

中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2016年半年度报告

2016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：2016年08月24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2016年8月22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2016年1月1日起至2016年6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	7
§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	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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	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
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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	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	38
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	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58

10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	基金改聘会计师事务所情况.....	58
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.....	59
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8	其他重大事件.....	60
§11	备查文件目录.....	63
11.1	备查文件目录.....	63
11.2	存放地点.....	63
11.3	查阅方式.....	63

§ 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	63,914,360.25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	63,538,596.21份	375,764.04份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数，在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整，

	在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	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号东方汇经大厦五层	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号东方汇经大厦五层	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号东方汇经大厦五层

§ 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（2016年1月1日至2016年6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	-2,202,391.79	-11,385.90
本期利润	-12,274,410.32	-59,569.20
加权平均基金份额本期利润	-0.1850	-0.1704
本期加权平均净值利润率	-17.12%	-15.77%
本期基金份额净值增长率	-14.61%	-14.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	6,365,562.56	37,867.23
期末可供分配基金份额利润	0.1002	0.1008
期末基金资产净值	69,904,158.77	413,631.27
期末基金份额净值	1.1002	1.1008
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.52%	-4.48%

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	0.66%	0.95%	-0.46%	0.93%	1.12%	0.02%
过去三个月	-0.70%	1.00%	-1.88%	0.96%	1.18%	0.04%
过去六个月	-14.61%	1.84%	-14.66%	1.75%	0.05%	0.09%
过去一年	-28.58%	2.24%	-28.01%	2.19%	-0.57%	0.05%
过去三年	48.88%	1.76%	41.68%	1.75%	7.20%	0.01%
自基金运作日至今	14.52%	1.52%	14.77%	1.54%	-0.25%	-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	0.66%	0.95%	-0.46%	0.93%	1.12%	0.02%
过去三个月	-0.60%	1.00%	-1.88%	0.96%	1.28%	0.04%
过去六个月	-14.51%	1.84%	-14.66%	1.75%	0.15%	0.09%
自基金份额运作日起至今	-4.48%	1.77%	-5.16%	1.70%	0.68%	0.07%

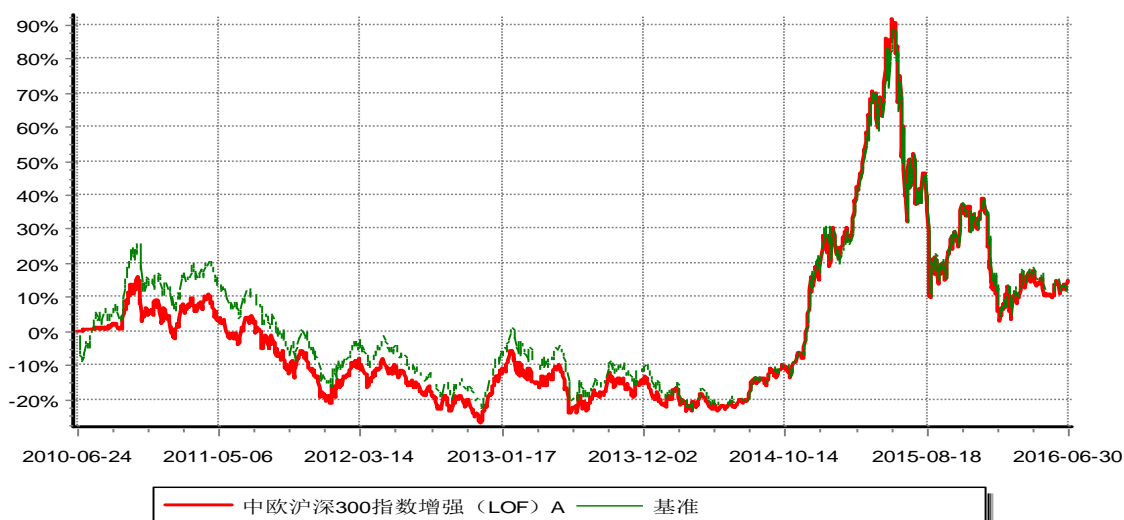
注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧沪深300指数增强 (LOF) A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年06月24日-2016年6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-2016年6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2016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2016年6月30日，本基金管理人共管理40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	—	9年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015年4月加入中欧基金管理有限公司，现任事业部负责人，中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

2015年上半年，中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施，同时对公司原督察长黄桦先生

予以警示。

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

一季度市场经历了A股市场经历了熔断暴跌,底部振荡,和小幅反弹三个阶段;二季度大盘筑底企稳,整体波动率明显下降,不同行业收益分化较大,业绩好成长性预期强的行业,如新能源车产业链等板块有结构化行情。在报告期内,我们在保持较高被动部分仓位的情况下,通过量化选股配置了包括国企改革、新能源车、高端制造等概念股票板块,同时积极参与了新股申购,增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金A类份额净值增长率为-14.61%,同期业绩比较基准收益率为-14.66%;E类份额净值增长率为-14.51%,同期业绩比较基准收益率为-14.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,我们认为人民币汇率压力减缓,投资者风险偏好逐步上升,可能走出一波较好的行情。我们看好智能制造、国企改革、新能源车、白酒等概念板块,将继续配置相关个股。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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: 2016年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	3,971,633.74	6,484,193.19
结算备付金		8,929.68	96,404.41
存出保证金		12,510.58	31,948.12
交易性金融资产	6.4.7.2	66,113,674.17	78,381,280.29
其中: 股票投资		66,113,674.17	78,381,280.29
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		506,081.03	—
应收利息	6.4.7.5	1,618.50	3,186.99
应收股利		—	—
应收申购款		4,582.75	27,866.38

