

---

# 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

## 2018 年半年度报告

2018 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:2018 年 08 月 28 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2018年8月27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2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§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	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	61

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
8.4 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 .....	61
§9 开放式基金份额变动 .....	62
§10 重大事件揭示 .....	62
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§12 备查文件目录 .....	68
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 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	
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	112,444,931.24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	111,463,773.80份	981,157.44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
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
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	中证报、证券时报、上证报
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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

### 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018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
本期已实现收益	862,222.88	8,221.82
本期利润	-17,075,132.32	-162,050.45
加权平均基金份额本期利润	-0.1548	-0.1958
本期加权平均净值利润率	-11.03%	-13.91%
本期基金份额净值增长率	-10.24%	-10.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	30,890,297.99	246,293.87
期末可供分配基金份额利润	0.2771	0.2510
期末基金资产净值	142,354,071.79	1,259,823.08
期末基金份额净值	1.2771	1.2840
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	32.93%	11.42%

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

中欧沪深300指数增强（LOF）A

阶段	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	-6.03%	1.20%	-7.29%	1.22%	1.26%	-0.02%
过去三个月	-7.76%	1.09%	-9.45%	1.08%	1.69%	0.01%
过去六个月	-10.24%	1.09%	-12.25%	1.10%	2.01%	-0.01%
过去一年	-1.94%	0.90%	-3.97%	0.90%	2.03%	0.00%
过去三年	-17.10%	1.44%	-20.19%	1.41%	3.09%	0.03%
自基金合同生效日至今	32.93%	1.37%	27.22%	1.39%	5.71%	-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。

中欧沪深300指数增强（LOF）E

阶段	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	-6.02%	1.20%	-7.29%	1.22%	1.27%	-0.02%



个月						
过去三 个月	-7.74%	1.09%	-9.45%	1.08%	1.71%	0.01%
过去六 个月	-10.15%	1.09%	-12.25%	1.10%	2.10%	-0.01%
过去一 年	-1.58%	0.90%	-3.97%	0.90%	2.39%	0.00%
自基金 份额运 作日至 今	11.42%	1.13%	5.13%	1.10%	6.29%	0.03%

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-2018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



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 2018 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以及自然人股东，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、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司。截至2018年6月30日，本基金管理人共管理73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	策略组负责人、基金经理	2015-05-18	-	11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。2015-04-01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

回顾2018上半年，A股市场经历了年初蓝筹带动的短暂行情后，进入了持续调整。海外贸易摩擦产生的不确定性，叠加去杠杆大环境下国内经济动能的疑虑，使得资本市场对于后市保有谨慎情绪；而近期推出的以扶贫乡村振兴为抓手的基建托底，配合去杠杆和扩大对外开放等长期改革的组合政策，指明后期投资方向。在下半年宽货币宽信用的预期下，我们认为权益市场应较上半年乐观。

#### 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-10.24%，同期业绩比较基准收益率为-12.25%；E类份额净值增长率为-10.15%，同期业绩比较基准收益率为-12.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前，我们维持年初的判断，即2016年底为始的蓝筹行情已经告一段落，即便经过上半年的调整，估值仍不便宜，部分蓝筹的估值依然高于历史中枢，再叠加零售消费增速的回落，我们认为下半年机会较弱；同时，在地产维持严调控的环境下，房地产后周期产品增速也难为继。另一方面，以智能制造，计算机，5G通信和优质医药股为代表的成长股，经过一年多的调整，在盈利维持较高增速的情况下进入了估值合理的区间；同时在下半宽货币宽信用的预期下，托底基建的上下游也可能产生投资机会。在报告期内，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，通过量化选股模型在轻工制造、医药和计算机等板块进行主动配置。

#### 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验。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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 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：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2018年06月30日	2017年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,664,703.95	7,416,787.37
结算备付金		30,723.04	173,072.88
存出保证金		13,275.83	52,807.90
交易性金融资产	6.4.7.2	130,934,980.39	134,471,236.23
其中: 股票投资		130,934,980.39	134,471,236.23
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,057.26	3,768.50
应收股利		-	-
应收申购款		545,399.73	14,329.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		144,194,140.20	142,132,002.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>	<b>上年度末 2017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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		51,539.80	4,669.39
应付管理人报酬		122,638.79	121,098.56
应付托管费		18,395.81	18,164.78

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,050.77	122,869.82
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	353,620.16	324,925.23
负债合计		580,245.33	591,727.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	112,444,931.24	99,477,050.17
未分配利润	6.4.7.1 0	31,168,963.63	42,063,224.81
所有者权益合计		143,613,894.87	141,540,274.98
负债和所有者权益总计		144,194,140.20	142,132,002.76

注：报告截止日2018年6月30日，A类基金份额净值1.2771元，基金份额111,463,773.80份；E类基金份额净值1.2840元，基金份额981,157.44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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
<b>一、收入</b>		-15,998,023.33	7,706,793.53
1. 利息收入		99,761.71	38,035.09
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	99,761.71	38,035.09
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（损失以“-”填列）		2,004,233.56	560.75
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	608,622.27	-523,094.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-	-
股利收益	6.4.7.1 6	1,395,611.29	523,655.70
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-18,107,627.47	7,664,724.74
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.1 8	5,608.87	3,472.95
<b>减：二、费用</b>		1,239,159.44	675,885.43
1. 管理人报酬		772,640.98	335,885.16
2. 托管费		115,896.15	50,382.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 9	92,137.80	30,194.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-



