

中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

2016年第3季度报告

2016年09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

报告送出日期：2016年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年7月1日起至2016年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）
场内简称	中欧300
基金主代码	166007
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2010年06月24日
报告期末基金份额总额	59,809,591.85份
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中欧沪深300指数增强（LOF）A	中欧沪深300指数增强（LOF）E
下属分级基金的场内简称	中欧300	-
下属分级基金的交易代码	166007	001884
报告期末下属分级基金的份额总额	59,222,763.92份	586,827.93份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年07月01日-2016年09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
1.本期已实现收益	1,520,328.25	10,557.45
2.本期利润	3,698,551.53	18,202.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0607	0.0416
4.期末基金资产净值	68,603,114.22	680,206.86
5.期末基金份额净值	1.1584	1.1591

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.所述基金业绩指标不包括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 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（LOF）A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.29%	0.76%	3.00%	0.76%	2.29%	0.00%

中欧沪深300指数增强（LOF）E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.30%	0.76%	3.00%	0.76%	2.30%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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指数增强型证券投资基金A（LOF）
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9月30日）



中欧沪深300指数增强型证券投资基金E（LOF）
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9月30日）



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

4.3 公平交易专项说明

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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度市场经历了A股市场经历了熔断暴跌，底部振荡，和小幅反弹三个阶段；二季度大盘筑底企稳，整体波动率明显下降，不同行业收益分化较大，业绩好成长性预期强的行业，如新能源车产业链等板块有结构化行情；三季度，市场整体波动率又创新低，市场的预期风险不高，同时成长股业绩普遍超预期，业绩驱动的行情有利于量化方法甄选个股。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。

4.5 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5.29%，同期业绩比较基准收益率为3.00%；E类份额净值增长率为5.30%，同期业绩比较基准收益率为3.00%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	64,622,318.38	92.54
	其中：股票	64,622,318.38	92.54
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	5,025,773.06	7.20
8	其他资产	187,118.23	0.27
9	合计	69,835,209.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 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	48,557.00	0.07
B	采矿业	1,995,478.55	2.88
C	制造业	19,499,909.85	28.15

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,198,928.29	3.17
E	建筑业	2,001,001.39	2.89
F	批发和零售业	1,359,233.47	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,755,799.51	2.53
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,684,984.59	5.32
J	金融业	20,955,467.40	30.25
K	房地产业	3,699,129.83	5.34
L	租赁和商务服务业	674,327.16	0.97
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	465,017.90	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	99,601.04	0.14
R	文化、体育和娱乐业	827,560.56	1.19
S	综合	264,935.60	0.38
	合计	59,529,932.14	85.92

5.2.1.2 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	2,396,234.49	3.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	561,349.18	0.81
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	932,497.75	1.35
J	金融业	27,701.82	0.04
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	342,900.00	0.49
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	831,703.00	1.20
S	综合	—	—
	合计	5,092,386.24	7.35

5.2.2 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。

5.3 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

5.3.1 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	600016	民生银行	272,335	2,521,822.10	3.64
2	601318	中国平安	72,246	2,467,923.36	3.56
3	600036	招商银行	108,151	1,946,718.00	2.81
4	000002	万科A	62,065	1,624,241.05	2.34
5	600000	浦发银行	72,112	1,189,126.88	1.72
6	600519	贵州茅台	3,553	1,058,474.23	1.53
7	601328	交通银行	157,393	870,383.29	1.26

8	600837	海通证券	54,110	860,890.10	1.24
9	600030	中信证券	52,916	853,005.92	1.23
10	601288	农业银行	254,082	795,276.66	1.15

5.3.2 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	300036	超图软件	44,800	895,552.00	1.29
2	300301	长方集团	70,500	606,300.00	0.88
3	600491	龙元建设	43,400	549,010.00	0.79
4	600373	中文传媒	17,900	418,323.00	0.60
5	600136	当代明诚	22,000	413,380.00	0.60

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,544.80
2	应收证券清算款	171,026.16
3	应收股利	—
4	应收利息	2,144.57
5	应收申购款	3,402.70
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	187,118.23

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600136	当代明诚	413,380.00	0.60	停牌

5.11.6 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。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	63,538,596.21	375,764.04
报告期期间基金总申购份额	1,017,690.63	250,286.91
减：报告期期间基金总赎回份额	5,333,522.92	39,223.02
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	59,222,763.92	586,827.93

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额		122,023.00
报告期期间买入/申购总份额		
报告期期间卖出/赎回总份额		

报告期期末管理人持有的本基金份额		122,023.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	—	20.79

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回及买卖本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 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
二〇一六年十月二十六日