

中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2017年半年度报告

2017年06月30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08月29日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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8月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
	2.1 基金基本情况	5
	2.2 基金产品说明	5
	2.3 基金管理人和基金托管人	6
	2.4 信息披露方式	6
	2.5 其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	7
	3.1 主要会计数据和财务指标	7
	3.2 基金净值表现	7
§4	管理人报告	9
	4.1 基金管理人及基金经理情况	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
	4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5	托管人报告	12
	5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
	5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
	5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
	6.1 资产负债表	13
	6.2 利润表	14
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
	6.4 报表附注	17
§7	投资组合报告	37
	7.1 期末基金资产组合情况	38
	7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
	7.6 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	52
	7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
	7.8 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	52
	7.9 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	52
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
	7.12 投资组合报告附注	52
§8	基金份额持有人信息	53
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
	8.2 期末上市基金前十名持有人	54
	8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	55
§9	开放式基金份额变动	55
§10	重大事件揭示	56
	10.1 基金份额持有人大会决议	56
	10.2 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	56
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
	10.4 基金投资策略的改变	56
	10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56

10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	57
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	58
§11	备查文件目录	60
11.1	备查文件目录	60
11.2	存放地点	60
11.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）	
基金主代码	166007	
交易代码	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	54,276,600.49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
下属分级基金的场内简称	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	53,426,012.64份	850,587.85份

2.2 基金产品说明

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。
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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	福州市湖东路154号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	上海市江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		窦玉明	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司； E类份额：中欧基金管理有限公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号 E类份额：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
3.1.1 期间数据和指标	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
本期已实现收益	-623,658.34	-10,158.30
本期利润	6,932,906.65	98,001.45
加权平均基金份额本期利润	0.1266	0.1464
本期加权平均净值利润率	10.35%	11.94%
本期基金份额净值增长率	10.81%	10.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	16,149,100.52	136,085.66
期末可供分配基金份额利润	0.3023	0.1600
期末基金资产净值	69,575,113.16	1,109,709.44
期末基金份额净值	1.3023	1.3046
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	35.55%	13.21%

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。

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
过去一个月	5.35%	0.64%	4.73%	0.64%	0.62%	0.00%
过去三个月	6.37%	0.60%	5.79%	0.59%	0.58%	0.01%
过去六个月	10.81%	0.54%	10.23%	0.54%	0.58%	0.00%
过去一年	18.37%	0.63%	15.44%	0.63%	2.93%	0.00%
过去三年	71.76%	1.69%	65.95%	1.66%	5.81%	0.03%
自基金合同生效日至今	35.55%	1.43%	32.49%	1.45%	3.06%	-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指数增强 (LOF) E)	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
过去一个月	5.35%	0.64%	4.73%	0.64%	0.62%	0.00%
过去三个月	6.39%	0.60%	5.79%	0.59%	0.60%	0.01%
过去六个月	10.88%	0.54%	10.23%	0.54%	0.65%	0.00%
过去一年	18.51%	0.63%	15.44%	0.63%	3.07%	0.00%
自基金份额运作日至今	13.21%	1.24%	9.48%	1.20%	3.73%	0.04%

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-2017年06月30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-2017年06月30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2017年6月30日。

§ 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2017年6月30日，本基金管理人共管理57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	事业部负责人，基金经理	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1日加入中欧基金管理有限公司。

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 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非公平交易的情况。

4.3.2 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年以来A股市场市场波动率和风险较低，利率市场收紧和金融板块去杠杆的市场环境下，蓝筹股行情较优，整体趋势上行。上半年，我们维持了一贯的投资策略，在保持被动仓位完全复制沪深300的情况下，通过量化选股模型配置了白酒、新能源车和有色板块，获取了一定的超额收益。

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10.81%，同期业绩比较基准收益率为10.23%；E类份额净值增长率为10.88%，同期业绩比较基准收益率为10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，央行维持谨慎中性货币政策的环境下，流动性收紧已经从银行间逐渐传到资本市场，同时观察到，在6月底市场流动性收紧已经达到边界极值，流动性紧张略有宽松，因此在下半年，我们继续看好此前超跌且有业绩支撑的中盘蓝筹。操作上将采用量化模型，捕捉估值合理，盈利质量较高的个股，进行增强配置。

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合规守信情况声明

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合规守信、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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,795,489.83	5,647,124.73
结算备付金		3,166.74	5,540.00
存出保证金		3,556.45	11,041.68
交易性金融资产	6.4.7.2	66,627,524.23	61,536,358.87
其中：股票投资		66,627,524.23	61,536,358.87
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		214,167.51	146,130.24
应收利息	6.4.7.5	2,016.35	2,587.39
应收股利		—	—
应收申购款		26,954.81	4,385.52
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		71,672,875.92	67,353,168.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
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		326,546.82	—
应付赎回款		81,723.63	2,109.04
应付管理人报酬		56,456.47	58,341.67
应付托管费		8,468.49	8,751.27
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	10,184.95	8,351.06
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	504,672.96	414,915.65
负债合计		988,053.32	492,468.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,276,600.49	56,888,158.22
未分配利润	6.4.7.10	16,408,222.11	9,972,541.52
所有者权益合计		70,684,822.60	66,860,699.74
负债和所有者权益总计		71,672,875.92	67,353,168.43

