

**中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2016年年度报告摘要**

**2016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：兴业银行股份有限公司**

**送出日期：2017年03月31日**

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）	
场内简称	中欧300	
基金主代码	166007	
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2010年06月24日	
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	
报告期末基金份额总额	56,888,158.22份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010-08-16	
下属分级基金的基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
下属分级基金场内简称	中欧300	-
下属分级基金的交易代码	166007	001884
报告期末下属分级基金的份额总额	56,252,161.71份	635,996.51份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以沪深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。
投资策略	本基金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。
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）
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。
--	--------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张志永
	联系电话	021-68609600	021-62677777-212004
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95561
传真		021-33830351	021-62159217

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	中欧沪深300指数增强（LOF）A		
	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-668,647.56	61,865,106.46	-700,450.39
本期利润	-7,527,336.49	21,538,455.83	67,626,363.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1201	0.2259	0.3937
本期基金份额净值增长率	-8.78%	7.82%	51.46%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1753	0.2884	-0.0584
期末基金资产净值	66,112,363.19	83,443,410.73	316,966,820.15
期末基金份额净值	1.1753	1.2884	1.1949

3.1.4 期间数据和指标	中欧沪深300指数增强（LOF）E		
	2016年	2015年	2014年

本期已实现收益	24.84	4,355.01	—
本期利润	-41,351.30	9,806.30	—
加权平均基金份额本期利润	-0.0911	0.0718	—
本期基金份额净值增长率	-8.63%	11.74%	—
<b>3.1.5 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1710	0.1768	—
期末基金资产净值	748,336.55	326,230.57	—
期末基金份额净值	1.1766	1.2877	—

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额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。

4、自2015年10月8日起，本基金增加E类份额。

### 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

阶段 (中欧沪深300指数增强 (LOF) A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.46%	0.65%	1.67%	0.67%	-0.21%	-0.02%
过去六个月	6.83%	0.71%	4.72%	0.72%	2.11%	-0.01%
过去一年	-8.78%	1.39%	-10.63%	1.33%	1.85%	0.06%
过去三年	48.98%	1.72%	40.46%	1.70%	8.52%	0.02%
过去五年	51.32%	1.55%	39.91%	1.54%	11.41%	0.01%
自基金合同生效日至今	22.33%	1.47%	20.19%	1.49%	2.14%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

阶段 (中欧沪深300指数增	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
-------------------	--------	--------	--------	--------	-----	-----

强（LOF）E)	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	1.51%	0.65%	1.67%	0.67%	-0.16%	-0.02%
过去六个月	6.89%	0.71%	4.72%	0.72%	2.17%	-0.01%
过去一年	-8.63%	1.38%	-10.63%	1.33%	2.00%	0.05%
自基金份额运作日起 至今	2.10%	1.43%	-0.68%	1.38%	2.78%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

中欧沪深300指数增强（LOF）A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010年06月24日-2016年12月31日）