递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		70,619,030.45	85,024,879.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
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		—	734.29
应付赎回款		8,054.33	710,406.22
应付管理人报酬		57,184.28	72,499.14
应付托管费		8,577.64	10,874.87
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	10,808.71	65,110.59
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	216,615.45	395,612.97
负债合计		301,240.41	1,255,238.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	63,914,360.25	65,018,143.56
未分配利润	6.4.7.10	6,403,429.79	18,751,497.74
所有者权益合计		70,317,790.04	83,769,641.30
负债和所有者权益总计		70,619,030.45	85,024,879.38

注：报告截止日2016年6月30日，中欧300A类基金份额净值1.1002元，中欧300E类基金份额净值1.1008元，基金份额总额63,914,360.25份，其中中欧300A类基金份额63,538,596.21份，300E类基金份额375,764.04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：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年06 月30日
一、收入		-11,595,907.41	42,491,177.39
1.利息收入		41,826.56	100,319.56
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	41,826.56	99,157.78
债券利息收入		—	3.19
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	1,158.59
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,526,230.48	62,566,566.98
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	-2,109,329.93	61,643,416.55
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	—	10,799.71
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7 .14	—	—
股利收益	6.4.7 .15	583,099.45	912,350.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7 .16	-10,120,201.83	-20,453,934.55
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 .17	8,698.34	278,225.40
减: 二、费用		738,072.11	1,934,698.65
1. 管理人报酬		358,664.09	864,821.14
2. 托管费		53,799.63	129,723.19
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7 .18	53,968.85	628,012.10
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 .19	271,639.54	312,142.22
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-12,333,979.52	40,556,478.74
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-12,333,979.52	40,556,478.74

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: 2016年01月01日-2016年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 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
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015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)	265,269,910.92	51,696,909.23	316,966,820.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	40,556,478.74	40,556,478.74
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)	-186,559,740.81	-49,710,264.70	-236,270,005.51
其中：1.基金申购款	43,863,218.93	17,795,058.14	61,658,277.07
2.基金赎回款	-230,422,959.74	-67,505,322.84	-297,928,282.58
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)	78,710,170.11	42,543,123.27	121,253,293.38

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。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数,力求控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。本基金的业绩比较基准为:95% × 沪深300指数收益率+5% × 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2016年8月24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2016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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补

充政策的通知》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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 2016年06月30日
活期存款	3,971,633.74
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	3,971,633.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	68,657,356.67	66,113,674.17	-2,543,682.50
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		68,657,356.67	66,113,674.17	-2,543,682.50

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:2016年06月30日
应收活期存款利息	1,609.76
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	3.69
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	5.04
合计	1,618.50

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 2016年06月30日
----	-----------------

交易所市场应付交易费用	10,808.71
银行间市场应付交易费用	—
合计	10,808.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	29.87
预提信息披露费	149,178.12
预提审计费	29,835.26
预提指数使用费	2,829.25
预提上市费	29,835.26
其他应付	4,907.69
合计	216,615.45

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 2016年01月01日-2016年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	64,764,801.45	64,764,801.45
本期申购	7,707,675.17	7,707,675.17
本期赎回 (以“-”号填列)	-8,933,880.41	-8,933,880.41
本期末	63,538,596.21	63,538,596.21
项目 (中欧沪深300指数增强 (LOF) E)	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	253,342.11	253,342.11
本期申购	438,418.20	438,418.20
本期赎回 (以“-”号填列)	-315,996.27	-315,996.27

本期末	375,764.04	375,764.04
-----	------------	------------

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2016年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,089,024.00份，均为中欧沪深300 A类基金份额(2015年6月30日：深交所上市的基金份额为1,479,298.00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62,825,336.25份，其中中欧沪深300 A类基金份额62,449,572.21份，中欧沪深300E类基金份额375,764.04份(2015年6月30日：77,230,872.11份，均为中欧沪深300 A类基金份额)。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	31,362,641.45	-12,684,032.17	18,678,609.28
本期利润	-2,202,391.79	-10,072,018.53	-12,274,410.32
本期基金份额交易产生的变动数	-481,831.49	443,195.09	-38,636.40
其中：基金申购款	3,622,828.82	-2,923,307.12	699,521.70
基金赎回款	-4,104,660.31	3,366,502.21	-738,158.10
本期已分配利润	—	—	—
本期末	28,678,418.17	-22,312,855.61	6,365,562.56

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	44,788.30	28,100.16	72,888.46
本期利润	-11,385.90	-48,183.30	-59,569.20
本期基金份额交易产生的变	21,104.77	3,443.20	24,547.97

动数			
其中：基金申购款	66,464.01	-21,240.67	45,223.34
基金赎回款	-45,359.24	24,683.87	-20,675.37
本期已分配利润	—	—	—
本期末	54,507.17	-16,639.94	37,867.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
活期存款利息收入	41,290.51
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	352.38
其他	183.67
合计	41,826.56

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2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-2109329.93
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	-2109329.93

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
----	----

	2016年01月01日-2016年06月30日
卖出股票成交总额	17,878,372.13
减：卖出股票成本总额	19,987,702.06
买卖股票差价收入	-2,109,329.93

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

无余额。

6.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
股票投资产生的股利收益	583,099.45
基金投资产生的股利收益	—
合计	583,099.45