注：报告截止日2017年6月30日，中欧300A类基金份额净值1.3023元,中欧300E类基金份额净值1.3046元,中欧300A类基金份额53,426,012.64份,300E类基金份额850,587.85份。

6.2 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注 号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		7,706,793.53	-11,595,907.41

1.利息收入		38,035.09	41,826.56
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	38,035.09	41,826.56
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		560.75	-1,526,230.48
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	-523,094.95	-2,109,329.93
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	—	—
资产支持证券投资收益	6.4.7 .13.2	—	—
贵金属投资收益	6.4.7 .14	—	—
衍生工具收益	6.4.7 .15	—	—
股利收益	6.4.7 .16	523,655.70	583,099.45
3.公允价值变动收益	6.4.7 .17	7,664,724.74	-10,120,201.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7 .18	3,472.95	8,698.34
减：二、费用		675,885.43	738,072.11
1. 管理人报酬		335,885.16	358,664.09
2. 托管费		50,382.81	53,799.63
3. 销售服务费		—	—

4. 交易费用	6.4.7 .19	30,194.81	53,968.85
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7 .20	259,422.65	271,639.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,030,908.10	-12,333,979.52
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,030,908.10	-12,333,979.52

6.3 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06月30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)	56,888,158.22	9,972,541.52	66,860,699.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	7,030,908.10	7,030,908.10
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）	-2,611,557.73	-595,227.51	-3,206,785.24
其中：1.基金申购款	3,829,239.03	870,997.31	4,700,236.34
2.基金赎回款	-6,440,796.76	-1,466,224.82	-7,907,021.58
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	54,276,600.49	16,408,222.11	70,684,822.60

（基金净值）			
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30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)	—	-12,333,979.52	-12,333,979.52
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）	-1,103,783.31	-14,088.43	-1,117,871.74
其中：1.基金申购款	8,146,093.37	744,745.04	8,890,838.41
2.基金赎回款	-9,249,876.68	-758,833.47	-10,008,710.15
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）	63,914,360.25	6,403,429.79	70,317,790.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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《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： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

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8月29日批准报出。

6.4.2 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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年半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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	4,795,489.83
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	4,795,489.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2017年06月30日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		58,286,345.23	66,627,524.23	8,341,179.00
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		58,286,345.23	66,627,524.23	8,341,179.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2017年06月30日
应收活期存款利息	2,013.62
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1.26
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.03
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1.44
合计	2,016.35

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	10,184.95
银行间市场应付交易费用	—
合计	10,184.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	47.62

预提信息披露费	390,212.09
预提审计费	29,752.78
预提上市费	29,752.78
其他应付	54,907.69
合计	504,672.96

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,252,161.71	56,252,161.71
本期申购	3,187,473.94	3,187,473.94
本期赎回	-6,013,623.01	-6,013,623.01
期末数	53,426,012.64	53,426,012.64
项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) E)	基金份额（份）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	635,996.51	635,996.51
本期申购	641,765.09	641,765.09
本期赎回	-427,173.75	-427,173.75
期末数	850,587.85	850,587.85

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、截至2017年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为900,548.00份，均为中欧沪深300A类基金份额(2016年6月30日：深交所上市的基金份额为1,089,024.00份，均为中欧沪深300A类基金份额)，托管在场外未上市交易的基金份额为53,376,052.49份，其中中欧沪深300A类基金份额52,525,464.64份，中欧沪深300E类基金份额850,587.85份(2016年6月30日：62,825,336.25份，其中中欧沪深300A类基金份额62,449,572.21份，中欧沪深300E类基金份额375,764.04份)。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在封闭期满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，在封闭期满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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,804,811.04	-16,944,609.56	9,860,201.48
本期利润	-623,658.34	7,556,564.99	6,932,906.65
本期基金份额交易产生的变动数	-1,351,422.37	707,414.76	-644,007.61
其中：基金申购款	1,518,602.29	-793,958.11	724,644.18
基金赎回款	-2,870,024.66	1,501,372.87	-1,368,651.79
本期已分配利润	—	—	—
本期末	24,829,730.33	-8,680,629.81	16,149,100.52

单位：人民币元

项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	108,723.82	3,616.22	112,340.04
本期利润	-10,158.30	108,159.75	98,001.45
本期基金份额交易产生的变动数	37,520.14	11,259.96	48,780.10
其中：基金申购款	110,141.67	36,211.46	146,353.13
基金赎回款	-72,621.53	-24,951.50	-97,573.03
本期已分配利润	—	—	—
本期末	136,085.66	123,035.93	259,121.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
----	-------------------------------

活期存款利息收入	37,907.02
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	76.27
其他	51.80
合计	38,035.09

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-523,094.95
股票投资收益——赎回差价 收入	—
股票投资收益——申购差价 收入	—
合计	-523,094.95