6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.2 0	258,484.51	259,422.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,237,182.77	7,030,908.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,237,182.77	7,030,908.10

### 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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	99,477,050.17	42,063,224.81	141,540,274.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,237,182.77	-17,237,182.77
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）	12,967,881.07	6,342,921.59	19,310,802.66
其中：1. 基金申购款	19,622,513.71	9,174,913.80	28,797,427.51
2. 基金赎回款	-6,654,632.64	-2,831,992.21	-9,486,624.85
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)	112,444,931.24	31,168,963.63	143,613,894.87
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至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(基金净值)	54,276,600.49	16,408,222.11	70,684,822.60

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人民币1,201,873,408.58元，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。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会

及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券

的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	12,664,703.95
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-

其他存款	-
合计	12,664,703.95

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	136,025,225.40	130,934,980.39	-5,090,245.01
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	136,025,225.40	130,934,980.39	-5,090,245.01

#### 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 2018年06月30日
应收活期存款利息	5,039.35
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	12.51
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.40
合计	5,057.26

#### 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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	34,050.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,050.77

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27.96
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	244,136.54
预提费用-上市费	29,752.78
其他应付	4,907.69
指数使用费	50,000.00



合计	353,620.16
----	------------

#### 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2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	98,959,107.16	98,959,107.16
本期申购	18,485,135.70	18,485,135.70
本期赎回(以“-”号填列)	-5,980,469.06	-5,980,469.06
本期末	111,463,773.80	111,463,773.80

金额单位：人民币元

项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) E)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	517,943.01	517,943.01
本期申购	1,137,378.01	1,137,378.01
本期赎回(以“-”号填列)	-674,163.58	-674,163.58
本期末	981,157.44	981,157.44

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2018年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为619,945.00份，均为中欧沪深300A类基金份额(2017年6月30日：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)，托管在场外未上市交易的基金份额为111,824,986.24份，其中中欧沪深300A类基金份额110,843,828.80份，中欧沪深300E类基金份额981,157.44份(2017年6月30日：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)。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本基金A类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	53,717,956.58	-11,876,911.22	41,841,045.36
本期利润	862,222.88	-17,937,355.20	-17,075,132.32
本期基金份额交易产生的变动数	6,786,691.23	-662,306.28	6,124,384.95
其中：基金申购款	10,017,362.54	-1,338,638.14	8,678,724.40
基金赎回款	-3,230,671.31	676,331.86	-2,554,339.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,366,870.69	-30,476,572.70	30,890,297.99

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	125,227.48	96,951.97	222,179.45
本期利润	8,221.82	-170,272.27	-162,050.45
本期基金份额交易产生的变动数	112,844.57	105,692.07	218,536.64
其中：基金申购款	274,407.75	221,781.65	496,189.40
基金赎回款	-161,563.18	-116,089.58	-277,652.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	246,293.87	32,371.77	278,665.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	98,427.38

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	618.12
其他	716.21
合计	99,761.71

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	26,011,857.66
减：卖出股票成本总额	25,403,235.39
买卖股票差价收入	608,622.27

#### 6.4.7.13 债券投资收益

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
	2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,395,611.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,395,611.29

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-18,107,627.47
——股票投资	-18,107,627.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-18,107,627.47

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	4,658.19
转换费收入	950.68
合计	5,608.87

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	92,137.80
银行间市场交易费用	-
合计	92,137.80

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	14,795.19
信息披露费	104,136.54
汇划手续费	800.00
帐户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	258,484.51

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
兴业银行股份有限公司	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

)	
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

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 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	772,640.98	335,885.16
其中：支付销售机构的客户维护费	98,566.28	90,590.73

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 X 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 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	115,896.15	50,382.81

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。

### 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自有资金投资本基金的情况

中欧沪深300指数增强（LOF）A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日
基金合同生效日（2010年06月24日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
---------------------	---	---

中欧沪深300指数增强 (LOF) E

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日
基金合同生效日（2010年06月24日）持有的基金份额	-	-
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
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.44%	14.35%

注：

- 1、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。
- 2、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

截止本报告期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

#### 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 2018年01月01日至2018年06月30	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日



	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 股份有限 公司	12,664,703.95	98,427.38	4,795,489.83	37,907.02

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——非货币市场基金

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（2018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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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	备注
601390	中国中铁	2018-05-07	重大资产重组	7.47	2018-08-20	7.25	82,974	684,435.75	619,815.78	-
002450	康得新	2018-06-04	筹划重大事项	17.08	-	-	29,971	522,708.23	511,904.68	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大资产重组	15.03	2018-08-27	13.47	37,600	725,215.90	565,128.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大资产重组	19.52	-	-	16,924	292,881.06	330,356.48	-
300072	三聚环保	2018-06-19	筹划重大事项	23.28	2018-07-10	18.38	9,900	342,372.38	230,472.00	-
601727	上海电气	2018-06-06	筹划重大事项	6.34	2018-08-07	5.71	35,100	307,306.33	222,534.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大资产重组	3.23	2018-07-20	2.91	50,259	159,811.21	162,336.57	-
002411	必康股份	2018-06-19	筹划重大事项	28.34	-	-	5,000	132,775.27	141,700.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	筹划重大事项	4.87	-	-	27,600	170,322.27	134,412.00	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大资产重组	6.62	-	-	17,630	131,631.44	116,710.60	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大资产重组	32.50	-	-	3,500	118,144.62	113,750.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	筹划重大事项	5.84	2018-07-17	5.20	18,900	145,320.07	110,376.00	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大资产重组	3.60	2018-07-03	3.26	30,500	180,145.00	109,800.00	-
0000	神州	2018	筹划	4.96	2018	4.46	20,600	164,838.84	102,176.00	-

