

## 中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

[2014] 第四季度报告

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:2015年1月20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。  
基金托管人保证复核报告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并保证基金净值计算的准确性。  
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。  
本基金客户服务电话:021-69909700,400-700-9700  
本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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)

场内简称:中欧沪深300

交易代码:166008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年1月26日

报告期末基金资产净值:26,269,910,932.00

报告期末基金份额总额:26,269,910,932.00

投资目标:本基金通过投资于沪深300指数成份股为基金资产组合的标的指数,在对标的指数有跟踪的被动投资策略的基础上,通过积极的股票投资,力争在扣除基金的管理费和基金资产的折算费后,实现基金资产的增值。

投资策略:本基金在严格控制风险的前提下,通过积极的股票投资,力求在扣除基金的管理费和基金资产的折算费后,实现基金资产的增值。

业绩比较基准:60%×深证综合指数+40%×沪深300指数

风险收益特征:本基金是一般风险级别的股票型基金,属于股票型基金中风险较高的品种。

基金经理:张勇

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

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2014年10月01日-2014年12月31日) 单位:人民币元

1本期已实现收益 1,196,721.00

2本期利润 57,419,903.75

3期初现金及现金等价物余额 1,036,419.00

4期末现金及现金等价物余额 316,966,920.15

5期末可供分配基金份额总额 1,019,400.00

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)扣除费用后的余额,本期利润为本期实现的收益加上本期公允价值变动收益。  
2.所列数据不包括持有人认购或交易基金所产生的费用,但包括持有人认购或交易基金时支付的申购费或赎回费。  
3.本基金的现金分红在投资者赎回时收取。

3.2 基金的现金分红

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

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 -40.11% 15.1% 41.63% 1.56% -1.52% -0.05%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计份额增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
累计的净值增长率与同期基准收益率的历史走势对比图  
(2010年1月26日-2014年12月31日)

3.3 期末基金资产组合情况

投资组合比例

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 1,634,534 16,695,729.92 6.27

2 601318 中国平安 165,573 12,369,968.30 3.00

3 600036 中国银行 571,051 9,473,376.09 2.59

4 600030 中信证券 272,216 9,228,122.40 2.91

5 600037 交通银行 270,910 6,734,634.60 2.12

6 600000 沪农银行 387,138 6,074,196.22 1.92

7 000002 万科A 336,665 4,665,743.50 1.47

8 601668 中国建筑 510,028 3,778,523.84 1.19

9 601328 兴业银行 543,193 3,693,712.40 1.17

10 601601 中国太保 108,740 3,512,302.00 1.11

3.2.3 期末按行业分类的股票投资组合

序号 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 矿采业 - -

C 制造业 1,741,705.80 0.65

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发零售业 - -

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 1,044,490.88 0.33

K 房地产业 1,653,475.75 0.49

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 4,329,672.43 1.37

3.2.4 期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 国债 - -

B 地方债 - -

C 企业债 - -

D 资产支持证券 - -

E 融券 - -

F 货币市场基金 - -

G 可转债 - -

H 其他 - -

合计 - -

3.2.5 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

序号 代码 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 1,634,534 16,695,729.92 6.27

2 601318 中国平安 165,573 12,369,968.30 3.00

3 600036 中国银行 571,051 9,473,376.09 2.59

4 600030 中信证券 272,216 9,228,122.40 2.91

5 600037 交通银行 270,910 6,734,634.60 2.12

6 600000 沪农银行 387,138 6,074,196.22 1.92

7 000002 万科A 336,665 4,665,743.50 1.47

8 601668 中国建筑 510,028 3,778,523.84 1.19

9 601328 兴业银行 543,193 3,693,712.40 1.17

10 601601 中国太保 108,740 3,512,302.00 1.11

3.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资组合

序号 代码 名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120800 沃尔转债 242 20,947.02 0.01

2 - - -

3 - - -

4 - - -

5 - - -

6 - - -

7 - - -

8 - - -

9 - - -

10 - - -

11 - - -

12 - - -

13 - - -

14 - - -

15 - - -

16 - - -

17 - - -

18 - - -

19 - - -

20 - - -

21 - - -

22 - - -

23 - - -

24 - - -

25 - - -

26 - - -

27 - - -

28 - - -

29 - - -

30 - - -

31 - - -

32 - - -

33 - - -

34 - - -

35 - - -

36 - - -

37 - - -

38 - - -

39 - - -

40 - - -

41 - - -

42 - - -

43 - - -

44 - - -

45 - - -

46 - - -

47 - - -

48 - - -

49 - - -

50 - - -

51 - - -

52 - - -

53 - - -

54 - - -

55 - - -

56 - - -

57 - - -

58 - - -

59 - - -

60 - - -

61 - - -