中欧沪深300指数增强（LOF）E

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年10月12日-2016年12月31日）

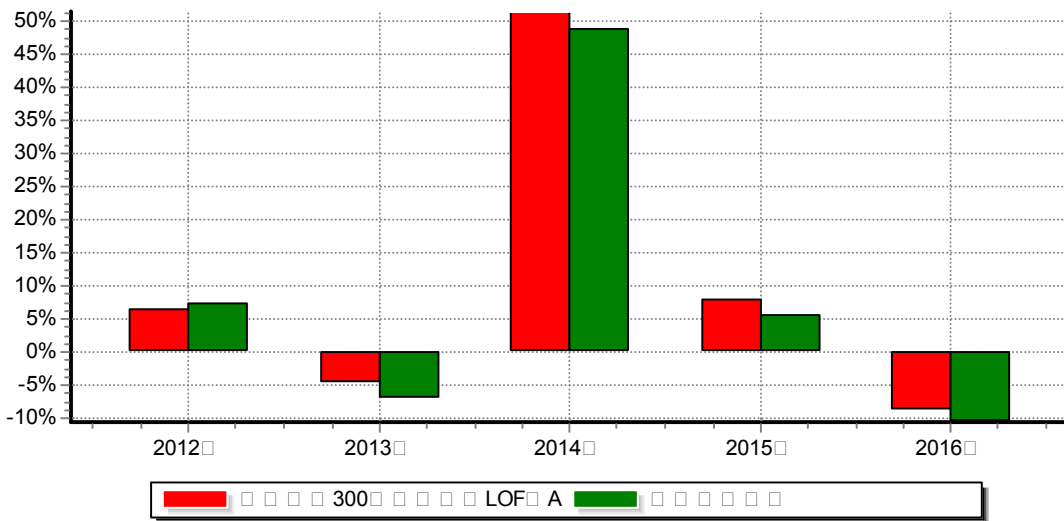


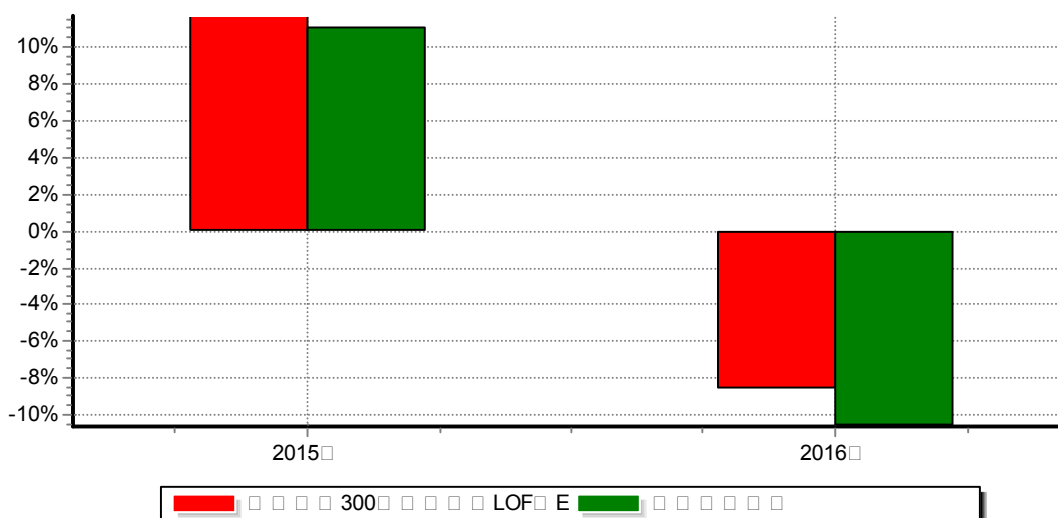
注：自2015年10月8日起，本基金增加E类份额。图示日期为2015年10月12日至2016年12月31日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

过去五年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：2015年10月8日本基金新增E类份额，2015年度数据为2015年10月12日至2015年12月31日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理50只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	基金经理，事业部负责人	2015年05月18日	—	10年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015年4月加入中欧基金管理有限公司，现任事业部负责人，中欧



					沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场经历了A股市场经历了熔断暴跌，底部振荡，和小幅反弹三个阶段；二季度大盘筑底企稳，整体波动率明显下降，不同行业收益分化较大，业绩好成长性预期强的行业，如新能源车产业链等板块有结构化行情；三季度，市场整体波动率又创新低，市场的预期风险不高，同时成长股业绩普遍超预期，业绩驱动的行情有利于量化方法甄选个股；四季度，尤其在11月后，小盘股风险大幅释放，蓝筹股和创业板的剪刀差效应十分明显，整体市场呈现震荡行情。报告期内，我们在依照合同，保持被动仓位完全复制沪深300的情况下，通过量化选股模型增配了包括国企改革，智能制造等概念股票板块，同时积极参与了新股申购，增厚收益。

