

# 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

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇一七年八月

## 重要提示

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

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

根据相关法律法规的规定及本基金《基金合同》的约定,基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,决定自 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。

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

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

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 23 日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

## 目录

第一部分基金管理人 2

第二部分基金托管人 6

第三部分相关服务机构 9

第四部分基金的名称 36

第五部分基金的类型 36

第六部分基金的投资目标 36

第七部分基金的投资范围 36

第八部分基金的投资策略 36

第九部分基金的业绩比较基准 41

第十部分基金的风险收益特征 42

第十一部分基金的投资组合报告 42

第十二部分基金的业绩 48

第十三部分基金的费用与税收 50

第十四部分对招募说明书更新部分的说明 53

## 第一部分基金管理人

### 一、基金管理人概况

1、名称：中欧基金管理有限公司

2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

3、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 5 层、上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

- 4、法定代表人：龚玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2006年7月19日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：袁维
- 13、客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.88亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；

国都证券股份有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

北京百骏投资有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%。。

上述 5 个股东共出资 18,800 万元人民币。

## 二、主要人员情况

### 1. 基金管理人董事会成员

龚玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事，天合光能有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

MarcoDEste 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credititaliano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

DavidYoungson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南佛罗里达大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

### 2. 基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

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

陆正芳女士，监事，现任中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，监事，现任中欧基金管理有限公司客户服务总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

### 3. 基金管理人高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16年以上基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，16年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，9年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

### 4. 本基金基金经理

#### (1) 现任基金经理

曲径女士，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。美国卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，10年以上证券从业经验。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（2015年5月18日起至今）、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（2016年1月13日起至今）、中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金经理（2016年12月1日起至今）。

#### (2) 历任基金经理

张大方先生，于 2011 年 9 月 1 日至 2013 年 4 月 11 日期间担任中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。

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

凌莉女士，于 2013 年 5 月 17 日至 2014 年 5 月 22 日期间担任中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。

袁争光先生，于 2013 年 4 月 11 日起至 2015 年 5 月 18 日期间担任中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。

### 5. 基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、副总经理顾伟、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲径、赵国英、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

### 6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1. 基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 8 月 22 日

注册资本：人民币 207.74 亿元

托管部门联系人：刘峰

电话：021-62677777-212017

传真：021-62159217

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持真诚服务，相伴成长的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2016 年末，兴业银行总资产达 6.09 万亿元，实现营业收入 1570.6 亿元，实现净利润 538.5 亿元。

在 2016 年英国《银行家》杂志全球银行 1000 强排名中，兴业银行按总资产排名第 33 位，按一级资本排名第 32 位；在 2016 年《财富》世界 500 强中，兴业银行排名第 195 位；在 2016 年《福布斯》全球上市企业 2000 强排名中，兴业银行位居第 59 位，稳居全球银行 50 强、全球上市企业 100 强、世界企业 500 强。品牌价值同步提升，根据英国《银行家》杂志联合世界知名品牌评估机构 BrandFinance 发布的 2017 全球银行品牌 500 强榜单，兴业银行排名第 21 位，大幅上升 15 位，品牌价值突破百亿美元达 105.67 亿美元，同比增长 63.70%。在国内外权威机构组织的评奖中，兴业银行连续六年蝉联中国银行业年度最具社会责任金融机构奖，并先后获得亚洲卓越商业银行、杰出中资银行奖、年度最佳股份制银行、卓越竞争力金融控股集团、卓越创新银行奖、年度优秀绿色金融机构、最佳责任企业等多项殊荣。

## 2、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 3、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2017 年 3 月 31 日，兴业银行已托管开放式基金 173 只，托管基金财产规模 5442.02 亿元

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

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

#### 2、内部控制组织结构

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

#### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

（6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

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

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

行问责。

#### 4、内部控制制度及措施

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

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

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

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

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

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

#### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

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

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

#### 第三部分相关服务机构

##### 一、基金份额发售机构

###### (一) 本基金 A 类份额场外发售机构

###### 1. 直销机构（A 类）

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：竇玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

