.24
16	中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	2012.4.27
17	中欧基金管理有限公司关于成立北京分公司的公告	2012.5.17
18	中欧基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	2012.6.1
19	中欧基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	2012.6.2

上述内容仅为摘要，须与本基金《更新招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

中欧基金管理有限公司

2012 年 8 月 6 日