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
1.交易性金融资产	-10,120,201.83
——股票投资	-10,120,201.83
——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	—
合计	-10,120,201.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
基金赎回费收入	5,680.91
转换费收入	3,017.43
合计	8,698.34

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
交易所市场交易费用	53,968.85
银行间市场交易费用	—
合计	53,968.85

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
上市费	29,835.26
指数使用费	52,829.25
帐户维护费	9,000.00
汇划手续费	961.65
合计	271,639.54

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 × 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
万盛基业投资有限责任公司 ("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司 ("北京百骏")	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a ("意大利意联银行")	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业 (有限合伙) ("上海睦亿合伙")	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 ("中欧盛世资管")	基金管理人的控股子公司
钱滚滚财富投资管理 (上海) 有限公司 ("钱滚滚财富")	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30 日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	2,169,958.11	6.13%	9,712,600.43	2.85%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
国都证券	2,020.89	6.13%	1,286.39	11.90%
关联方名称	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
国都证券	8,842.36	2.85%	—	—

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

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

6.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30 日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国都证券	—	—	35,008.20	100.00%

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 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	358,664.09	864,821.14
其中：支付销售机构的客户维护费	96,597.24	222,257.80

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 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	53,799.63	129,723.19

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月 30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015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	75,466.54	—
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	—	—	75,466.54	—
报告期末持有的基金 份额	—	122,023.00	—	—
占基金总份额比例	—	32.47%	—	—

注：本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

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

无。

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	上年度可比期间
	2016年01月01日-2016年06月30 日	2015年01月01日-2015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
兴业银行活期存款	3,971,633.74	41,290.51	7,167,218.17	95,983.52

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

无。

6.4.12 期末（2016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（股）	期末成本总额	期末估值总额
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	未上市	5.80	5.80	717	4,158.60	4,158.60
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	未上市	10.05	10.05	402	4,040.10	4,040.10
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	未上市	8.49	8.49	431	3,659.19	3,659.19

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
000002	万科A	2015-12-18	重大资产重组	18.20	2016-07-04	21.99	69,765	763,909.91	1,269,723.00
000415	渤海金控	2016-02-01	筹划重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	13,500	120,314.57	92,070.00
000651	格力电器	2016-02-22	筹划重大事项	19.22			35,776	534,014.63	687,614.72
000728	国元证券	2016-06-08	筹划重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	8,803	181,329.62	147,186.16
00095	欣龙	2016-	重大资产	8.55	2016-	9.00	40,00	307,475.00	342,000.00

5	股份	04-08	重组		08-10		0		
002065	东华软件	2015-12-21	筹划重大事项	18.72	2016-07-04	22.59	5,976	117,207.70	111,870.72
002129	中环控股	2016-04-25	筹划重大事项	8.29			9,985	112,720.19	82,775.65
002465	海格通信	2016-06-13	筹划重大事项	12.44			13,106	137,000.75	163,038.64
300450	先导智能	2016-03-14	筹划重大事项	37.81	2016-07-20	41.59	10,200	309,487.00	385,662.00
600005	武钢股份	2016-06-27	重大资产重组	2.76			31,100	182,104.83	85,836.00
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大资产重组	4.90			38,153	243,528.17	186,949.70
600649	城投控股	2016-06-20	筹划重大事项	14.36			11,481	88,267.84	164,867.16
601611	中国核建	2016-06-30	股价异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	1,008	3,497.76	21,087.36

注：本基金截至2016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2016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 2016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	3,971,633.74	—	—	—	3,971,633.74
结算备付金	8,929.68	—	—	—	8,929.68
存出保证金	12,510.58	—	—	—	12,510.58
交易性金融资	—	—	—	66,113,674.17	66,113,674.17

产					
应收证券清算款	—	—	—	506,081.03	506,081.03
应收利息	—	—	—	1,618.50	1,618.50
应收申购款	—	—	—	4,582.75	4,582.75
资产总计	3,993,074.00	—	—	66,625,956.45	70,619,030.45
负债					
应付赎回款	—	—	—	8,054.33	8,054.33
应付管理人报酬	—	—	—	57,184.28	57,184.28
应付托管费	—	—	—	8,577.64	8,577.64
应付交易费用	—	—	—	10,808.71	10,808.71
其他负债	—	—	—	216,615.45	216,615.45
负债总计	—	—	—	301,240.41	301,240.41
利率敏感度缺口	3,993,074.00	—	—	66,324,716.04	70,317,790.04
上年度末 2015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	6,484,193.19	—	—	—	6,484,193.19
结算备付金	96,404.41	—	—	—	96,404.41
存出保证金	31,948.12	—	—	—	31,948.12
交易性金融资产	—	—	—	78,381,280.29	78,381,280.29
应收证券清算款	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	3,186.99	3,186.99
应收申购款	—	—	—	27,866.38	27,866.38
资产总计	6,612,545.7	—	—	78,412,333.	85,024,879.