08	高铁	-06-06	重大事项		-08-07					
600485	信威集团	2016-12-26	筹划重大事项	12.92	-	-	7,602	219,062.52	98,217.84	-
000723	美锦能源	2018-03-27	重大资产重组	5.43	2018-07-31	4.89	13,400	93,954.00	72,762.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	筹划重大事项	52.04	-	-	900	90,900.00	46,836.00	-

注：本基金截至2018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。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。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约责任，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的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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2018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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金流动性情况良好，持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种，均能及时以合理的价格及时变现以满足流动性的需求。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。综合来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018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	12,664,703.95	-	-	-	12,664,703.95
结算备付金	30,723.04	-	-	-	30,723.04
存出保证金	13,275.83	-	-	-	13,275.83
交易性金融资产	-	-	-	130,934,980.39	130,934,980.39
应收利息	-	-	-	5,057.26	5,057.26
应收申购款	-	-	-	545,399.73	545,399.73
资产总计	12,708,702.82	-	-	131,485,437.38	144,194,140.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,539.80	51,539.80
应付管理人报酬	-	-	-	122,638.79	122,638.79
应付托管费	-	-	-	18,395.81	18,395.81
应付交易费用	-	-	-	34,050.77	34,050.77
其他负债	-	-	-	353,620.16	353,620.16
负债总计	-	-	-	580,245.33	580,245.33
利率敏感度缺口	12,708,702.82	-	-	130,905,192.05	143,613,894.87
上年度末2017	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

年12月31日					
资产					
银行存款	7,416,787.37	-	-	-	7,416,787.37
结算备付金	173,072.88	-	-	-	173,072.88
存出保证金	52,807.90	-	-	-	52,807.90
交易性金融资产	-	-	-	134,471,236.23	134,471,236.23
应收利息	-	-	-	3,768.50	3,768.50
应收申购款	-	-	-	14,329.88	14,329.88
资产总计	7,642,668.15	-	-	134,489,334.61	142,132,002.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,669.39	4,669.39
应付管理人报酬	-	-	-	121,098.56	121,098.56
应付托管费	-	-	-	18,164.78	18,164.78
应付交易费用	-	-	-	122,869.82	122,869.82
其他负债	-	-	-	324,925.23	324,925.23
负债总计	-	-	-	591,727.78	591,727.78
利率敏感度缺口	7,642,668.15	-	-	133,897,606.83	141,540,274.98

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2018年06月30日本基金未持有交易性债券资产(2017年12月31日:0.00%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017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。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

金额单位:人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金



		资产净 值比例( %)		资产净 值比例( %)
交易性金融资产-股票投资	130,934,980.39	91.17	134,471,236.23	95.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	130,934,980.39	91.17	134,471,236.23	95.01

#### 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:人民币元)	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	8,497,593.96	7,220,310.94
	2. 业绩比较基准下降5%	-8,497,593.96	-7,220,310.94

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年06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127,157,662.29元，属于第二层次的余额为3,777,318.10元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：属于第一层次的余额为人民币132,031,915.71元，属于第二层次的余额为人民币2,236,872.54元，属于第三层次的余额为人民币202,447.98元)。

#### 6.4.14.1.2.2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、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不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或第三层次。

#### 6.4.14.1.2.3第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币0.00元，期初余额为人民币202,447.98元，本期减少人民币202,447.98元。

#### 6.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 6.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 6.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月28日经本基金的基金管理人批准。

## §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	130,934,980.39	90.80
	其中：股票	130,934,980.39	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,695,426.99	8.80
8	其他各项资产	563,732.82	0.39
9	合计	144,194,140.20	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	298,996.60	0.21
B	采矿业	3,410,794.00	2.37
C	制造业	45,720,534.38	31.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,028,065.38	2.11
E	建筑业	4,261,210.34	2.97
F	批发和零售业	2,445,488.15	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	3,355,598.20	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	4,303,916.17	3.00
J	金融业	36,478,766.12	25.40
K	房地产业	6,281,670.26	4.37
L	租赁和商务服务业	1,221,951.62	0.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	457,798.39	0.32

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	663,895.50	0.46
R	文化、体育和娱乐业	657,715.25	0.46
S	综合	97,750.00	0.07
	合计	112,684,150.36	78.46

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,039,194.32	8.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.05
E	建筑业	362,223.00	0.25
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	630,420.00	0.44
J	金融业	2,208,626.72	1.54
K	房地产业	1,967,570.00	1.37
L	租赁和商务服务业	890,010.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	81,226.14	0.06
0	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	18,250,830.03	12.71