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出股票成交总额	10,801,808.30
减：卖出股票成本总额	11,324,903.25
买卖股票差价收入	-523,094.95

注：买卖投资差价收入包含股票吸收合并产生的差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

无余额。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无余额。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无余额。

6.4.7.15 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	523,655.70
基金投资产生的股利收益	—
合计	523,655.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
1.交易性金融资产	7,664,724.74
——股票投资	7,664,724.74
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——基金投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	7,664,724.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	3,310.45
转换费收入	162.50
合计	3,472.95

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	30,194.81
银行间市场交易费用	—
合计	30,194.81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	90,212.09
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
帐户维护费	9,000.00
汇划手续费	705.00
合计	259,422.65

注：根据《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》及《中证指数有限公司指数使用许可协议》，本基金的指数使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的0.016%，收取下限为每季度5万元。

在通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：

日指数使用费=前一日基金资产净值 X 0.016% / 当年天数。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.1.4 债券交易

无。

6.4.10.1.5 债券回购交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	335,885.16	358,664.09
其中：支付销售机构的客户维护费	90,590.73	96,597.24

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,382.81	53,799.63

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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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：份

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月 30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月 30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	—	122,023.00
报告期间申购/买入总份额	—	—	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
报告期末持有的基金份额	—	122,023.00	—	122,023.00
占基金总份额比例	—	14.35%	—	32.47%

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。

6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期内均未持有本基金。

6.4.10.5 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 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30 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	4,795,489.83	37,907.02	3,971,633.74	41,290.51

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，半年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)。

6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 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
000061	农产品	2017-06-28	重大资产重组	9.06			5,668	63,600.21	51,352.08
000100	TCL集团	2017-04-21	筹划重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	60,499	197,705.45	207,511.57
000503	海虹控股	2017-05-11	筹划重大事项	24.93			4,931	124,461.00	122,929.83
002129	中环股份	2016-04-25	筹划重大事项	8.27			9,985	112,720.19	82,575.95
002252	上海莱士	2017-04-21	筹划重大事项	20.24			6,724	87,225.06	136,093.76
002399	海普瑞	2017-04-28	筹划重大事项	20.23			2,709	67,686.84	54,803.07
300085	银之杰	2017-06-30	筹划重大事项	18.50	2017-07-07	18.88	1,900	56,943.00	35,150.00
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68			6,603	371,455.72	202,580.04
600050	中国联通	2017-04-05	筹划重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	54,286	272,797.44	405,516.42
600100	同方股份	2017-04-21	筹划重大事项	14.12			11,561	154,989.69	163,241.32
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59			7,602	219,062.52	110,913.18
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大资产重组	17.40			2,720	58,650.00	47,328.00
600795	国电电力	2017-06-05	筹划重大事项	3.60			62,122	229,670.96	223,639.20
600959	江苏有线	2017-06-19	重大资产重组	10.57			5,251	83,998.11	55,503.07
601088	中国神华	2017-06-05	筹划重大事项	22.29			12,898	255,634.15	287,496.42
601608	中信重工	2017-04-19	筹划重大事项	5.54	2017-07-26	5.26	8,600	66,335.35	47,644.00

601727	上海电气	2017-06-22	重大资产重组	7.57	2017-07-03	7.54	19,900	206,233.78	150,643.00
601872	招商轮船	2017-05-02	筹划重大事项	5.16			14,000	105,989.26	72,240.00
601919	中国远洋	2017-05-17	筹划重大事项	5.35	2017-07-26	5.89	19,700	254,946.67	105,395.00
601989	中国重工	2017-05-31	筹划重大事项	6.21			59,734	570,235.06	370,948.14

注：本基金截至2017年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过主要投资于未来持续成长能力强的潜力公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，

结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2017年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日

且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,795,489.83	—	—	—	4,795,489.83
结算备付金	3,166.74	—	—	—	3,166.74
存出保证金	3,556.45	—	—	—	3,556.45
交易性金融资产	—	—	—	66,627,524.23	66,627,524.23
应收证券清算款	—	—	—	214,167.51	214,167.51
应收利息	—	—	—	2,016.35	2,016.35
应收申购款	—	—	—	26,954.81	26,954.81
资产总计	4,802,213.0	—	—	66,870,662.	71,672,875.

	2			90	92
负债					
应付证券清算款	—	—	—	326,546.82	326,546.82
应付赎回款	—	—	—	81,723.63	81,723.63
应付管理人报酬	—	—	—	56,456.47	56,456.47
应付托管费	—	—	—	8,468.49	8,468.49
应付交易费用	—	—	—	10,184.95	10,184.95
其他负债	—	—	—	504,672.96	504,672.96
负债总计	—	—	—	988,053.32	988,053.32
利率敏感度缺口	4,802,213.02	—	—	65,882,609.58	70,684,822.60
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,647,124.73	—	—	—	5,647,124.73
结算备付金	5,540.00	—	—	—	5,540.00
存出保证金	11,041.68	—	—	—	11,041.68
交易性金融资产	—	—	—	61,536,358.87	61,536,358.87
应收证券清算款	—	—	—	146,130.24	146,130.24
应收利息	—	—	—	2,587.39	2,587.39
应收申购款	1,876.75	—	—	2,508.77	4,385.52
资产总计	5,665,583.16	—	—	61,687,585.27	67,353,168.43
负债					
应付赎回款	—	—	—	2,109.04	2,109.04
应付管理人报	—	—	—	58,341.67	58,341.67