	2			66	38
负债					
应付证券清算款	—	—	—	734.29	734.29
应付赎回款	—	—	—	710,406.22	710,406.22
应付管理人报酬	—	—	—	72,499.14	72,499.14
应付托管费	—	—	—	10,874.87	10,874.87
应付交易费用	—	—	—	65,110.59	65,110.59
其他负债	—	—	—	395,612.97	395,612.97
负债总计	—	—	—	1,255,238.08	1,255,238.08
利率敏感度缺口	6,612,545.72	—	—	77,157,095.58	83,769,641.30

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2016年6月30日，本基金未持有交易性债券资产，(2015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(2015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 2016年06月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	66,113,674.17	94.02	78,381,280.29	93.57
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	66,113,674.17	94.02	78,381,280.29	93.57

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 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	366.36	420.57
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-366.36	-420.57

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2016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62,361,135.17元，属于第二层次的余额为3,752,539.00元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次73,349,782.90元，第二层次5,031,497.39元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	66,113,674.17	93.62
	其中：股票	66,113,674.17	93.62
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	3,980,563.42	5.64
7	其他各项资产	524,792.86	0.74
8	合计	70,619,030.45	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	50,477.70	0.07
B	采矿业	2,175,743.78	3.09
C	制造业	20,338,004.64	28.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,410,692.13	3.43
E	建筑业	2,050,230.30	2.92
F	批发和零售业	1,430,302.83	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,935,780.12	2.75
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,038,486.83	5.74
J	金融业	22,880,760.92	32.54
K	房地产业	3,312,397.01	4.71

L	租赁和商务服务业	707,823.74	1.01
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	443,864.30	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	111,379.97	0.16
R	文化、体育和娱乐业	921,351.46	1.31
S	综合	280,600.50	0.40
	合计	63,087,896.23	89.72

7.2.2 报告期末 (积极投资) 按行业分类的股票投资组合

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	259,000.00	0.37
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,826,612.24	2.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	21,087.36	0.03
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	876,334.25	1.25
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	42,744.09	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—

R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,025,777.94	4.30

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	600016	民生银行	306,735	2,739,143.55	3.90
2	601318	中国平安	81,246	2,603,121.84	3.70
3	600036	招商银行	121,551	2,127,142.50	3.03
4	000002	万科 A	69,765	1,269,723.00	1.81
5	600000	浦发银行	81,012	1,261,356.84	1.79
6	600519	贵州茅台	3,752	1,095,283.84	1.56
7	601328	交通银行	177,293	998,159.59	1.42
8	600030	中信证券	59,216	961,075.68	1.37
9	600837	海通证券	60,610	934,606.20	1.33
10	601288	农业银行	286,182	915,782.40	1.30
11	601169	北京银行	76,037	788,503.69	1.12
12	600887	伊利股份	45,486	758,251.62	1.08
13	601398	工商银行	161,501	717,064.44	1.02
14	000651	格力电器	35,776	687,614.72	0.98
15	601601	中国太保	23,740	641,929.60	0.91
16	601766	中国中车	68,896	631,776.32	0.90
17	600900	长江电力	49,484	618,055.16	0.88
18	601668	中国建筑	112,428	598,116.96	0.85
19	000333	美的集团	24,453	580,025.16	0.82
20	601988	中国银行	158,525	508,865.25	0.72

21	600104	上汽集团	25,042	508,102.18	0.72
22	601688	华泰证券	24,774	468,724.08	0.67
23	000858	五 粮 液	14,407	468,659.71	0.67
24	601818	光大银行	119,604	449,711.04	0.64
25	000001	平安银行	51,601	448,928.70	0.64
26	601989	中国重工	70,534	446,480.22	0.63
27	600276	恒瑞医药	10,512	421,636.32	0.60
28	600048	保利地产	48,411	417,786.93	0.59
29	000725	京东方 A	178,097	411,404.07	0.59
30	600015	华夏银行	40,086	396,450.54	0.56
31	002024	苏宁云商	35,575	386,344.50	0.55
32	000776	广发证券	22,285	373,496.60	0.53
33	600028	中国石化	78,692	371,426.24	0.53
34	300104	乐视网	7,002	370,475.82	0.53
35	300059	东方财富	16,264	361,060.80	0.51
36	600999	招商证券	21,671	357,571.50	0.51
37	600518	康美药业	23,278	353,592.82	0.50
38	600637	东方明珠	13,879	336,843.33	0.48
39	002450	康得新	19,271	329,534.10	0.47
40	002304	洋河股份	4,510	324,359.20	0.46
41	601377	兴业证券	41,170	304,246.30	0.43
42	002415	海康威视	13,885	297,972.10	0.42
43	601390	中国中铁	42,174	293,952.78	0.42
44	000783	长江证券	24,884	288,654.40	0.41
45	601006	大秦铁路	44,753	288,209.32	0.41
46	002594	比亚迪	4,703	286,930.03	0.41
47	000166	申万宏源	33,432	281,163.12	0.40
48	601857	中国石油	36,425	263,352.75	0.37
49	601628	中国人寿	12,584	261,998.88	0.37
50	601009	南京银行	27,622	259,370.58	0.37
51	601186	中国铁建	25,956	258,521.76	0.37