### 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	120,746	7,073,300.68	4.93
2	600036	招商银行	170,544	4,509,183.36	3.14
3	600519	贵州茅台	5,553	4,061,797.38	2.83
4	000333	美的集团	49,953	2,608,545.66	1.82
5	000651	格力电器	53,076	2,502,533.40	1.74
6	600016	民生银行	274,435	1,921,045.00	1.34
7	600887	伊利股份	68,786	1,919,129.40	1.34
8	600276	恒瑞医药	24,668	1,868,847.68	1.30
9	601328	交通银行	310,593	1,782,803.82	1.24
10	000858	五粮液	22,107	1,680,132.00	1.17
11	002415	海康威视	44,226	1,642,111.38	1.14
12	601288	农业银行	435,382	1,497,714.08	1.04
13	600030	中信证券	87,916	1,456,768.12	1.01
14	600104	上汽集团	41,442	1,450,055.58	1.01
15	000002	万科A	56,865	1,398,879.00	0.97
16	601668	中国建筑	247,272	1,350,105.12	0.94

17	601398	工商银行	240,501	1,279,465.32	0.89
18	600900	长江电力	78,384	1,265,117.76	0.88
19	601009	南京银行	161,031	1,244,769.63	0.87
20	600000	浦发银行	126,696	1,211,213.76	0.84
21	600048	保利地产	87,911	1,072,514.20	0.75
22	000725	京东方 A	284,997	1,008,889.38	0.70
23	601169	北京银行	163,937	988,540.11	0.69
24	002304	洋河股份	7,410	975,156.00	0.68
25	000001	平安银行	105,001	954,459.09	0.66
26	601601	中国太保	29,438	937,600.30	0.65
27	000069	华侨城 A	122,957	888,979.11	0.62
28	600837	海通证券	90,410	856,182.70	0.60
29	601988	中国银行	236,615	854,180.15	0.59
30	600028	中国石化	121,792	790,430.08	0.55
31	600019	宝钢股份	99,934	778,485.86	0.54
32	600585	海螺水泥	22,485	752,797.80	0.52
33	600518	康美药业	32,878	752,248.64	0.52
34	002142	宁波银行	44,871	730,948.59	0.51
35	601888	中国国旅	11,098	714,822.18	0.50
36	002024	苏宁易购	47,075	662,816.00	0.46
37	601818	光大银行	178,104	651,860.64	0.45
38	600690	青岛海尔	33,418	643,630.68	0.45
39	000538	云南白药	5,976	639,192.96	0.45
40	601390	中国中铁	82,974	619,815.78	0.43
41	002230	科大讯飞	19,062	611,318.34	0.43
42	601766	中国中车	77,496	596,719.20	0.42
43	600009	上海机场	10,358	574,661.84	0.40
44	001979	招商蛇口	28,900	550,545.00	0.38
45	601688	华泰证券	36,374	544,518.78	0.38
46	601006	大秦铁路	65,853	540,653.13	0.38
47	600309	万华化学	11,872	539,226.24	0.38

48	600015	华夏银行	71,723	534,336.35	0.37
49	300059	东方财富	40,316	531,364.88	0.37
50	600703	三安光电	27,283	524,379.26	0.37
51	002008	大族激光	9,798	521,155.62	0.36
52	002450	康得新	29,971	511,904.68	0.36
53	000568	泸州老窖	8,289	504,468.54	0.35
54	601939	建设银行	75,112	491,983.60	0.34
55	601211	国泰君安	33,301	490,856.74	0.34
56	000338	潍柴动力	54,864	480,060.00	0.33
57	600050	中国联通	95,386	469,299.12	0.33
58	600196	复星医药	11,176	462,574.64	0.32
59	000776	广发证券	34,685	460,269.95	0.32
60	601186	中国铁建	51,754	446,119.48	0.31
61	601088	中国神华	22,098	440,634.12	0.31
62	600741	华域汽车	17,972	426,295.84	0.30
63	000963	华东医药	8,793	424,262.25	0.30
64	002466	天齐锂业	8,476	420,324.84	0.29
65	601628	中国人寿	18,584	418,511.68	0.29
66	601899	紫金矿业	115,866	418,276.26	0.29
67	601857	中国石油	54,225	418,074.75	0.29
68	600660	福耀玻璃	15,800	406,218.00	0.28
69	002236	大华股份	17,442	393,317.10	0.27
70	600031	三一重工	43,543	390,580.71	0.27
71	601336	新华保险	9,084	389,521.92	0.27
72	002044	美年健康	17,160	387,816.00	0.27
73	002456	欧菲科技	23,115	372,844.95	0.26
74	000063	中兴通讯	28,400	370,052.00	0.26
75	300124	汇川技术	11,200	367,584.00	0.26
76	601012	隆基股份	21,560	359,836.40	0.25
77	600436	片仔癀	3,200	358,176.00	0.25
78	600999	招商证券	25,670	351,165.60	0.24