酬					
应付托管费	—	—	—	8,751.27	8,751.27
应付交易费用	—	—	—	8,351.06	8,351.06
其他负债	—	—	—	414,915.65	414,915.65
负债总计	—	—	—	492,468.69	492,468.69
利率敏感度缺口	5,665,583.16	—	—	61,195,116.58	66,860,699.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金未持有交易性债券资产(2016年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例（%）		值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	66,627,524.23	94.26	61,536,358.87	92.04
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	66,627,524.23	94.26	61,536,358.87	92.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	业绩比较基准上升5%	374.30	346.42
	业绩比较基准下降5%	-374.30	-346.42

6.4.14 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2017年6月30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63,694,020.18元，属于第二层次的余额为2,933,504.05元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次59,968,118.63元，第二层次1,568,240.24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2017年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	66,627,524.23	92.96
	其中：股票	66,627,524.23	92.96
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	4,798,656.57	6.70
7	其他资产	246,695.12	0.34
8	合计	71,672,875.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	140,199.40	0.20
B	采矿业	2,066,728.07	2.92
C	制造业	23,110,600.78	32.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,706,660.57	2.41
E	建筑业	2,812,198.00	3.98
F	批发和零售业	1,508,002.95	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,879,969.95	2.66
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,251,474.83	4.60

J	金融业	22,850,668.49	32.33
K	房地产业	3,838,578.06	5.43
L	租赁和商务服务业	529,050.16	0.75
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	518,000.57	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	124,100.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	547,446.33	0.77
S	综合	175,644.30	0.25
	合计	65,059,322.46	92.04

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,568,201.77	2.22
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	—	—
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	—	—
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	1,568,201.77	2.22

7.2.3 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股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	3,410,489.06	4.82
2	600036	招商银行	102,951	2,461,558.41	3.48
3	600016	民生银行	259,135	2,130,089.70	3.01
4	600519	贵州茅台	3,453	1,629,298.05	2.31
5	000002	万 科 A	59,165	1,477,350.05	2.09
6	000651	格力电器	35,776	1,472,897.92	2.08
7	600000	浦发银行	89,196	1,128,329.40	1.60
8	601328	交通银行	164,593	1,013,892.88	1.43
9	601668	中国建筑	95,128	920,839.04	1.30
10	000333	美的集团	21,053	906,121.12	1.28
11	600030	中信证券	50,516	859,782.32	1.22
12	601288	农业银行	241,782	851,072.64	1.20
13	600887	伊利股份	38,886	839,548.74	1.19
14	600837	海通证券	51,610	766,408.50	1.08
15	601398	工商银行	136,601	717,155.25	1.01
16	601169	北京银行	77,464	710,344.88	1.00
17	000858	五 粮 液	12,507	696,139.62	0.98
18	601601	中国太保	20,340	688,915.80	0.97
19	600104	上汽集团	21,442	665,774.10	0.94

20	600900	长江电力	42,284	650,327.92	0.92
21	000725	京东方 A	150,597	626,483.52	0.89
22	601766	中国中车	60,796	615,255.52	0.87
23	002415	海康威视	18,127	585,502.10	0.83
24	600276	恒瑞医药	11,174	565,292.66	0.80
25	601211	国泰君安	27,301	559,943.51	0.79
26	601988	中国银行	134,025	495,892.50	0.70
27	000001	平安银行	51,201	480,777.39	0.68
28	600048	保利地产	44,011	438,789.67	0.62
29	600518	康美药业	19,878	432,147.72	0.61
30	601818	光大银行	101,204	409,876.20	0.58
31	600050	中国联通	54,286	405,516.42	0.57
32	600028	中国石化	66,692	395,483.56	0.56
33	601688	华泰证券	21,174	379,014.60	0.54
34	600015	华夏银行	41,023	378,232.06	0.54
35	002450	康得新	16,571	373,178.92	0.53
36	601989	中国重工	59,734	370,948.14	0.52
37	000063	中兴通讯	15,400	365,596.00	0.52
38	002304	洋河股份	4,110	356,789.10	0.50
39	600019	宝钢股份	52,929	355,153.59	0.50
40	000538	云南白药	3,776	354,377.60	0.50
41	002024	苏宁云商	30,475	342,843.75	0.49
42	000776	广发证券	19,185	330,941.25	0.47
43	001979	招商蛇口	15,400	328,944.00	0.47
44	600999	招商证券	18,671	321,514.62	0.45
45	601006	大秦铁路	38,053	319,264.67	0.45
46	601390	中国中铁	35,774	310,160.58	0.44
47	600585	海螺水泥	13,085	297,422.05	0.42
48	600690	青岛海尔	19,718	296,755.90	0.42
49	601628	中国人寿	10,984	296,348.32	0.42