52	001979	招商蛇口	17,900	255,075.00	0.36
53	000063	中兴通讯	17,700	253,818.00	0.36
54	000538	云南白药	3,876	249,226.80	0.35
55	600570	恒生电子	3,701	247,115.77	0.35
56	600050	中国联通	63,786	243,024.66	0.35
57	601985	中国核电	35,100	239,733.00	0.34
58	601939	建设银行	50,312	238,982.00	0.34
59	601901	方正证券	31,082	238,088.12	0.34
60	601899	紫金矿业	70,566	237,807.42	0.34
61	300017	网宿科技	3,538	237,753.60	0.34
62	600011	华能国际	31,595	237,594.40	0.34
63	000625	长安汽车	17,030	232,800.10	0.33
64	600111	北方稀土	16,874	224,592.94	0.32
65	002230	科大讯飞	6,808	223,642.80	0.32
66	002673	西部证券	8,520	220,327.20	0.31
67	600585	海螺水泥	15,085	219,335.90	0.31
68	000503	海虹控股	5,429	218,300.09	0.31
69	002142	宁波银行	14,747	217,960.66	0.31
70	600795	国电电力	73,322	214,833.46	0.31
71	601555	东吴证券	15,986	214,212.40	0.30
72	600010	包钢股份	74,398	212,778.28	0.30
73	000100	TCL 集团	64,599	212,530.71	0.30
74	601099	太平洋	34,520	211,607.60	0.30
75	300024	机器人	8,320	211,244.80	0.30
76	601088	中国神华	14,898	209,614.86	0.30
77	000423	东阿阿胶	3,956	208,995.48	0.30
78	600690	青岛海尔	23,118	205,287.84	0.29
79	601211	国泰君安	11,501	204,602.79	0.29
80	600547	山东黄金	5,234	203,654.94	0.29
81	600893	中航动力	5,844	202,494.60	0.29
82	600271	航天信息	8,482	201,871.60	0.29

83	600066	宇通客车	10,121	200,395.80	0.28
84	002241	歌尔股份	6,971	199,928.28	0.28
85	600100	同方股份	13,361	199,880.56	0.28
86	300027	华谊兄弟	14,594	197,602.76	0.28
87	600703	三安光电	9,677	193,249.69	0.27
88	600009	上海机场	7,358	191,675.90	0.27
89	600029	南方航空	27,089	191,248.34	0.27
90	600705	中航资本	32,360	190,276.80	0.27
91	601336	新华保险	4,684	189,233.60	0.27
92	600109	国金证券	13,898	187,345.04	0.27
93	600019	宝钢股份	38,153	186,949.70	0.27
94	600153	建发股份	15,441	185,292.00	0.26
95	002202	金风科技	11,863	179,487.19	0.26
96	601669	中国电建	31,180	178,037.80	0.25
97	600383	金地集团	16,986	175,974.96	0.25
98	600535	天士力	4,853	173,543.28	0.25
99	600115	东方航空	26,041	172,131.01	0.24
100	002236	大华股份	13,042	170,850.20	0.24
101	300070	碧水源	11,435	170,152.80	0.24
102	601727	上海电气	22,300	168,588.00	0.24
103	600886	国投电力	25,364	167,402.40	0.24
104	600196	复星医药	8,776	166,919.52	0.24
105	000839	中信国安	7,800	166,218.00	0.24
106	600089	特变电工	19,475	165,927.00	0.24
107	600649	城投控股	11,481	164,867.16	0.23
108	000768	中航飞机	8,358	164,569.02	0.23
109	600340	华夏幸福	6,738	164,272.44	0.23
110	002465	海格通信	13,106	163,038.64	0.23
111	600177	雅戈尔	11,696	161,287.84	0.23
112	002736	国信证券	9,301	160,442.25	0.23
113	002456	欧菲光	5,426	160,067.00	0.23

114	601607	上海医药	8,847	159,688.35	0.23
115	000069	华侨城 A	24,657	157,804.80	0.22
116	601600	中国铝业	41,846	157,759.42	0.22
117	000895	双汇发展	7,548	157,602.24	0.22
118	000568	泸州老窖	5,288	157,053.60	0.22
119	600804	鹏博士	8,542	155,720.66	0.22
120	002252	上海莱士	4,102	154,563.36	0.22
121	600369	西南证券	21,280	154,492.80	0.22
122	600085	同仁堂	5,156	153,597.24	0.22
123	600485	信威集团	8,602	153,459.68	0.22
124	000917	电广传媒	9,227	152,522.31	0.22
125	601788	光大证券	9,000	152,460.00	0.22
126	600660	福耀玻璃	10,800	151,200.00	0.22
127	600118	中国卫星	4,447	149,419.20	0.21
128	002385	大北农	18,479	148,940.74	0.21
129	600406	国电南瑞	11,121	148,687.77	0.21
130	600352	浙江龙盛	17,202	148,281.24	0.21
131	000728	国元证券	8,803	147,186.16	0.21
132	002008	大族激光	6,398	146,130.32	0.21
133	600867	通化东宝	7,035	145,554.15	0.21
134	600489	中金黄金	12,860	144,546.40	0.21
135	601018	宁波港	29,060	143,847.00	0.20
136	600031	三一重工	28,643	143,787.86	0.20
137	002500	山西证券	8,651	143,260.56	0.20
138	600739	辽宁成大	9,178	142,901.46	0.20
139	600309	万华化学	8,243	142,603.90	0.20
140	000338	潍柴动力	18,232	142,391.92	0.20
141	600221	海南航空	44,559	141,252.03	0.20
142	600061	国投安信	7,800	138,996.00	0.20
143	300124	汇川技术	7,099	137,720.60	0.20
144	600674	川投能源	16,596	137,082.96	0.19