###### 2. 代销机构（A 类）

1) 名称：招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

2)名称: 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人: 王洪章

联系人: 张静

电话: 010-66215533

传真: 010-66218888

客服热线: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

3)名称: 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人: 李国华

联系人: 杨娟

电话: 010-68858076

传真: 010-68858057

客服热线: 95580

网址: [www.psbc.com](http://www.psbc.com)

4)名称: 兴业银行股份有限公司

住所: 上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

办公地址: 上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人: 高建平

联系人: 李博

电话: 021-52629999-218966

客服热线: 95561

网址: [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

5)名称: 中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 董文标

联系人: 穆婷

电话: 010-57092845

传真: 010-57092611

客服热线: 95568

网站: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

6)名称: 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 常振明

联系人: 王媛

电话: 010-65556689

传真: 010-65550828

客服热线: 95558

网址: [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

7)名称: 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人: 王少华

联系人: 黄静

电话: 010-84183389

传真: 010-64482090

客服热线: 400-818-8118

网址: [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

8)名称: 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座3845层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人: 宫少林

联系人: 林生迎

电话: 0755-82960223

传真: 0755-82960141

客服热线: 95565、4008881111

网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

9)名称: 国信证券股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

联系人: 周杨

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133952

客服热线: 95536

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

10)名称: 广发证券股份有限公司

住所: 广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

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

法定代表人: 孙树明

联系人: 黄岚

电话: 020-87550265

传真: 020-87553600

网址: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

11)名称: 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址: 北京市朝阳区内大街188号

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

电话: 010-85130588

传真: 010-65182261

客服热线: 400-888-8108

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

12)名称: 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

办公地址: 福建省福州市湖东路 268 号;上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20-22 层

法定代表人: 兰荣

联系人: 夏中苏

电话: 0591-38507869

传真: 0591-38507538

客服热线: 95562c

网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

13)名称: 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系人: 刘晨

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客服热线: 95525

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

14)名称: 华福证券有限责任公司

住所: 福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址: 福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人: 黄金琳

联系人: 张腾

电话: 0591-96326

传真: 010-88085195、010-88085265-8191

客服热线: 0591-96326

网址: [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

15)名称: 中国银河证券股份有限公司

住所: 中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

办公地址: 中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

法定代表人: 陈有安

联系人: 邓颜

电话: 010-66568062

传真: 010-66568704、010-66568532、010-66568640

客服热线: 4008-888-888

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

16)名称: 中泰证券股份有限公司

住所: 山东省济南市经七路 86 号

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 66 号

法定代表人: 李玮

联系人: 马晓男

电话: 021-20315255

传真: 021-20315137

客服热线：95538

网址：<http://www.zts.com.cn>

17)名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：储晓明

联系人：黄莹

电话：4008895523

传真：021-33388224

客服热线：95523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

18)名称：申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

19)名称：海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：王立群

电话：021-23219000

传真：021-63410707、021-63410627

客服热线：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

20)名称：国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法人代表：蔡咏

联系人：李飞

电话：0551-62207323

传真：021-38670767

客服热线：95578、400-888-8777

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

21)名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

22)名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676798

传真：021-38670798

客服热线：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

23)名称：安信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人：牛冠兴

联系人：张晨

电话：021-66581727

传真：010-66581721

客服热线：4008-001-001

网址：[www.essences.com.cn](http://www.essences.com.cn)

24)名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

传真：010-63081173

客服热线：400-800-8899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

25)名称：华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服热线：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

26)名称：德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话: 021-68761616-8259

传真: 021-68761616

客服热线: 400-8888-128

网址: [www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

27)名称: 英大证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址: 广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层

法定代表人: 吴骏

联系人: 李欣

电话: 0755-83007179

传真: 0755-83007167

客服热线: 4008-698-698

网址: [www.ydsc.com.cn](http://www.ydsc.com.cn)

28)名称: 中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 侯艳红

电话: 010-60836030; 0755-23835383

传真: 010-60836031; 0755-23835525

客服热线: 95558

网址: [www.citics.com](http://www.citics.com)

29)名称: 中信证券(山东)有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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