79	600795	国电电力	131,922	345,635.64	0.24
80	600029	南方航空	40,689	343,822.05	0.24
81	002475	立讯精密	14,750	332,465.00	0.23
82	600340	华夏幸福	12,838	330,578.50	0.23
83	002252	上海莱士	16,924	330,356.48	0.23
84	600886	国投电力	45,264	329,069.28	0.23
85	002460	赣锋锂业	8,400	324,072.00	0.23
86	600958	东方证券	35,301	322,298.13	0.22
87	300070	碧水源	23,035	320,877.55	0.22
88	000895	双汇发展	12,148	320,828.68	0.22
89	601933	永辉超市	41,534	317,319.76	0.22
90	600271	航天信息	12,482	315,420.14	0.22
91	000423	东阿阿胶	5,858	315,218.98	0.22
92	601155	新城控股	10,100	312,797.00	0.22
93	002594	比亚迪	6,403	305,295.04	0.21
94	600352	浙江龙盛	25,403	303,565.85	0.21
95	000166	申万宏源	69,433	303,422.21	0.21
96	601607	上海医药	12,647	302,263.30	0.21
97	603799	华友钴业	3,100	302,157.00	0.21
98	600570	恒生电子	5,702	301,920.90	0.21
99	002202	金风科技	23,692	299,466.88	0.21
100	600089	特变电工	43,075	298,509.75	0.21
101	601985	中国核电	52,500	296,625.00	0.21
102	601901	方正证券	42,782	286,211.58	0.20
103	601225	陕西煤业	34,200	281,124.00	0.20
104	600111	北方稀土	24,574	279,652.12	0.19
105	601669	中国电建	52,080	279,148.80	0.19
106	601377	兴业证券	52,770	278,097.90	0.19
107	600066	宇通客车	14,421	276,738.99	0.19
108	300015	爱尔眼科	8,550	276,079.50	0.19
109	000100	TCL 集团	93,299	270,567.10	0.19



110	600606	绿地控股	40,700	266,178.00	0.19
111	601989	中国重工	65,734	265,565.36	0.18
112	600588	用友网络	10,680	261,766.80	0.18
113	600383	金地集团	25,686	261,740.34	0.18
114	600406	国电南瑞	16,221	256,291.80	0.18
115	600535	天士力	9,874	254,946.68	0.18
116	002736	国信证券	27,901	253,899.10	0.18
117	600010	包钢股份	157,537	244,182.35	0.17
118	300024	机器人	13,920	242,208.00	0.17
119	300003	乐普医疗	6,600	242,088.00	0.17
120	601788	光大证券	21,600	237,168.00	0.17
121	002241	歌尔股份	23,242	236,835.98	0.16
122	600332	白云山	6,220	236,671.00	0.16
123	002027	分众传媒	24,720	236,570.40	0.16
124	000768	中航飞机	15,058	235,507.12	0.16
125	000425	徐工机械	55,070	233,496.80	0.16
126	600705	中航资本	49,959	233,308.53	0.16
127	300122	智飞生物	5,100	233,274.00	0.16
128	300072	三聚环保	9,900	230,472.00	0.16
129	600068	葛洲坝	31,260	225,384.60	0.16
130	601727	上海电气	35,100	222,534.00	0.15
131	600115	东方航空	33,041	218,731.42	0.15
132	600637	东方明珠	14,479	218,053.74	0.15
133	600893	航发动力	9,745	217,508.40	0.15
134	600522	中天科技	24,600	216,726.00	0.15
135	600018	上港集团	36,030	214,738.80	0.15
136	600674	川投能源	24,396	212,733.12	0.15
137	601111	中国国航	23,906	212,524.34	0.15
138	601998	中信银行	34,149	212,065.29	0.15
139	600023	浙能电力	45,274	210,976.84	0.15
140	600085	同仁堂	5,956	210,127.68	0.15

141	601919	中远海控	42,300	208,116.00	0.14
142	000157	中联重科	50,271	206,613.81	0.14
143	601600	中国铝业	53,745	206,380.80	0.14
144	000783	长江证券	37,984	206,253.12	0.14
145	600739	辽宁成大	13,578	206,114.04	0.14
146	002294	信立泰	5,500	204,435.00	0.14
147	002310	东方园林	13,500	202,905.00	0.14
148	600547	山东黄金	8,434	201,741.28	0.14
149	601618	中国中冶	60,198	200,459.34	0.14
150	300017	网宿科技	18,405	197,117.55	0.14
151	002007	华兰生物	6,128	197,076.48	0.14
152	601800	中国交建	17,053	194,233.67	0.14
153	002081	金螳螂	19,181	193,728.10	0.13
154	002572	索菲亚	6,000	193,080.00	0.13
155	000625	长安汽车	21,430	192,870.00	0.13
156	000623	吉林敖东	10,609	190,749.82	0.13
157	300144	宋城演艺	8,100	190,350.00	0.13
158	603993	洛阳钼业	29,882	187,957.78	0.13
159	601018	宁波港	44,360	186,755.60	0.13
160	002065	东华软件	21,654	186,224.40	0.13
161	600177	雅戈尔	24,073	185,362.10	0.13
162	600208	新湖中宝	48,302	184,513.64	0.13
163	601555	东吴证券	26,786	182,948.38	0.13
164	002714	牧原股份	4,100	182,286.00	0.13
165	601099	太平洋	76,427	178,839.18	0.12
166	000503	国新健康	5,531	175,775.18	0.12
167	600816	安信信托	23,954	173,426.96	0.12
168	002146	荣盛发展	19,708	172,050.84	0.12
169	600100	同方股份	19,461	170,867.58	0.12
170	000792	盐湖股份	15,733	170,231.06	0.12
171	601333	广深铁路	39,776	169,048.00	0.12