145	000157	中联重科	33,071	136,583.23	0.19
146	000686	东北证券	10,537	136,032.67	0.19
147	601618	中国中冶	36,798	135,784.62	0.19
148	000559	万向钱潮	8,681	135,423.60	0.19
149	600958	东方证券	8,001	134,496.81	0.19
150	000623	吉林敖东	5,376	134,131.20	0.19
151	600741	华域汽车	9,472	132,702.72	0.19
152	601998	中信银行	23,249	131,821.83	0.19
153	000876	新希望	15,762	131,139.84	0.19
154	601111	中国国航	19,306	130,508.56	0.19
155	000009	中国宝安	9,515	130,355.50	0.19
156	300168	万达信息	5,000	129,950.00	0.18
157	601888	中国国旅	2,949	129,697.02	0.18
158	600446	金证股份	3,600	129,420.00	0.18
159	002183	怡亚通	9,000	128,880.00	0.18
160	600415	小商品城	20,664	127,703.52	0.18
161	601933	永辉超市	30,634	126,518.42	0.18
162	300315	掌趣科技	12,000	125,880.00	0.18
163	600018	上港集团	24,330	124,083.00	0.18
164	600839	四川长虹	28,042	123,945.64	0.18
165	600663	陆家嘴	5,374	122,258.50	0.17
166	300003	乐普医疗	6,700	122,208.00	0.17
167	000793	华闻传媒	12,306	121,583.28	0.17
168	600068	葛洲坝	20,760	120,823.20	0.17
169	601800	中国交建	11,453	120,600.09	0.17
170	000963	华东医药	1,781	120,039.40	0.17
171	600718	东软集团	6,510	119,263.20	0.17
172	000750	国海证券	16,133	119,222.87	0.17
173	000792	盐湖股份	5,622	118,624.20	0.17
174	000046	泛海控股	11,700	118,287.00	0.17
175	601919	中国远洋	23,200	117,856.00	0.17

176	600150	中国船舶	5,230	116,419.80	0.17
177	000826	启迪桑德	3,794	115,906.70	0.16
178	600398	海澜之家	10,216	115,440.80	0.16
179	000413	东旭光电	13,400	115,106.00	0.16
180	600583	海油工程	16,602	114,719.82	0.16
181	300058	蓝色光标	11,792	114,500.32	0.16
182	002292	奥飞娱乐	3,792	113,570.40	0.16
183	002065	东华软件	5,976	111,870.72	0.16
184	300015	爱尔眼科	3,049	111,379.97	0.16
185	002007	华兰生物	3,528	110,779.20	0.16
186	600157	永泰能源	27,939	110,079.66	0.16
187	002475	立讯精密	5,600	110,040.00	0.16
188	000402	金融街	11,168	108,552.96	0.15
189	000060	中金岭南	10,325	107,689.75	0.15
190	300144	宋城演艺	4,300	107,113.00	0.15
191	600895	张江高科	5,800	104,864.00	0.15
192	600023	浙能电力	20,574	104,721.66	0.15
193	600060	海信电器	5,845	103,339.60	0.15
194	601106	中国一重	19,700	102,637.00	0.15
195	002422	科伦药业	6,586	101,490.26	0.14
196	002081	金螳螂	10,081	101,011.62	0.14
197	600688	上海石化	16,554	100,979.40	0.14
198	601333	广深铁路	25,576	100,002.16	0.14
199	600816	安信信托	5,900	99,533.00	0.14
200	600332	白云山	4,019	99,028.16	0.14
201	600820	隧道股份	11,800	99,002.00	0.14
202	000977	浪潮信息	4,200	98,490.00	0.14
203	600642	申能股份	17,139	98,377.86	0.14
204	000425	徐工机械	32,070	98,134.20	0.14
205	601098	中南传媒	5,396	97,721.56	0.14
206	300002	神州泰岳	9,156	97,419.84	0.14

207	600074	保千里	6,500	96,980.00	0.14
208	600256	广汇能源	23,471	96,231.10	0.14
209	601866	中海集运	24,005	95,059.80	0.14
210	002152	广电运通	5,700	93,708.00	0.13
211	000738	中航动控	3,500	92,400.00	0.13
212	000415	渤海金控	13,500	92,070.00	0.13
213	600027	华电国际	18,285	90,510.75	0.13
214	601198	东兴证券	3,701	90,452.44	0.13
215	601718	际华集团	11,700	89,388.00	0.13
216	000709	河钢股份	32,028	88,717.56	0.13
217	600875	东方电气	8,961	87,997.02	0.13
218	601991	大唐发电	22,500	87,525.00	0.12
219	000540	中天城投	14,000	87,220.00	0.12
220	600373	中文传媒	4,201	87,170.75	0.12
221	600376	首开股份	7,800	86,736.00	0.12
222	600208	新潮中宝	20,502	86,723.46	0.12
223	600588	用友网络	4,415	86,445.70	0.12
224	600873	梅花生物	13,917	86,424.57	0.12
225	601021	春秋航空	1,800	86,292.00	0.12
226	600005	武钢股份	31,100	85,836.00	0.12
227	600362	江西铜业	6,288	84,762.24	0.12
228	600252	中恒集团	19,500	84,630.00	0.12
229	600737	中粮屯河	7,200	83,160.00	0.12
230	300133	华策影视	5,340	83,143.80	0.12
231	002129	中环股份	9,985	82,775.65	0.12
232	601117	中国化学	14,955	82,701.15	0.12
233	603993	洛阳钼业	19,782	82,095.30	0.12
234	000729	燕京啤酒	10,668	80,970.12	0.12
235	000039	中集集团	5,659	80,188.03	0.11
236	000061	农产品	6,468	78,650.88	0.11
237	601225	陕西煤业	15,100	78,067.00	0.11