法定代表人: 杨宝林

联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022313

传真: 0532-85022301

客服热线: 0532-96577

网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

30)名称: 中信期货有限公司

住所: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

联系人: 洪城

电话: 0755-23953913

客户热线: 400-990-8826

网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

31)名称: 爱建证券有限责任公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 郭林

联系人: 王薇

电话: 021-32229888

传真: 010-60836221

客服热线: 021-63340678

网址: [www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

32)名称: 金元证券股份有限公司

住所: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人: 陆涛

联系人: 马贤清

电话: 0755-83025500

传真: 0755-83025625

客服热线: 4008-888-228

网址: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

33)名称: 西南证券股份有限公司

住所: 重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人: 余维佳

联系人: 张煜

电话: 023-63786141

传真: 023-63786212

客服热线: 400-809-6096

网址: [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

34)名称: 联讯证券有限责任公司

住所: 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人: 徐刚

联系人: 宋航

电话: 0752-2119391

传真: 0931-4890628

网址: [www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

35)名称: 华龙证券股份有限公司

住所: 甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

办公地址: 甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

法定代表人: 李晓安

联系人: 邓鹏怡

电话: 0931-8888088

传真: 0931-4890515

客服热线: 0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址: [www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

36)名称: 国联证券股份有限公司

住所: 江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址: 无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人: 雷建辉

联系人: 沈刚

电话: 0510-82588168

客服热线: 95570

网址: [www.gjsc.com.cn](http://www.gjsc.com.cn)

37)名称: 华融证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人寿大厦 12 层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

电话: 010-85556100

传真: 010-85556153

客服热线: 400-898-9999

网址: [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

38)名称: 民族证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法人代表人: 赵大建

联系人: 李微

电话: 400-889-5618

传真: 010-66553216

客服热线: 400-889-5618

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

39)名称: 东吴证券股份有限公司

住所: 江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址: 江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人: 范力

联系人: 方晓丹

电话: 0512-62601555

传真: 0512-62938812

客服热线: 400-860-1555

网址: [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

40)名称: 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人: 丁学东

联系人: 杨涵宇

电话: 010-65051166

传真: 010-85679535

客服热线: 4009101166

公司网站: [www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

41)名称: 方正证券股份有限公司

住所: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人: 高利

联系人: 高洋

电话: 010-59355546

传真: 010-56437013

客服热线: 95571

公司网站: <http://www.foundersc.com/>

42)名称: 天相投资顾问有限公司

住所: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人: 林义相

联系人: 尹伶

电话: 010-66045152

传真: 010-66045518

客服热线: 010-66045678

网址: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

43)名称: 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人: 薛峰

联系人: 童彩平

电话: 0755-33227953

传真: 0755-82080798

客服热线: 4006-788-887

众禄基金销售网: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网: [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

44)名称: 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人: 杨文斌

联系人: 张茹

电话: 021-20613999

客服热线: 400-700-9665

网址: [www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

45)名称: 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 刘潇

电话: 021-58788678

传真: 021-58787698

客服热线: 400-089-1289

网址: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

46)名称: 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人: 王莉

联系人: 吴卫东

电话: 021-68419822

传真: 021-68419822-8566

客服热线: 400-920-0022

网址: [licaik.hexun.com](http://licaik.hexun.com)

47)名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人: 汪静波

联系人: 张姚杰

电话: 021-38602377

传真: 021-38509777

客服热线: 400-821-5399

网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

48)名称: 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 徐晔绯

电话: 0571-28829790

传真: 0571-26698533

客服热线: 4000-766-123

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

49)名称: 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座(北楼) 25 层

法定代表人: 其实

联系人: 李广宇

电话: 021-54509977-8400

传真: 021-54509953

客服热线: 400-1818-188

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

50)名称: 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人: 李晓涛

联系人: 汪林林

电话: 0571-88920810

传真: 0571-86800423

客服热线: 400-877-3772

网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

51)名称: 北京展恒基金销售股份有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366

传真：010-62020355

客服热线：400-818-8000

网址：www.myfp.cn

52)名称：上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户热线：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

53)名称：上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-33323837

客户热线：400-821-3999

网址：<https://tty.chinapnr.com>

54)名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

55)名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

56)名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

57)名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(二) 本基金 E 类份额场外发售机构

#### 1. 直销机构 (E 类)

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：竇玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