50	601088	中国神华	12,898	287,496.42	0.41
51	601186	中国铁建	22,256	267,739.68	0.38
52	601009	南京银行	23,622	264,802.62	0.37
53	600703	三安光电	13,383	263,645.10	0.37
54	000423	东阿阿胶	3,658	262,973.62	0.37
55	600958	东方证券	18,901	262,912.91	0.37
56	601939	建设银行	42,612	262,063.80	0.37
57	601377	兴业证券	35,270	262,056.10	0.37
58	601901	方正证券	26,382	261,973.26	0.37
59	600637	东方明珠	12,079	261,751.93	0.37
60	002236	大华股份	11,142	254,149.02	0.36
61	002142	宁波银行	13,047	251,807.10	0.36
62	600660	福耀玻璃	9,500	247,380.00	0.35
63	600309	万华化学	8,572	245,502.08	0.35
64	600009	上海机场	6,558	244,678.98	0.35
65	000568	泸州老窖	4,788	242,177.04	0.34
66	002230	科大讯飞	6,008	239,719.20	0.34
67	601857	中国石油	31,025	238,582.25	0.34
68	002241	歌尔股份	12,342	237,953.76	0.34
69	600196	复星医药	7,576	234,780.24	0.33
70	601985	中国核电	29,800	232,738.00	0.33
71	600089	特变电工	22,275	230,100.75	0.33
72	601336	新华保险	4,384	225,337.60	0.32
73	002456	欧菲光	12,315	223,763.55	0.32
74	601607	上海医药	7,747	223,733.36	0.32
75	600795	国电电力	62,122	223,639.20	0.32
76	000166	申万宏源	38,433	215,224.80	0.30
77	002594	比亚迪	4,303	214,934.85	0.30
78	000625	长安汽车	14,730	212,406.60	0.30
79	000069	华侨城 A	21,057	211,833.42	0.30

80	601669	中国电建	26,480	209,721.60	0.30
81	601899	紫金矿业	60,966	209,113.38	0.30
82	000338	潍柴动力	15,732	207,662.40	0.29
83	000100	TCL 集团	60,499	207,511.57	0.29
84	300059	东方财富	16,997	204,303.94	0.29
85	600741	华域汽车	8,372	202,937.28	0.29
86	600340	华夏幸福	6,038	202,756.04	0.29
87	300104	乐视网	6,603	202,580.04	0.29
88	000783	长江证券	21,284	201,559.48	0.29
89	002466	天齐锂业	3,700	201,095.00	0.28
90	002008	大族激光	5,798	200,842.72	0.28
91	600068	葛洲坝	17,860	200,746.40	0.28
92	300072	三聚环保	5,400	200,070.00	0.28
93	600029	南方航空	22,989	200,004.30	0.28
94	600031	三一重工	24,543	199,534.59	0.28
95	002736	国信证券	15,001	198,763.25	0.28
96	600066	宇通客车	8,921	195,994.37	0.28
97	600010	包钢股份	88,337	193,458.03	0.27
98	600535	天士力	4,453	184,977.62	0.26
99	601933	永辉超市	26,034	184,320.72	0.26
100	300070	碧水源	9,835	183,422.75	0.26
101	000963	华东医药	3,562	177,031.40	0.25
102	601099	太平洋	44,030	177,000.60	0.25
103	600606	绿地控股	22,400	175,168.00	0.25
104	600153	建发股份	13,441	173,792.13	0.25
105	600406	国电南瑞	9,821	173,340.65	0.25
106	600886	国投电力	21,664	171,145.60	0.24
107	600383	金地集团	14,686	168,448.42	0.24
108	000839	中信国安	16,800	167,832.00	0.24
109	600085	同仁堂	4,756	166,269.76	0.24

110	600111	北方稀土	14,674	166,256.42	0.24
111	601888	中国国旅	5,498	165,709.72	0.23
112	600100	同方股份	11,561	163,241.32	0.23
113	601111	中国国航	16,506	160,933.50	0.23
114	601600	中国铝业	35,546	160,667.92	0.23
115	600570	恒生电子	3,402	158,805.36	0.22
116	600816	安信信托	11,662	158,486.58	0.22
117	300124	汇川技术	6,200	158,348.00	0.22
118	000895	双汇发展	6,648	157,890.00	0.22
119	601618	中国中冶	31,398	157,303.98	0.22
120	002202	金风科技	10,163	157,221.61	0.22
121	601555	东吴证券	13,986	157,062.78	0.22
122	601800	中国交建	9,853	156,564.17	0.22
123	600705	中航资本	27,660	156,279.00	0.22
124	600271	航天信息	7,482	154,428.48	0.22
125	600522	中天科技	12,800	154,240.00	0.22
126	600115	东方航空	22,341	151,918.80	0.21
127	601727	上海电气	19,900	150,643.00	0.21
128	600739	辽宁成大	8,178	147,449.34	0.21
129	002475	立讯精密	5,000	146,200.00	0.21
130	000728	国元证券	11,854	144,855.88	0.20
131	600177	雅戈尔	14,274	144,452.88	0.20
132	600893	中航动力	5,245	143,188.50	0.20
133	600109	国金证券	12,198	142,960.56	0.20
134	600547	山东黄金	4,934	142,740.62	0.20
135	300024	机器人	7,320	142,740.00	0.20
136	000623	吉林敖东	6,209	142,124.01	0.20
137	600352	浙江龙盛	14,702	140,110.06	0.20
138	600674	川投能源	14,196	139,404.72	0.20
139	601018	宁波港	24,660	139,329.00	0.20