238	601179	中国西电	15,318	77,662.26	0.11
239	600372	中航电子	3,981	77,510.07	0.11
240	601633	长城汽车	9,076	76,601.44	0.11
241	300251	光线传媒	6,601	76,307.56	0.11
242	000778	新兴铸管	16,294	75,604.16	0.11
243	601872	招商轮船	16,100	75,348.00	0.11
244	002470	金正大	9,300	74,865.00	0.11
245	600038	中直股份	1,800	74,664.00	0.11
246	600037	歌华有线	4,900	74,529.00	0.11
247	600704	物产中大	7,900	73,944.00	0.11
248	601992	金隅股份	9,464	73,346.00	0.10
249	000630	铜陵有色	28,765	73,063.10	0.10
250	000712	锦龙股份	3,500	72,660.00	0.10
251	002739	万达院线	900	71,910.00	0.10
252	000999	华润三九	2,960	71,691.20	0.10
253	601898	中煤能源	13,836	71,393.76	0.10
254	601216	君正集团	9,484	70,845.48	0.10
255	600827	百联股份	5,801	70,076.08	0.10
256	000883	湖北能源	14,645	67,806.35	0.10
257	603000	人民网	4,080	67,768.80	0.10
258	601258	庞大集团	24,514	67,413.50	0.10
259	000800	一汽轿车	6,157	66,988.16	0.10
260	600021	上海电力	6,501	66,765.27	0.09
261	002146	荣盛发展	9,908	66,581.76	0.09
262	600863	内蒙华电	21,824	65,908.48	0.09
263	002294	信立泰	2,398	65,225.60	0.09
264	002153	石基信息	2,400	63,312.00	0.09
265	600959	江苏有线	4,501	62,833.96	0.09
266	600600	青岛啤酒	2,129	61,890.03	0.09
267	600170	上海建工	16,104	61,678.32	0.09
268	601928	凤凰传媒	5,725	60,341.50	0.09

269	300146	汤臣倍健	4,400	59,576.00	0.08
270	600666	奥瑞德	1,700	59,092.00	0.08
271	601958	金钼股份	7,207	58,737.05	0.08
272	000027	深圳能源	8,951	57,107.38	0.08
273	300085	银之杰	1,900	56,810.00	0.08
274	600008	首创股份	14,300	55,627.00	0.08
275	600648	外高桥	2,783	54,852.93	0.08
276	000825	太钢不锈	17,100	54,036.00	0.08
277	000898	鞍钢股份	13,900	53,237.00	0.08
278	601808	中海油服	4,372	53,119.80	0.08
279	601608	中信重工	9,800	52,626.00	0.07
280	600582	天地科技	11,500	51,750.00	0.07
281	002195	二三四五	4,200	51,618.00	0.07
282	002424	贵州百灵	3,000	51,600.00	0.07
283	002399	海普瑞	2,909	50,791.14	0.07
284	601118	海南橡胶	9,030	50,477.70	0.07
285	600317	营口港	14,700	49,392.00	0.07
286	600871	石化油服	12,600	48,384.00	0.07
287	600783	鲁信创投	2,100	45,381.00	0.06
288	600578	京能电力	10,500	44,940.00	0.06
289	600098	广州发展	5,600	43,792.00	0.06
290	600998	九州通	2,469	43,232.19	0.06
291	600685	中船防务	1,700	43,112.00	0.06
292	002027	分众传媒	2,200	36,322.00	0.05
293	600188	兖州煤业	2,972	32,513.68	0.05
294	603885	吉祥航空	1,100	28,875.00	0.04
295	002568	百润股份	1,300	28,600.00	0.04
296	600022	山东钢铁	11,700	27,729.00	0.04
297	600606	绿地控股	2,500	27,050.00	0.04
298	000156	华数传媒	995	18,457.25	0.03
299	601016	节能风电	1,300	12,909.00	0.02

注:

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	300017	网宿科技	12,800	860,160.00	1.22
2	300450	先导智能	10,200	385,662.00	0.55
3	000955	欣龙控股	40,000	342,000.00	0.49
4	300193	佳士科技	27,200	282,608.00	0.40
5	002299	圣农发展	10,000	259,000.00	0.37
6	002643	万润股份	4,000	203,520.00	0.29
7	002206	海利得	8,000	137,040.00	0.19
8	002292	奥飞娱乐	3,800	113,810.00	0.16
9	002668	奥马电器	1,100	66,957.00	0.10
10	603779	威龙股份	1,302	54,631.92	0.08
11	603528	多伦科技	486	47,623.14	0.07
12	603959	百利科技	837	34,693.65	0.05
13	300515	三德科技	677	31,730.99	0.05
14	603131	上海沪工	505	30,653.50	0.04
15	300510	金冠电气	416	28,104.96	0.04
16	601611	中国核建	1,008	21,087.36	0.03
17	601127	小康股份	868	20,719.16	0.03
18	603737	三棵树	177	20,546.16	0.03
19	300512	中亚股份	194	19,384.48	0.03
20	002799	环球印务	432	18,852.48	0.03
21	300518	盛讯达	259	12,134.15	0.02
22	603909	合诚股份	438	8,050.44	0.01
23	002802	洪汇新材	502	7,570.16	0.01
24	603958	哈森股份	509	7,380.50	0.01
25	002805	丰元股份	717	4,158.60	0.01

