

## 中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

## [2014]第一季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司  
基金托管人:广发银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月19日  
§ 1 重要提示

基金管理人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。  
基金业协会承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。

本基金合同日期为2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)场内简称:中欧300

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:2010/6/12/24

报告期末基金份额总额:189,916,744.8份

基金类型:股票型

基金目标:本基金以沪深300指数为基准进行积极的被动管理，在对标的指数有有效跟踪的前提下，力求长期超越沪深300指数，力争基金净值增长率每年平均增长率为5%，并在此基础上获取超额收益。

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，在拟合指数投资的基础上，通过量化分析和对市场环境的深入研究，精选出具有明显超额收益潜力的股票进行投资，从而在控制风险的前提下，力求获得超越标的指数的回报。

业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+5%×银行存款利率(税后)

风险收益特征:本基金是一只指数增强型基金，其预期风险与收益高于沪深300指数基金，债券型基金及货币市场基金。

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

§ 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(2014年1月1日-2014年3月31日)

1.本期已实现收益 1,056,652.33

2.本期利润 -7,907,116.68

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0429

4.期末基金份额净值 134,932,658.79

5.期末基金资产净值 189,930,707.69

注:1.本期业绩指标根据报告期初的基金份额总数计算。  
2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
3.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。

3.2 本报告期内基金的净份额增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -5.46% 1.10% -7.48% 1.13% 2.02% -0.03%

3.2.1 本报告期内基金的净份额增长率大小排序的前十名股票投资明细

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 中国银行 845,180 6,474,078.80 4.80

2 601318 中国平安 109,959 4,130,660.13 3.06

3 600036 中国远洋 379,127 3,723,071.14 2.76

4 600000 浦发银行 257,056 2,498,584.32 1.85

5 000002 万科A 22,291 1,798,334.19 1.33

6 600637 高通股份 188,848 1,717,235.52 1.27

7 600030 中信银行 150,248 1,666,351.44 1.23

8 000051 中国平安 55,260 1,547,280.00 1.15

9 600619 中国石化 754,638 1,475,838.00 1.09

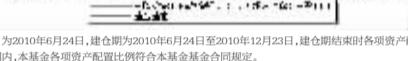
10 601328 交通银行 396,635 1,443,856.70 1.07

3.2.2 本基金管理人声明以下基金的净份额增长率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(LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年6月24日至2014年3月31日)



注:本基金合同生效日为2010年6月24日,建仓期为2010年6月24日至2010年12月31日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的规定。

4. 管理人报告

4.1 基金经理(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

凌莉 本基金基金经理 2013年5月17日 - 6年 金融硕士,于2008年1月加入中欧基金管理有限公司,历任研究员、基金经理、金融工程研究员兼基金经理助理,现任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。凌莉女士拥有丰富的金融行业经验,具备良好的职业操守,勤勉尽责,敢于担当,相信她的管理能力能够得到投资者的认可。

黄争光 本基金基金经理 2013年4月11日 - 8年 金融学硕士,于2009年6月加入中欧基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,现任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。黄争光先生拥有丰富的金融行业经验,具备良好的职业操守,勤勉尽责,敢于担当,相信他的管理能力能够得到投资者的认可。

注:1.任职日期和离任日期一般情况由公司作出决定之日;若基金经理自基金合同生效日起即担任基金经理,则任职日期为基金合同生效之日起即担任基金经理。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本报告期内,基金管理人所管理的所有开放式基金不参与公平交易和平等交易。

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,基金管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度的规定,公平对待所管理的不同基金财产,不存在利用旗下管理的两只基金进行不公平交易的情况。

4.3.2 公平交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人所管理的所有开放式基金不参与公平交易和平等交易。

4.4 报告期内基金的投资组合分析

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度的规定,公平对待所管理的不同基金财产,不存在利用旗下管理的两只基金进行不公平交易的情况。

4.5 投资组合报告

本基金报告期内,基金资产净值增长率为-5.46%,期间业绩比较基准增长率为-7.48%,基金投资收益高于同行业绩比较基准。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 123,445,713.00 91.14

其中:股票 123,445,713.00 91.14

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

4 货币市场工具 - -

5 其他资产 - -

6 其他应收款 - -

7 衍生工具 - -

8 银行存款和结算备付金合计 6,967,446.83 5.14

9 其他资产 5,027,270.22 3.71

9. 合计 135,440,000.57 100.00

5.2 报告期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股票投资组合

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.40 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.41 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.44 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.45 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.46 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.47 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.48 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.49 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.50 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.51 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.52 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.53 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.54 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.55 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.56 报告期末按行业分类的股票投资组合