172	600219	南山铝业	61,400	166,394.00	0.12
173	600109	国金证券	23,398	166,359.78	0.12
174	000413	东旭光电	27,300	165,438.00	0.12
175	000876	新希望	25,762	163,331.08	0.11
176	600221	海航控股	50,259	162,336.57	0.11
177	002508	老板电器	5,300	162,286.00	0.11
178	601198	东兴证券	12,303	160,431.12	0.11
179	002465	海格通信	19,906	159,845.18	0.11
180	000630	铜陵有色	71,865	158,821.65	0.11
181	000728	国元证券	21,154	156,539.60	0.11
182	000709	河钢股份	52,728	155,547.60	0.11
183	000839	中信国安	32,200	152,306.00	0.11
184	600170	上海建工	49,946	151,835.84	0.11
185	002673	西部证券	20,001	151,007.55	0.11
186	600498	烽火通信	6,000	149,100.00	0.10
187	601229	上海银行	9,400	148,144.00	0.10
188	600804	鹏博士	12,242	146,904.00	0.10
189	601117	中国化学	21,757	146,424.61	0.10
190	000983	西山煤电	19,400	145,694.00	0.10
191	600153	建发股份	15,940	143,300.60	0.10
192	002411	必康股份	5,000	141,700.00	0.10
193	600297	广汇汽车	24,000	140,640.00	0.10
194	600688	上海石化	24,554	139,712.26	0.10
195	000060	中金岭南	28,537	138,689.82	0.10
196	000826	启迪桑德	7,833	136,920.84	0.10
197	600362	江西铜业	8,588	136,119.80	0.09
198	300136	信维通信	4,400	135,212.00	0.09
199	000540	中天金融	27,600	134,412.00	0.09
200	600583	海油工程	25,302	133,088.52	0.09
201	002500	山西证券	19,651	132,447.74	0.09
202	600415	小商品城	30,064	129,575.84	0.09

203	600489	中金黄金	18,861	128,632.02	0.09
204	300027	华谊兄弟	20,694	127,475.04	0.09
205	002624	完美世界	4,100	127,141.00	0.09
206	600820	隧道股份	21,300	125,883.00	0.09
207	600663	陆家嘴	7,874	124,330.46	0.09
208	601633	长城汽车	12,576	123,496.32	0.09
209	601992	金隅集团	37,328	122,435.84	0.09
210	600369	西南证券	31,580	121,583.00	0.08
211	000750	国海证券	33,933	121,140.81	0.08
212	000402	金融街	14,868	119,687.40	0.08
213	600118	中国卫星	6,247	119,317.70	0.08
214	601118	海南橡胶	17,630	116,710.60	0.08
215	600061	国投资本	12,300	114,144.00	0.08
216	002602	世纪华通	3,500	113,750.00	0.08
217	002074	国轩高科	8,050	113,183.00	0.08
218	000671	阳光城	18,900	112,833.00	0.08
219	601216	君正集团	33,468	112,787.16	0.08
220	002352	顺丰控股	2,500	112,500.00	0.08
221	300251	光线传媒	11,002	112,000.36	0.08
222	000415	渤海金控	18,900	110,376.00	0.08
223	000898	鞍钢股份	19,800	110,286.00	0.08
224	002426	胜利精密	30,500	109,800.00	0.08
225	002470	金正大	15,700	108,016.00	0.08
226	000559	万向钱潮	15,697	106,739.60	0.07
227	002385	大北农	25,279	104,402.27	0.07
228	000686	东北证券	16,137	103,438.17	0.07
229	600977	中国电影	6,400	102,656.00	0.07
230	000008	神州高铁	20,600	102,176.00	0.07
231	002153	石基信息	3,501	101,529.00	0.07
232	600704	物产中大	19,400	101,462.00	0.07
233	000627	天茂集团	14,400	101,088.00	0.07

234	600549	厦门钨业	6,630	100,643.40	0.07
235	600485	信威集团	7,602	98,217.84	0.07
236	600895	张江高科	8,500	97,750.00	0.07
237	300033	同花顺	2,500	97,175.00	0.07
238	601877	正泰电器	4,300	95,976.00	0.07
239	600038	中直股份	2,400	95,976.00	0.07
240	002601	龙麟佰利	7,400	95,682.00	0.07
241	600011	华能国际	14,900	94,764.00	0.07
242	601997	贵阳银行	7,600	93,936.00	0.07
243	300315	掌趣科技	22,300	93,214.00	0.06
244	600919	江苏银行	14,100	90,381.00	0.06
245	600157	永泰能源	50,639	90,137.42	0.06
246	600827	百联股份	8,801	89,770.20	0.06
247	601866	中远海发	35,405	88,158.45	0.06
248	000938	紫光股份	1,400	87,640.00	0.06
249	601021	春秋航空	2,500	87,575.00	0.06
250	600649	城投控股	14,072	86,120.64	0.06
251	601872	招商轮船	23,600	85,196.00	0.06
252	600008	首创股份	20,100	84,822.00	0.06
253	002174	游族网络	4,100	81,590.00	0.06
254	600376	首开股份	11,401	80,149.03	0.06
255	000961	中南建设	12,700	80,137.00	0.06
256	600959	江苏有线	15,551	79,310.10	0.06
257	600373	中文传媒	6,101	78,397.85	0.05
258	002129	中环股份	9,985	78,182.55	0.05
259	601991	大唐发电	25,300	76,659.00	0.05
260	600372	中航电子	5,682	74,206.92	0.05
261	000959	首钢股份	17,800	73,158.00	0.05
262	000723	美锦能源	13,400	72,762.00	0.05
263	600909	华安证券	12,100	69,212.00	0.05
264	601958	金钼股份	10,707	67,132.89	0.05