26	300520	科大国创	402	4,040.10	0.01
27	603016	新宏泰	431	3,659.19	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	002643	万润股份	985,074.00	1.18
2	300017	网宿科技	699,940.00	0.84
3	300024	机器人	641,854.00	0.77
4	000826	启迪桑德	401,551.00	0.48
5	300014	亿纬锂能	393,325.00	0.47
6	300359	全通教育	385,274.00	0.46
7	000540	中天城投	331,756.41	0.40
8	300244	迪安诊断	323,835.00	0.39
9	000616	海航投资	323,000.00	0.39
10	001979	招商蛇口	308,541.00	0.37
11	000955	欣龙控股	307,475.00	0.37
12	601318	中国平安	288,132.00	0.34
13	300193	佳士科技	261,180.00	0.31
14	002299	圣农发展	252,122.00	0.30
15	600016	民生银行	247,099.00	0.29
16	600000	浦发银行	222,872.00	0.27
17	600398	海澜之家	212,320.20	0.25
18	600900	长江电力	207,751.00	0.25
19	002074	国轩高科	204,314.00	0.24
20	300068	南都电源	201,946.32	0.24

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002643	万润股份	605,901.00	0.72
2	300024	机器人	605,101.00	0.72
3	001979	招商蛇口	409,301.34	0.49
4	300359	全通教育	399,170.00	0.48
5	300187	永清环保	348,624.50	0.42
6	300244	迪安诊断	339,435.40	0.41
7	000826	启迪桑德	339,083.38	0.40
8	300014	亿纬锂能	337,638.70	0.40
9	000540	中天城投	295,443.00	0.35
10	000616	海航投资	289,602.00	0.35
11	002074	国轩高科	275,280.00	0.33
12	002503	搜于特	257,831.00	0.31
13	300457	赢合科技	248,935.00	0.30
14	300136	信维通信	212,252.00	0.25
15	600398	海澜之家	209,351.20	0.25
16	300129	泰胜风能	202,391.00	0.24
17	002053	云南盐化	196,742.00	0.23
18	600900	长江电力	192,717.00	0.23
19	000685	中山公用	192,603.08	0.23
20	300068	南都电源	188,476.85	0.23

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	17,840,297.77
卖出股票收入（成交）总额	17,878,372.13

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	12,510.58
2	应收证券清算款	506,081.03
3	应收股利	—
4	应收利息	1,618.50
5	应收申购款	4,582.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	524,792.86

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科 A	1,269,723.00	1.81	停牌

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300450	先导智能	385,662.00	0.55	停牌
2	000955	欣龙控股	342,000.00	0.49	停牌

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	3,255	19,520.31	3,290,563.0 2	5.18%	60,248,033. 19	94.82%
中欧沪 深300指 数增强 (LOF) E	29	12,957.38	122,023.00	32.47%	253,741.04	67.53%
合计	3,284	19,462.35	3,412,586.0 2	5.34%	60,501,774. 23	94.66%

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	74811	6.87%
2	陆春荣	66600	6.12%
3	徐立新	49400	4.54%
4	汪秀娣	48705	4.47%

5	任晓光	46100	4.23%
6	赵开洪	40001	3.67%
7	张学金	36312	3.33%
8	乔爱科	36300	3.33%
9	李为民	35600	3.27%
10	刘巍	35004	3.21%

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	436,570.69	0.69%
	中欧沪深300指数增强 (LOF) E	0	0.00%
	合计	436,570.69	0.68%

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	10~50
	中欧沪深300指数增强 (LOF) E	0
	合计	10~50

§ 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	64,764,801.45	253,342.11
本报告期基金总申购份额	7,707,675.17	438,418.20
减：本报告期基金总赎回份额	8,933,880.41	315,996.27
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	63,538,596.21	375,764.04

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

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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等情况

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

10.7 本期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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	15,912,994.27	44.98%	14,819.77	44.97%	
国海证券	1	9,190,094.07	25.97%	8,559.44	25.98%	
长江证券	1	4,617,754.03	13.05%	4,300.57	13.05%	
瑞银证券	1	3,490,906.70	9.87%	3,251.12	9.87%	
国都证券	2	2,169,958.11	6.13%	2,020.89	6.13%	
海通证券	1	—	—	—	—	
招商证券	1	—	—	—	—	
中金公司	1	—	—	—	—	
广发证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	
申银万国	1	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	
光大证券	1	—	—	—	—	
国金证券	1	—	—	—	—	
西部证券	1	—	—	—	—	
东方证券	1	—	—	—	—	

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

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

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2015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	2016-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	中欧基金管理有限公司督察长离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
4	中欧基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-06
5	中欧基金管理有限公司关于调整	中国证监会指定报刊及网	2016-01-06

	旗下部分基金持有“乐视网”股票估值方法的公告	站	
6	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“万科A”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-06
7	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“东华软件”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-06
8	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-01-07
9	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-20
10	中欧沪深300指数增强型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-22
11	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开通部分基金定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-22
12	中欧基金管理有限公司关于在旗下理财交易及客户服务平台开展定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-03
13	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2016年第1号)	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-06
14	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(2016年第1号)	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-06
15	中欧基金管理有限公司代行督察长公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-19
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-25

17	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增陆金所资管为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-26
18	中欧沪深300指数增强型证券投资基金 (LOF) 2015年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-29
19	中欧沪深300指数增强型证券投资基金 (LOF) 2015年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-29
20	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米财富为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-30
21	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长安汽车”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-31
22	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开通部分基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-08
23	中欧基金管理有限公司关于新增好买基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换和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	2016-04-12
24	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开展转换交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-12
25	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
26	中欧沪深300指数增强型证券投资基金 (LOF) 2016年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-21
27	中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-07
28	中欧基金管理有限公司关于新增金牛理财为旗下部分基金代销机	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-16

	构同步开通转换和定投业务的公告		
29	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金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	2016-06-17
30	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过广发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	2016-06-27

§ 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、基金托管人的办公场所。

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
二〇一六年八月二十四日