##### 4.4.2 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-8.78%，同期业绩比较基准增长率为-10.63%；E类份额净值增长率为-8.63%，同期业绩比较基准率为-10.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年，我们认为在央行隐形加息的情况下，流动性收紧必然从银行间逐渐传到资本市场，对比历史情况，有业绩驱动的蓝筹股在加息周期中，表现较好。我们将利用量化模型，捕捉估值合理，盈利质量较高，盈利能力持续恢复的相关个股和板块，增强指数基金收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。

报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### **§ 6 审计报告**

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### **§ 7 年度财务报表**

#### **7.1 资产负债表**

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	5,647,124.73	6,484,193.19
结算备付金	5,540.00	96,404.41
存出保证金	11,041.68	31,948.12
交易性金融资产	61,536,358.87	78,381,280.29
其中：股票投资	61,536,358.87	78,381,280.29
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	146,130.24	—
应收利息	2,587.39	3,186.99
应收股利	—	—
应收申购款	4,385.52	27,866.38
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	67,353,168.43	85,024,879.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	734.29
应付赎回款	2,109.04	710,406.22

应付管理人报酬	58,341.67	72,499.14
应付托管费	8,751.27	10,874.87
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	8,351.06	65,110.59
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	414,915.65	395,612.97
负债合计	492,468.69	1,255,238.08
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	56,888,158.22	65,018,143.56
未分配利润	9,972,541.52	18,751,497.74
所有者权益合计	66,860,699.74	83,769,641.30
负债和所有者权益总计	67,353,168.43	85,024,879.38

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.1753元，基金份额总额56,888,158.22份，其中A类基金份额净值1.1753元，基金份额总额56,252,161.71份；E类基金份额净值1.1766元，基金份额总额635,996.51份。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>-5,997,377.50</b>	<b>24,506,745.63</b>
1.利息收入	83,611.45	157,835.52
其中：存款利息收入	83,611.45	156,673.74
债券利息收入	—	3.19
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	1,158.59

其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	804,928.00	64,347,971.38
其中：股票投资收益	-632,718.42	62,661,465.92
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	10,799.71
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	1,437,646.42	1,675,705.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,900,065.07	-40,321,199.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	14,148.12	322,138.07
<b>减：二、费用</b>	<b>1,571,310.29</b>	<b>2,958,483.50</b>
1. 管理人报酬	711,308.30	1,312,333.10
2. 托管费	106,696.29	196,849.98
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	113,390.87	782,197.98
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	639,914.83	667,102.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-7,568,687.79</b>	<b>21,548,262.13</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-7,568,687.79</b>	<b>21,548,262.13</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	65,018,143.56	18,751,497.74	83,769,641.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	7,568,687.79	-7,568,687.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-8,129,985.34	1,210,268.43	-9,340,253.77
其中：1.基金申购款	10,732,859.99	1,225,545.35	11,958,405.34
2.基金赎回款	-18,862,845.33	2,435,813.78	-21,298,659.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	56,888,158.22	9,972,541.52	66,860,699.74
项 目	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	265,269,910.92	51,696,909.23	316,966,820.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	21,548,262.13	21,548,262.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-200,251,767.36	54,493,673.62	-254,745,440.98
其中：1.基金申购款	67,196,923.73	25,567,873.96	92,764,797.69
2.基金赎回款	-267,448,691.09	80,061,547.76	-347,510,238.67

		58	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	65,018,143.56	18,751,497.74	83,769,641.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第588号《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》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,201,873,408.58元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第163号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年6月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,202,197,493.33份基金份额，其中认购资金利息折合324,084.75份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第254号文审核同意，本基金57,032,620份基金份额于2010年8月16日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据基金管理人中欧基金管理有限公司2015年10月8日《关于旗下部分开放式基金增加E类份额并相应修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2015年10月8日起对本基金增加E类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为A类基金份额，新增的基金份额类别命名为E类基金份额。A类基金份额的业务规则与现行规则相同；新增E类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司，只接受场外申赎，不参与上市交易。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的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。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%。本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数，力求控制本基金的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%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深300指数收益率 $+5\% \times$  银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2017年3月31日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券