#### 2. 代销机构 (E 类)

1)名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

2)名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

客服热线：400-700-9665

网址: [www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

3)名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人: 汪静波

联系人: 张姚杰

电话: 021-38602377

传真: 021-38509777

客服热线: 400-821-5399

网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

4)名称: 上海陆金所资产管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

电话: 021-20665952

传真: 021-22066653

客户热线: 400-821-9031

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

5)名称: 上海汇付金融服务有限公司

住所: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址: 上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人: 冯修敏

联系人: 陈云卉

电话: 021-33323999

传真: 021-33323837

客户热线: 400-821-3999

网址: <https://tty.chinapnr.com>

6)名称: 珠海盈米财富管理有限公司

住所: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人: 肖雯

联系人: 黄敏嫦

电话: 020-89629099

传真: 020-89629011

客户热线: 020-89629099

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

7)名称: 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人: 钱昊旻

联系人: 孙雯

电话: 010-59336519

传真: 010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

8)名称：上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼法定代表人：李兴春联系人：徐鹏电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服热线：400-921-7755 网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

9)名称：上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

10)名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com>

11)名称：天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287984

传真：010-59287825

客服热线：400-111-0889

网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

12)名称：北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

联系人：王英俊

电话：13911468997

传真：010-92055860

客服热线：400-623-6060

网址：[www.niuiufund.com](http://www.niuiufund.com)

13)名称：上海万得投资顾问有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服热线：400-821-0203

网址：暂无

14)名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

电话：010-62676405

传真：010-62676582

客服热线：010-62675369

网址：www.xincai.com

15)名称：上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

电话：021-20538888

传真：021-20539999

客服热线：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

16)名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/4000888816

网址：http://fund.jd.com/

17)名称：上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-88066552

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

18)名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：www.hcjijin.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

### 3. 场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

#### 二、注册登记机构

本基金 A 类份额注册登记机构信息如下：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

本基金 E 类份额注册登记机构信息如下：

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：竇玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

#### 三、律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫峰

经办律师：吕红、黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

#### 四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

第四部分基金名称

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

第五部分基金类型

契约型开放式

第六部分基金的投资目标

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

第七部分基金的投资范围

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

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

第八部分基金的投资策略

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

1、资产配置策略

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

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

2、股票投资策略

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

（1）股票投资组合的构建

1）指数跟踪部分的构建策略

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

2）指数增强部分投资策略

成份股及备选成份股的增强型策略

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

由于沪深 300 指数成份股及备选成份股多为大盘蓝筹股，公司经营状况稳定，因而选择其中价值被低估的指数成份股及备选成份股进行个股增强型配置。在各行业内部根据成份股及备选成份股的价值因子的对比情况，将成份股及备选成份股分成三类价值被低估的正超额收益预期的成份股及备选成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股及备选成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股及备选成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，有限度地增加价值

被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限地减少价值被高估的成份股及备选成份股的权重。

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

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

成份股及备选成份股以外的股票增强型策略

A. 进行一级市场股票投资

本基金适当参与一级市场股票的投资，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

B. 精选具有投资潜力的股票

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

a. 行业精选

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

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

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

b. 个股精选

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

i. 历史财务数据数量选股

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

ii. 基本面选股

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

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

(2) 投资组合调整策略

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

本基金采用定期调整和不定期调整相结合的方法对投资组合进行跟踪调整。

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

2) 不定期调整：

当成份股发生增发、送配等情况而影响其在指数中权重时，本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定

及其需调整的权重比例，进行相应调整；

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

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

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

### 3、跟踪误差调整策略

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

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

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

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

(1)确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；

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

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

### 4、债券投资策略

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

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

### 第九部分基金的业绩比较基准

本基金采用股票加现金的混合形式作为业绩比较基准，其中股票部分比较基准采用沪深 300 指数收益率，现金部分比较基准采用税后银行活期存款利率。本基金定位为指数增强型基金，以股票投资为主，因此本基金的业绩比较基准具体如下：