140	000768	中航飞机	7,458	137,525.52	0.19
141	002673	西部证券	9,601	136,526.22	0.19
142	002252	上海莱士	6,724	136,093.76	0.19
143	600023	浙能电力	24,874	135,812.04	0.19
144	600804	鹏博士	7,642	135,645.50	0.19
145	002465	海格通信	12,606	135,388.44	0.19
146	600018	上港集团	20,730	131,428.20	0.19
147	000413	东旭光电	11,700	131,274.00	0.19
148	600415	小商品城	17,764	128,611.36	0.18
149	000157	中联重科	28,171	126,487.79	0.18
150	601998	中信银行	19,849	124,850.21	0.18
151	002044	美年健康	7,300	124,100.00	0.18
152	000503	海虹控股	4,931	122,929.83	0.17
153	000826	启迪桑德	3,495	122,744.40	0.17
154	600221	海南航空	37,859	121,905.98	0.17
155	002007	华兰生物	3,328	121,472.00	0.17
156	300017	网宿科技	10,005	120,760.35	0.17
157	600208	新潮中宝	26,802	120,609.00	0.17
158	601788	光大证券	8,000	119,440.00	0.17
159	603993	洛阳钼业	22,882	115,782.92	0.16
160	600118	中国卫星	4,147	115,452.48	0.16
161	600663	陆家嘴	4,874	115,221.36	0.16
162	002065	东华软件	5,277	114,985.83	0.16
163	000709	河钢股份	27,328	114,504.32	0.16
164	000402	金融街	9,768	114,480.96	0.16
165	000876	新希望	13,862	113,945.64	0.16
166	600489	中金黄金	11,260	112,937.80	0.16
167	600485	信威集团	7,602	110,913.18	0.16
168	600150	中国船舶	4,830	110,462.10	0.16
169	002310	东方园林	6,600	110,352.00	0.16

170	000793	华闻传媒	10,706	108,344.72	0.15
171	600061	国投安信	6,900	107,295.00	0.15
172	300027	华谊兄弟	13,194	106,739.46	0.15
173	601992	金隅股份	16,328	105,642.16	0.15
174	601919	中国远洋	19,700	105,395.00	0.15
175	600332	白云山	3,620	105,124.80	0.15
176	600157	永泰能源	29,439	105,097.23	0.15
177	601633	长城汽车	7,876	104,672.04	0.15
178	600820	隧道股份	10,300	104,030.00	0.15
179	000060	中金岭南	9,225	103,320.00	0.15
180	600170	上海建工	26,946	102,933.72	0.15
181	000425	徐工机械	27,370	102,637.50	0.15
182	600369	西南证券	18,280	102,550.80	0.15
183	002074	国轩高科	3,200	100,960.00	0.14
184	002385	大北农	15,979	100,507.91	0.14
185	601155	新城控股	5,400	100,116.00	0.14
186	600297	广汇汽车	13,200	99,396.00	0.14
187	601333	广深铁路	21,876	98,879.52	0.14
188	002081	金螳螂	8,981	98,611.38	0.14
189	000559	万向钱潮	9,097	96,610.14	0.14
190	000686	东北证券	9,437	94,841.85	0.13
191	600362	江西铜业	5,588	94,213.68	0.13
192	600688	上海石化	14,154	93,557.94	0.13
193	601225	陕西煤业	13,200	93,324.00	0.13
194	600649	城投控股	8,672	91,142.72	0.13
195	000917	电广传媒	8,027	90,705.10	0.13
196	601117	中国化学	12,955	90,555.45	0.13
197	600718	东软集团	5,810	90,345.50	0.13
198	000009	中国宝安	11,070	89,556.30	0.13
199	600373	中文传媒	3,801	89,361.51	0.13