投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（"中欧基金"）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司("北京百骏")	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a ("意大利")	基金管理人的股东

意联银行")	
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙） （"上海睦亿合伙"）	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（"中 欧盛世资管"）	基金管理人的控股子公司
钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司 （"钱滚滚财富"）	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月 31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国都证券	3,727,432.24	5.23%	19,275,405.23	4.42%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
国都证券	3,471.39	5.23%		—
关联方名称	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例

国都证券	17,748.20	4.45%	8,905.84	13.86%
------	-----------	-------	----------	--------

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月 31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国都证券	—	—	35,008.20	100.00%

#### 7.4.8.1.5 债券回购交易

无。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支 付的管理费	711,308.30	1,312,333.10
其中：支付销售机构 的客户维护费	191,208.00	343,029.93

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年01月01日至2016年 12月31日	2015年01月01日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	106,696.29	196,849.98

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日	
	中欧沪深 300指数增 强（LOF） A	中欧沪深 300指数增 强（LOF） E	中欧沪深 300指数增 强（LOF） A	中欧沪深 300指数增 强（LOF） E
报告期初持有的基金份额	—	122,023.00	75,466.54	—
报告期间申购/买入总份额	—	—	—	122,023.00
报告期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总 份额	—	—	75,466.54	—
报告期末持有的基金份额	—	122,023.00	—	122,023.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	19.19%	—	48.17%

注：本基金管理人本报告期内无申购、赎回或买卖本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人外的其他关联方本报告期内均未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2016年01月01日至2016年12月31日		2015年01月01日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,647,124.73	82,783.58	6,484,193.19	152,250.01

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	8,172	32,688.00	32,688.00
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	661	6,900.84	6,900.84
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股未上市	21.30	21.30	636	13,546.80	13,546.80

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-01-26	6.29	38,433	450,990.96	240,206.25
000540	中天城投	2016-11-28	重大资产重组	6.93	2017-01-03	7.00	12,100	123,469.30	83,853.00
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	14,033	139,616.96	97,810.01

002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27			9,985	112,720.19	82,575.95
300104	乐视网	2016-12-07	重大资产重组	35.80	2017-01-16	36.88	6,603	371,455.72	236,387.40
300537	广信材料	2016-10-12	重大资产重组	48.79	2017-01-13	43.91	477	4,383.63	23,272.83
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项未公告	16.63			9,821	158,381.92	163,323.23
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项未公告	14.60			7,602	219,062.52	110,989.20
600649	城投控股	2016-12-06	重大资产重组	20.34			11,081	85,192.57	225,387.54
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79	2017-03-28	10.90	7,761	164,285.18	83,741.19
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项未公告	8.42			19,900	206,233.78	167,558.00

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为59,968,118.63元，属于第二层次的余额为1,568,240.24元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次73,349,782.90元，第二层次5,031,497.39元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	61,536,358.87	91.36
	其中：股票	61,536,358.87	91.36
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,652,664.73	8.39
7	其他各项资产	164,144.83	0.24
8	合计	67,353,168.43	100.00



## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末（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	55,888.80	0.08
B	采矿业	2,000,118.44	2.99
C	制造业	19,540,162.35	29.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,131,882.04	3.19
E	建筑业	2,433,131.69	3.64
F	批发和零售业	1,348,888.88	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,738,230.51	2.60
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,463,122.09	5.18
J	金融业	20,151,122.17	30.14
K	房地产业	3,200,962.70	4.79
L	租赁和商务服务业	654,386.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	433,920.45	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	85,185.10	0.13
R	文化、体育和娱乐业	735,689.26	1.10
S	综合	250,297.20	0.37
	合计	58,222,987.68	87.08