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）

沪深 300 指数在 2005 年由中证指数有限公司编制，该公司是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同出资发起设立的一家专业从事证券指数及指数衍生产品开发服务的公司。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，其样本股票经过流动性和财务稳定性的筛选，对沪深两市的覆盖率很高，并且不易被人为操纵，能较全面地描述 A 股市场的总体趋势，具有很强的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，采用了国际通用的自由流通量计算单只股票的权重，能更准确反映二级市场实际状况。同时，中证指数公司会根据具体情况的变化不定期的对指数样本和权重进行调整来更准确地反映市场状况。

### 第十部分基金的风险收益特征

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

### 第十一部分基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

本投资组合报告所载数据取自本基金 2017 年第 1 季度报告，所载数据截至 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1 报告期末基金资产组合情况

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 63,436,942.88 93.19

其中：股票 63,436,942.88 93.19

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 4,614,177.78 6.78

8 其他资产 24,191.14 0.04

9 合计 68,075,311.80 100.00

#### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 2.1.1 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 55,407.00 0.08

B 采矿业 2,092,815.77 3.10

C 制造业 21,482,226.72 31.80

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 2,236,473.40 3.31

E 建筑业 2,617,351.90 3.87

F 批发和零售业 1,421,979.21 2.10

G 交通运输、仓储和邮政业 1,874,651.60 2.78

H 住宿和餐饮业 — —

I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,281,751.55 4.86

J 金融业 20,401,144.76 30.20

K 房地产业 3,191,243.59 4.72

L 租赁和商务服务业 649,746.33 0.96

M 科学研究和技术服务业 — —

N 水利、环境和公共设施管理业 503,677.91 0.75

O 居民服务、修理和其他服务业 — —

P 教育 — —

Q 卫生和社会工作 86,125.27 0.13

R 文化、体育和娱乐业 719,560.76 1.07

S 综合 235,026.90 0.35

合计 60,849,182.67 90.08

## 2.1.2 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	2,587,760.21	3.83
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E 建筑业	—	—
F 批发和零售业	—	—
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J 金融业	—	—
K 房地产业	—	—
L 租赁和商务服务业	—	—
M 科学研究和技术服务业	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—
O 居民服务、修理和其他服务业	—	—
P 教育	—	—
Q 卫生和社会工作	—	—
R 文化、体育和娱乐业	—	—
S 综合	—	—
合计	2,587,760.21	3.83

## 2.2 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。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值 占基金资产净值比例（%）

1	601318	中国平安	68,746	2,544,289.46	3.77
2	600016	民生银行	259,135	2,197,464.80	3.25
3	600036	招商银行	102,951	1,973,570.67	2.92
4	600519	贵州茅台	3,453	1,334,101.08	1.97
5	000002	万科A	59,165	1,217,615.70	1.80
6	000651	格力电器	35,776	1,134,099.20	1.68
7	600000	浦发银行	68,612	1,098,478.12	1.63
8	601328	交通银行	149,993	934,456.39	1.38
9	601668	中国建筑	95,128	875,177.60	1.30
10	600030	中信证券	50,516	813,812.76	1.20

### 3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002206	海利得	29,500	596,195.00	0.88
2	600835	上海机电	25,000	540,750.00	0.80

3 000858 五粮液 9,600 412,800.00 0.61

4 600110 诺德股份 30,000 404,100.00 0.60

5 600660 福耀玻璃 13,403 303,041.83 0.45

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 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。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 10.1 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。

##### 10.2 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。

##### 10.3 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。

#### 11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

##### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 4,204.15

2 应收证券清算款 13,609.47

3 应收股利 —

4 应收利息 1,714.19

5 应收申购款 4,663.33

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 24,191.14

##### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 11.5.1 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。

#### 11.5.2 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。

#### 11.6 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。

#### 第十二部分基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日 2010 年 6 月 24 日，基金业绩截止日 2017 年 3 月 31 日。

#### 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 A (LOF)

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2010.6.24-2010.12.31 4.93% 1.07% 12.83% 1.51% -7.90% -0.44%