200	600583	海油工程	14,202	88,620.48	0.13
201	601718	际华集团	10,000	87,900.00	0.12
202	000415	渤海金控	12,900	86,817.00	0.12
203	600895	张江高科	5,100	86,088.00	0.12
204	002146	荣盛发展	8,708	85,947.96	0.12
205	000540	中天金融	12,100	84,095.00	0.12
206	300315	掌趣科技	10,300	84,048.00	0.12
207	600827	百联股份	5,101	82,891.25	0.12
208	600256	广汇能源	19,971	82,679.94	0.12
209	002129	中环股份	9,985	82,575.95	0.12
210	600038	中直股份	1,800	82,386.00	0.12
211	600008	首创股份	12,500	82,250.00	0.12
212	300144	宋城演艺	3,900	81,393.00	0.12
213	600498	烽火通信	3,200	81,120.00	0.11
214	600060	海信电器	5,345	81,083.65	0.11
215	300033	同花顺	1,300	80,873.00	0.11
216	601216	君正集团	16,368	80,039.52	0.11
217	600376	首开股份	6,900	78,936.00	0.11
218	000983	西山煤电	9,000	78,930.00	0.11
219	000792	盐湖股份	7,533	78,719.85	0.11
220	000750	国海证券	14,033	77,181.50	0.11
221	600704	物产中大	10,500	76,545.00	0.11
222	000008	神州高铁	10,300	74,984.00	0.11
223	601866	中海集运	20,405	73,458.00	0.10
224	002500	山西证券	7,651	73,296.58	0.10
225	600074	保千里	5,700	73,017.00	0.10
226	601872	招商轮船	14,000	72,240.00	0.10
227	600021	上海电力	5,901	71,343.09	0.10
228	600919	江苏银行	7,500	69,675.00	0.10
229	000630	铜陵有色	24,465	69,480.60	0.10

230	002183	怡亚通	8,000	69,040.00	0.10
231	600588	用友网络	4,015	68,736.80	0.10
232	600909	华安证券	6,700	67,603.00	0.10
233	000977	浪潮信息	3,900	67,548.00	0.10
234	300168	万达信息	4,600	66,930.00	0.09
235	000959	首钢股份	9,500	66,405.00	0.09
236	600037	歌华有线	4,500	65,520.00	0.09
237	000738	航发控制	3,301	64,600.57	0.09
238	600372	中航电子	3,681	63,938.97	0.09
239	000627	天茂集团	7,900	63,832.00	0.09
240	002174	游族网络	2,000	63,520.00	0.09
241	002152	广电运通	7,500	62,325.00	0.09
242	002470	金正大	8,200	61,746.00	0.09
243	601021	春秋航空	1,800	60,534.00	0.09
244	600446	金证股份	3,401	59,789.58	0.08
245	600737	中粮屯河	6,300	59,472.00	0.08
246	002292	奥飞娱乐	3,493	59,031.70	0.08
247	601198	东兴证券	3,403	58,667.72	0.08
248	600549	厦门钨业	2,700	58,023.00	0.08
249	002131	利欧股份	17,500	57,575.00	0.08
250	000671	阳光城	9,800	57,036.00	0.08
251	600959	江苏有线	5,251	55,503.07	0.08
252	000718	苏宁环球	9,400	55,084.00	0.08
253	002399	海普瑞	2,709	54,803.07	0.08
254	002714	牧原股份	2,000	54,440.00	0.08
255	300133	华策影视	4,840	54,208.00	0.08
256	600482	中国动力	2,100	53,109.00	0.08
257	002424	贵州百灵	2,801	52,826.86	0.07
258	601877	XD正泰电	2,600	52,234.00	0.07
259	000061	农产品	5,668	51,352.08	0.07

260	002153	石基信息	2,201	50,028.73	0.07
261	000938	紫光股份	800	48,896.00	0.07
262	601608	中信重工	8,600	47,644.00	0.07
263	600666	奥瑞德	2,720	47,328.00	0.07
264	300251	光线传媒	5,701	46,691.19	0.07
265	600685	中船防务	1,700	46,546.00	0.07
266	002195	二三四五	6,460	46,189.00	0.07
267	601958	金钼股份	6,407	45,938.19	0.06
268	002739	万达电影	900	45,873.00	0.06
269	601118	海南橡胶	8,030	45,610.40	0.06
270	000961	中南建设	6,800	44,336.00	0.06
271	002299	圣农发展	2,700	40,149.00	0.06
272	601611	中国核建	3,200	38,304.00	0.05
273	600871	石化油服	10,800	36,072.00	0.05
274	300085	银之杰	1,900	35,150.00	0.05
275	600188	兖州煤业	2,772	33,929.28	0.05
276	000555	神州信息	1,700	28,390.00	0.04
277	002027	分众传媒	2,000	27,520.00	0.04
278	002797	第一创业	2,300	21,183.00	0.03
279	601127	小康股份	1,000	19,950.00	0.03
280	000156	华数传媒	995	14,835.45	0.02

7.3.2 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所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600110	诺德股份	30,000	422,700.00	0.60
2	002050	三花智控	23,000	375,360.00	0.53
3	000858	五粮液	4,800	267,168.00	0.38
4	600703	三安光电	12,300	242,310.00	0.34
5	603579	荣泰健康	1,800	233,676.00	0.33