265	000738	航发控制	4,901	65,330.33	0.05
266	600482	中国动力	3,700	64,565.00	0.04
267	600021	上海电力	9,401	63,362.74	0.04
268	002558	巨人网络	2,600	61,828.00	0.04
269	002399	海普瑞	2,709	59,977.26	0.04
270	002555	三七互娱	4,900	59,535.00	0.04
271	601881	中国银河	7,300	59,349.00	0.04
272	601718	际华集团	14,500	58,290.00	0.04
273	600682	南京新百	3,500	57,540.00	0.04
274	600188	兖州煤业	4,272	55,706.88	0.04
275	002468	申通快递	3,200	54,880.00	0.04
276	002424	贵州百灵	4,601	52,267.36	0.04
277	601898	中煤能源	10,800	52,164.00	0.04
278	002292	奥飞娱乐	5,793	51,731.49	0.04
279	603833	欧派家居	400	51,012.00	0.04
280	600233	圆通速递	3,700	48,840.00	0.03
281	002608	江苏国信	7,000	48,300.00	0.03
282	600926	杭州银行	4,300	47,687.00	0.03
283	601228	广州港	8,100	47,061.00	0.03
284	300104	乐视网	13,206	47,013.36	0.03
285	002739	万达电影	900	46,836.00	0.03
286	601611	中国核建	5,700	45,030.00	0.03
287	601608	中信重工	16,600	43,160.00	0.03
288	601375	中原证券	8,900	41,563.00	0.03
289	601966	玲珑轮胎	2,500	39,425.00	0.03
290	601212	白银有色	8,400	34,356.00	0.02
291	002841	视源股份	640	34,182.40	0.02
292	601163	三角轮胎	2,500	33,400.00	0.02
293	601878	浙商证券	3,900	32,760.00	0.02
294	000061	农产品	5,668	30,607.20	0.02
295	603858	步长制药	700	29,953.00	0.02

296	600685	中船防务	2,200	29,348.00	0.02
297	002797	第一创业	4,300	29,111.00	0.02
298	600390	五矿资本	3,500	27,125.00	0.02
299	603160	汇顶科技	400	25,956.00	0.02
300	300085	银之杰	1,900	24,662.00	0.02
301	000555	神州信息	1,700	22,576.00	0.02
302	002831	裕同科技	400	20,000.00	0.01
303	002839	张家港行	2,000	12,180.00	0.01
304	600666	奥瑞德	2,720	10,716.80	0.01
305	601238	广汽集团	700	7,798.00	0.01

### 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 （元）	占基金资产净 值比例（%）
1	002027	分众传媒	93,000	890,010.00	0.62
2	600340	华夏幸福	33,500	862,625.00	0.60
3	601328	交通银行	144,000	826,560.00	0.58
4	002146	荣盛发展	90,500	790,065.00	0.55
5	603816	顾家家居	10,400	764,504.00	0.53
6	600352	浙江龙盛	58,500	699,075.00	0.49
7	600309	万华化学	15,300	694,926.00	0.48
8	000333	美的集团	13,100	684,082.00	0.48
9	603589	口子窖	10,900	669,805.00	0.47
10	600566	济川药业	13,800	665,022.00	0.46
11	000581	威孚高科	29,700	656,667.00	0.46
12	002258	利尔化学	33,700	652,432.00	0.45
13	601012	隆基股份	38,700	645,903.00	0.45
14	601318	中国平安	10,900	638,522.00	0.44
15	600406	国电南瑞	39,900	630,420.00	0.44
16	000651	格力电器	13,300	627,095.00	0.44

17	600201	生物股份	36,530	624,297.70	0.43
18	002078	太阳纸业	61,000	591,090.00	0.41
19	000786	北新建材	31,500	583,695.00	0.41
20	300296	利亚德	45,000	579,600.00	0.40
21	601939	建设银行	86,500	566,575.00	0.39
22	600487	亨通光电	24,920	549,486.00	0.38
23	600585	海螺水泥	16,400	549,072.00	0.38
24	002597	金禾实业	27,000	547,560.00	0.38
25	600176	中国巨石	51,840	530,323.20	0.37
26	600398	海澜之家	35,500	452,270.00	0.31
27	002310	东方园林	24,100	362,223.00	0.25
28	000002	万科A	12,800	314,880.00	0.22
29	601066	中信建投	16,447	176,969.72	0.12
30	600409	三友化工	16,900	145,509.00	0.10
31	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.06
32	603587	地素时尚	1,436	59,321.16	0.04
33	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.04
34	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.03
35	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
36	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

#### 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	000651	格力电器	1,642,077.00	1.16
2	601318	中国平安	1,122,054.00	0.79
3	600340	华夏幸福	1,026,783.53	0.73
4	000333	美的集团	1,020,839.00	0.72
5	002146	荣盛发展	928,187.00	0.66



6	000858	五 粮 液	891,244.00	0.63
7	601668	中国建筑	858,500.00	0.61
8	600352	浙江龙盛	723,096.00	0.51
9	603816	顾家家居	716,919.00	0.51
10	601012	隆基股份	714,285.00	0.50
11	603589	口子窖	689,858.00	0.49
12	600406	国电南瑞	689,849.00	0.49
13	002236	大华股份	688,233.00	0.49
14	002460	赣锋锂业	686,895.00	0.49
15	000786	北新建材	685,093.00	0.48
16	600176	中国巨石	682,979.00	0.48
17	600487	亨通光电	680,667.00	0.48
18	600273	嘉化能源	676,456.00	0.48
19	300415	伊之密	675,221.00	0.48
20	601678	滨化股份	672,635.00	0.48