2011.1.1-2011.12.31 -22.95% 1.21% -23.83% 1.23% 0.88% -0.02%

2012.1.1-2012.12.31 6.57% 1.22% 7.29% 1.22% -0.72% 0.00%

2013.1.1-2013.12.31 -4.69% 1.31% -7.16% 1.32% 2.47% -0.01%

2014.1.1-2014.12.31 51.46% 1.11% 48.69% 1.15% 2.77% -0.04%

2015.1.1-2015.12.31 7.82% 2.39% 5.70% 2.36% 2.12% 0.03%

2016.1.1-2016.12.31 -8.78% 1.39% -10.63% 1.33% 1.85% 0.06%

2017.1.1-2017.3.31 4.17% 0.49% 4.19% 0.49% -0.02% 0.00%

2010.6.24-2017.3.31 27.43% 1.45% 25.23% 1.47% 2.20% -0.02%

##### 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 E (LOF)

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015.10.12-2015.12.31 11.74% 1.59% 11.13% 1.58% 0.61% 0.01%

2016.1.1-2016.12.31 -8.63% 1.38% -10.63% 1.33% 2.00% 0.05%

2017.1.1-2017.3.31 4.22% 0.49% 4.19% 0.49% 0.03% 0.00%

2015.10.12-2017.3.31 6.41% 1.3200% 3.49% 1.28% 2.92% 0.04%

#### 2、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

##### 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 A (LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 06 月 24 日-2017 年 3 月 31 日)

##### 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金 E (LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 10 月 12 日-2017 年 3 月 31 日)

注：自 2015 年 10 月 8 日起，本基金增加 E 类份额。图示日期为 2015 年 10 月 12 日至 2016 年 9 月 30 日。

数据来源：中欧基金中证指数

#### 第十三部分基金的费用与税收

##### 一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金财产划拨支付的银行费用；

4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用；

8、基金上市费；

9、指数许可使用费用；

10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起

3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起

3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、指数许可使用费用

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

计算方法如下：

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

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。

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

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

## 三、不列入基金费用的项目

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

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

## 五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资

经营活动，对本基金管理人于 2017 年 1 月刊登的《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（第 2017 年第 1 号）》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）重要提示部分

更新了本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 23 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。的描述。

（二）第三部分基金管理人部分

更新了基金管理人董事会成员、监事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理和公司投资决策委员会成员的信息。

（三）第四部分基金托管人部分

更新了基金托管人的相关信息。

（四）第五部分相关服务机构部分

1、更新了代销机构的相关信息。

2、更新了会计师事务所的相关信息。

（五）第十二部分基金的投资部分

更新了十一、基金投资组合报告的内容，数据截至 2017 年 3 月 31 日。

（六）第十三部分基金的业绩部分

更新了整章的信息，包括本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较和基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图，数据截至 2017 年 3 月 31 日。

（七）第二十五部分其他应披露事项部分

更新了自 2016 年 12 月 24 日至 2017 年 6 月 23 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

以下为本基金管理人自 2016 年 12 月 24 日至 2017 年 6 月 23 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 披露日期

- 1 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与邮储银行申购费率优惠活动的公告 2016-12-29
- 2 中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告 2017-01-01
- 3 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有国电南瑞股票估值方法的公告 2017-01-14
- 4 中欧基金管理有限公司关于新增京东金融-北京肯特瑞财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的的公告 2017-01-17
- 5 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2016 年第 4 季度报告 2017-01-20
- 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（2017 年第 1 号） 2017-02-06
- 7 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（2017 年第 1 号） 2017-02-06
- 8 中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型的公告 2017-02-11
- 9 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有宝钢股份股票估值方法的公告 2017-02-15
- 10 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过同花顺代销基金定投最低申购金额的公告 2017-02-16
- 11 中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告 2017-02-22
- 12 中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告 2017-03-02
- 13 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国信证券代销基金定投最低申购金额的公告 2017-03-28
- 14 中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告 2017-03-30
- 15 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的申购费率优惠活动的公告 2017-03-30
- 16 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2016 半年度报告 2017-03-31
- 17 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2016 半年度报告摘要 2017-03-31
- 18 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通转换和定投业务并参与费率优惠的公告 2017-04-14
- 19 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）2017 年 1 季度报告 2017-04-21

20 中欧基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下部分基金代销机构的公告 2017-04-24

21 中欧基金管理有限公司关于新增方正证券为旗下部分基金代销机构的公告 2017-05-12

22 中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换与定投业务并参与费率优惠活动的公告  
2017-05-16

中欧基金管理有限公司

2017年8月7日