6	600089	特变电工	2,605	26,909.65	0.04
7	600660	福耀玻璃	3	78.12	-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600887	伊利股份	598,915.00	0.90
2	002206	海 利 得	568,618.00	0.85
3	600835	上海机电	526,918.00	0.79
4	603008	喜临门	467,244.00	0.70
5	000418	小天鹅 A	452,766.00	0.68
6	600110	诺德股份	398,190.00	0.60
7	300342	天银机电	396,425.00	0.59
8	000858	五 粮 液	385,038.00	0.58
9	601211	国泰君安	352,858.00	0.53
10	002050	三花智控	316,674.00	0.47
11	603579	荣泰健康	258,738.00	0.39
12	600703	三安光电	247,845.00	0.37
13	002696	百洋股份	231,238.00	0.35
14	002466	天齐锂业	200,835.00	0.30
15	300072	三聚环保	198,936.00	0.30
16	002441	众业达	169,427.00	0.25
17	600958	东方证券	162,045.00	0.24
18	600606	绿地控股	157,584.00	0.24
19	600522	中天科技	153,539.00	0.23
20	002044	美年健康	121,837.00	0.18

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。

7.4.2 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	600773	西藏城投	597,399.00	0.89
2	600887	伊利股份	589,974.00	0.88
3	002206	海 利 得	568,033.00	0.85
4	600491	龙元建设	508,887.00	0.76
5	600835	上海机电	505,529.00	0.76
6	000418	小天鹅 A	446,342.06	0.67
7	600660	福耀玻璃	431,906.44	0.65
8	300342	天银机电	392,313.33	0.59
9	002540	亚太科技	388,030.86	0.58
10	000703	恒逸石化	376,192.80	0.56
11	603008	喜临门	367,261.00	0.55
12	000055	方大集团	316,917.41	0.47
13	300353	东土科技	203,076.00	0.30
14	000858	五 粮 液	201,792.00	0.30
15	002696	百洋股份	198,968.00	0.30
16	600011	华能国际	198,320.40	0.30
17	002654	万润科技	180,960.00	0.27
18	002441	众业达	165,120.00	0.25
19	002055	得润电子	161,666.00	0.24
20	601021	春秋航空	159,297.00	0.24

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。

7.4.3 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	8,800,342.91
卖出股票收入（成交）总额	10,801,808.30

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,556.45
2	应收证券清算款	214,167.51
3	应收股利	—
4	应收利息	2,016.35
5	应收申购款	26,954.81
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	246,695.12

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 (LOF) A	3,421	15,617.07	2,617,140.30	4.90%	50,808,872.34	95.10%
中欧沪 深300 指数增 强 (LOF) E	98	8,679.47	122,023.00	14.35%	728,564.85	85.65%
合计	3,519	15,423.87	2,739,163.30	5.05%	51,537,437.19	94.95%

8.2 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	70000	7.77%
2	郑凯鹏	54874	6.09%
3	徐立新	49400	5.49%
4	汪秀娣	48705	5.41%
5	任晓光	46100	5.12%
6	王尽恩	38100	4.23%
7	张晓鹏	37400	4.15%
8	乔爱科	36300	4.03%
9	林海洪	30004	3.33%

9	张达	30004	3.33%
10	刘国珍	30001	3.33%

注：以上均为中欧沪深300指数增强A的场内持有人。

8.3 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	—	—
	中欧沪深300指数增强（LOF）E	8.39	0.00%
	合计	8.39	0.00%

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金E类份额的比例为0.0010%,持有本基金份额的合计比例为0.000015%,上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本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

§ 9 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	56,252,161.71	635,996.51
本报告期基金总申购份额	3,187,473.94	641,765.09
减：本报告期基金总赎回份额	6,013,623.01	427,173.75
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	53,426,012.64	850,587.85

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2017年3月30日发布公告，顾伟先生自2017年3月30日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。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上海证监局报告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	6,138,907.73	32.03%		—		—		—	5,717.22	32.03%	
西部证券	1	6,125,688.45	31.96%		—		—		—	5,705.18	31.96%	
中信建投	1	3,781,747.91	19.73%		—		—		—	3,522.15	19.73%	
长江证券	1	3,119,489.15	16.28%		—		—		—	2,905.19	16.28%	
东方证券	1		—		—		—		—	—	—	
光大证券	1		—		—		—		—	—	—	
广发证券	1		—		—		—		—	—	—	
国都证券	2		—		—		—		—	—	—	
国海证券	1		—		—		—		—	—	—	
国金证券	1		—		—		—		—	—	—	
海通证券	1		—		—		—		—	—	—	
华泰证券	1		—		—		—		—	—	—	

瑞银证券	1		—		—		—		—	—	—	
申银万国	1		—		—		—		—	—	—	
招商证券	1		—		—		—		—	—	—	
中金公司	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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2016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	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“国电南瑞”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-14
3	中欧基金管理有限公司关于新增京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-17
4	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2016年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-20
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（2017年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-06
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	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-06

	要（2017年第1号）		
7	中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-11
8	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宝钢股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-15
9	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过同花顺代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-16
10	中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-22
11	中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-02
12	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国信证券代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-28
13	中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
15	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2016半年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
16	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2016半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
17	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通转换和定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-14
18	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2017年1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-21

19	中欧基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-24
20	中欧基金管理有限公司关于新增方正证券为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-12
21	中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换与定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-16

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

11.3 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、基金托管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
二〇一七年八月二十九日