### 8.2.2 报告期末（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	采矿业	—	—
C	制造业	2,041,983.96	3.05

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	516,428.23	0.77
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	157,982.00	0.24
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	32,688.00	0.05
K	房地产业	564,289.00	0.84
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	3,313,371.19	4.96

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告本期末未持有沪港通股票投资。

## 8.3 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

### 8.3.1 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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	68,746	2,435,670.78	3.64
2	600016	民生银行	259,135	2,352,945.80	3.52
3	600036	招商银行	102,951	1,811,937.60	2.71
4	000002	万科A	59,165	1,215,840.75	1.82
5	600519	贵州茅台	3,453	1,153,819.95	1.73
6	600000	浦发银行	68,612	1,112,200.52	1.66
7	000651	格力电器	35,776	880,805.12	1.32

8	601328	交通银行	149,993	865,459.61	1.29
9	601668	中国建筑	95,128	842,834.08	1.26
10	600837	海通证券	51,610	812,857.50	1.22

注：投资者欲了解本报告期末指数投资的所有股票明细，应阅读登载于www.zofund.com网站的年度报告正文。

### 8.3.2 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十名股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600773	西藏城投	47,300	564,289.00	0.84
2	600491	龙元建设	43,400	500,836.00	0.75
3	000703	恒逸石化	27,267	409,823.01	0.61
4	002540	亚太科技	49,400	387,790.00	0.58
5	600660	福耀玻璃	18,000	335,340.00	0.50
6	000055	方大集团	21,400	291,682.00	0.44
7	002055	得润电子	7,400	175,454.00	0.26
8	300353	东土科技	11,400	173,166.00	0.26
9	002654	万润科技	15,000	165,600.00	0.25
10	601021	春秋航空	4,300	157,982.00	0.24

注：投资者欲了解本报告期末积极投资的所有股票明细，应阅读登载于www.zofund.com网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300036	超图软件	1,001,659.00	1.20
2	000536	华映科技	997,505.00	1.19
3	002643	万润股份	985,074.00	1.18
4	002440	闰土股份	783,242.90	0.93
5	300017	网宿科技	699,940.00	0.84
6	300024	机器人	641,854.00	0.77
7	300301	长方集团	630,479.00	0.75

8	600773	西藏城投	615,249.15	0.73
9	600398	海澜之家	499,010.20	0.60
10	600491	龙元建设	493,634.00	0.59
11	002687	乔治白	439,965.00	0.53
12	300037	新宙邦	437,211.00	0.52
13	600136	当代明诚	434,897.00	0.52
14	600236	桂冠电力	423,600.00	0.51
15	000651	格力电器	416,089.00	0.50
16	600373	中文传媒	409,507.96	0.49
17	002285	世联行	403,392.00	0.48
18	000826	启迪桑德	401,551.00	0.48
19	002540	亚太科技	400,420.00	0.48
20	603366	日出东方	399,626.00	0.48

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300036	超图软件	1,021,431.00	1.22
2	000536	华映科技	983,732.00	1.17
3	300017	网宿科技	911,837.90	1.09
4	002643	万润股份	795,701.00	0.95
5	002440	闰土股份	784,471.40	0.94
6	300301	长方集团	640,022.32	0.76
7	300024	机器人	629,803.00	0.75
8	600016	民生银行	566,210.00	0.68
9	601318	中国平安	553,093.00	0.66
10	600398	海澜之家	492,310.20	0.59
11	001979	招商蛇口	448,749.34	0.54
12	600236	桂冠电力	437,894.60	0.52
13	600373	中文传媒	431,952.25	0.52
14	600036	招商银行	430,303.00	0.51
15	002687	乔治白	423,453.00	0.51