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	600885	宏发股份	979,520.00	0.69
2	601288	农业银行	865,865.00	0.61
3	600104	上汽集团	852,911.00	0.60
4	000858	五 粮 液	831,730.00	0.59
5	601398	工商银行	782,000.00	0.55
6	601628	中国人寿	750,288.40	0.53
7	002304	洋河股份	720,011.00	0.51
8	601601	中国太保	718,809.00	0.51
9	601238	广汽集团	690,696.00	0.49
10	603766	隆鑫通用	683,813.00	0.48

11	000651	格力电器	646,752.36	0.46
12	600273	嘉化能源	634,008.00	0.45
13	601668	中国建筑	632,180.00	0.45
14	600114	东睦股份	629,744.72	0.44
15	002236	大华股份	618,549.00	0.44
16	601678	滨化股份	606,715.70	0.43
17	000488	晨鸣纸业	604,335.00	0.43
18	600009	上海机场	592,343.00	0.42
19	603259	药明康德	588,080.84	0.42
20	002078	太阳纸业	546,225.00	0.39

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	39,974,607.02
卖出股票收入（成交）总额	26,011,857.66

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 本基金投资的招商银行（600036.SH）于2018年5月4号收到中国银行保险监督管理委员会发出的《行政处罚信息公开表》（银监罚决字〔2018〕1号）。招商银行因内控管理严重违反审慎经营规则，违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、将票据贴现资金直接转回出票人账户、签订保本合同销售同业非保本理财产品，同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等事项，依据《商业银行内部控制指引》第十三条，《中国银监会关于加大防范操作风险工作力度的通知》第三条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条等条例，被处以罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

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视为，认为上述处罚不会对招商银行（600036.SH）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。

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	13,275.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,057.26
5	应收申购款	545,399.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	563,732.82

### 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	持有	户均持有的	持有人结构
----	----	-------	-------

级别	人户数 (户)	基金份额	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3 00指 数增 强(L OF)A	3,40 0	32,783.46	63,466,563.62	56.94 %	47,997,210.18	43.06%
中欧 沪深3 00指 数增 强(L OF)E	263	3,730.64	122,023.00	12.44 %	859,134.44	87.56%
合计	3,66 3	30,697.50	63,588,586.62	56.55 %	48,856,344.62	43.45%

## 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	徐立新	49,400.00	7.97
2	汪秀娣	48,705.00	7.86
3	任晓光	46,100.00	7.44
4	苑志娟	37,302.00	6.02
5	乔爱科	36,300.00	5.86
6	张达	30,004.00	4.84
6	林海洪	30,004.00	4.84
7	刘国珍	30,001.00	4.84
8	徐启杨	23,400.00	3.77
9	孙杰	20,003.00	3.23
10	于绍华	20,000.00	3.23

注：上表所列持有人均为场内持有人。

### 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	4,256.31	0.00%
	中欧沪深300指数增强 (LOF) E	52,544.11	5.36%
	合计	56,800.42	0.05%

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金A类份额的比例为0.0038%，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

## § 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	98,959,107.16	517,943.01
本报告期基金总申购份额	18,485,135.70	1,137,378.01
减：本报告期基金总赎回份额	5,980,469.06	674,163.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	111,463,773.80	981,157.44

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未发生重大的人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	10,531,947.09	16.25%	9,808.48	16.25%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	28,206,948.83	43.51%	26,266.97	43.51%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	20,887,086.57	32.22%	19,451.97	32.22%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
招商	1	-	-	-	-	-



证券						
长江证券	1	5,199,638.00	8.02%	4,842.43	8.02%	-
国都证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

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2017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	中国证监会指定媒体	2018-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通转换业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-01-15
3	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2017年第4季度报告	中国证监会指定媒体	2018-01-19
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过天天基金和国泰君安代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-01-19
5	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2018年第1号）	中国证监会指定媒体	2018-02-06
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（2018年第1号）	中国证监会指定媒体	2018-02-06
7	中欧基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒体	2018-03-06

	新增大连银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告		
8	中欧基金管理关于新增财通证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通定投和转换业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-14
9	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同(修订)	中国证监会指定媒体	2018-03-24
10	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“万华化学”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-24
11	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金因法律法规变动相应修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-24
12	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)托管协议(修订)	中国证监会指定媒体	2018-03-24
13	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)2017年年度报告摘要	中国证监会指定媒体	2018-03-30
14	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)2017年年度报告	中国证监会指定媒体	2018-03-30
15	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-19
16	中欧沪深300指数增强型证	中国证监会指定媒体	2018-04-23

	券投资基金(LOF)2018年第一 季度报告		
17	中欧基金管理有限公司关于 调整旗下通过挖财基金代销 定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-23
18	中欧基金管理有限公司关于 调整旗下部分基金持有“中 兴通讯”股票估值方法的公 告	中国证监会指定媒体	2018-04-25
19	中欧基金管理有限公司关于 调整旗下通过招商银行代销 定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-05-24

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年6月30日	29,153,790.09	13,427,554.72	0.00	42,581,344.81	37.87%

#### 产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.zofund.com](http://www.zofund.com))查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十八日