16	002285	世联行	416,333.40	0.50
17	300450	先导智能	412,600.00	0.49
18	300037	新宙邦	412,519.00	0.49
19	603366	日出东方	406,728.00	0.49
20	300359	全通教育	399,170.00	0.48

注：：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	31,379,072.30
卖出股票收入（成交）总额	40,691,210.23

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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。

### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的海通证券（600837）的发行主体，海通证券股份有限公司（以下简称公司），于2015年8月24日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（津证调查字2015011号）。

海通证券上海建国西路营业部、杭州解放路营业部、宁波百丈东路营业部涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为。海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身信息息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为，获利28,653,000元。

2016年11月28日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款。2016年11月28日，公司同时收到了中国证监会针对此案发送给公司员工的《结案通知书》，决定对丁学清、邹二海、高宏杰、汪峥、方贤明、沈云明、宋世浩先生涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为立案稽查。经审理，其涉案违法事实不成立，本案结案。在上述公告公布后，本基金管理人对该公司进行了进一步了解和析，认为上述处罚不会对海通证券的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

其余九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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	11,041.68
2	应收证券清算款	146,130.24
3	应收股利	—
4	应收利息	2,587.39
5	应收申购款	4,385.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	164,144.83

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
中欧沪 深300指 数增强	3,174	17,722.80	2,914,229.5 0	5.18%	53,337,932. 21	94.82%

(LOF) A						
中欧沪 深300指 数增强 (LOF) E	143	4,447.53	122,023.00	19.19%	513,973.51	80.81%
合计	3,317	17,150.48	3,036,252.5 0	5.34%	53,851,905. 72	94.66%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	许传凤	74811	8.78%
2	徐立新	49400	5.80%
3	汪秀娣	48705	5.72%
4	任晓光	46100	5.41%
5	乔爱科	36300	4.26%
6	李为民	35600	4.18%
7	刘巍	35004	4.11%
8	张达	30004	3.52%
8	林海洪	30004	3.52%
9	刘国珍	30001	3.52%
10	魏晓斐	21202	2.49%

注：以上均为中欧沪深300指数增强（LOF）A的场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧沪深300指数增强（LOF）A	0.00	0.00%
	中欧沪深300指数增强（LOF）E	0.00	0.00%



	合计	0.00	0.00%
--	----	------	-------

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	中欧沪深300指数 增强（LOF）A	0
	中欧沪深300指数 增强（LOF）E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	中欧沪深300指数 增强（LOF）A	0
	中欧沪深300指数 增强（LOF）E	0
	合计	0

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧沪深300指数增强 (LOF) A	中欧沪深300指数增强 (LOF) E
基金合同生效日(2010年06月24日) 基金份额总额	1,202,197,493.33	—
本报告期期初基金份额总额	64,764,801.45	253,342.11
本报告期基金总申购份额	9,687,454.15	1,045,405.84
减：本报告期基金总赎回份额	18,200,093.89	662,751.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	56,252,161.71	635,996.51

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。

#### § 11 重大事件揭示

##### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

##### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为60,000.00元人民币。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	33,781,376.53	47.40%	31,460.51	47.40%	
国海证券	1	13,713,675.01	19.24%	12,772.55	19.24%	
西部证券	1	7,919,808.83	11.11%	7,375.09	11.11%	
长江证券	1	6,899,206.51	9.68%	6,425.32	9.68%	
国都证券	2	3,727,432.24	5.23%	3,471.39	5.23%	
瑞银证券	1	3,490,906.70	4.90%	3,251.12	4.90%	
中信建投	1	1,738,658.	2.44%	1,619.36	2.44%	

		02				
海通证券	1		—	—	—	
招商证券	1		—	—	—	
中金公司	1		—	—	—	
广发证券	1		—	—	—	
华泰证券	1		—	—	—	
申银万国	1		—	—	—	
光大证券	1		—	—	—	
国金证券	1		—	—	—	
东方证券	1		—	—	—	

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未进行其他证券投资。

中欧基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日

