

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

[2014] 年 度 报 告 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
送出日期:2015年3月27日

\$重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及其他从事本基金相关工作的人员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。本年度报告已经本基金托管人书面确认。

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未来的业绩表现。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摘要并审慎决策，因基金费用而产生的损失由基金份额持有人承担。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。\$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(LOF)

基金简称 中欧300

基金代码 166007

基金合同生效日 2010年6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 268,269,910.92

报告期末基金份额净值 不定期

报告期末持有的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2010-08-16

2.2 基金产品说明

本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪标的指数，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

长率与行业比较基准之间的日平均误差不超过0.6%，行业跟踪误差不超过

7.75%，以实现对标的指数的投资收益和基准收益的长期增值。

本基金将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

对投资组合进行动态优化，在控制与收益比较基准的风险的前提下，

力求取得超越标的指数的长期收益。

本基金是一只指数增强型基金，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

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

信批负责人 姚海红

联系电话 021-68690900

电子邮箱 jlyh@zifufund.com

客户服务电话 021-68697000-400-700-9700

传真 021-33803051

021-62159217

2.4 风险提示

本基金为股票型基金，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市

场基金。

2.5 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1 累计数据和指标

2014年 2013年 2012年

本期已实现收益 -700,450.39 -3,830,411.38 -15,420,638.03

本期利润 67,626,363.98 -6,600,946.60 12,278,681.47

年初至今基金利润 0.3037 -0.0326 0.0519

本期基金份额净值增长 51.46% -4.69% 6.57%

3.2 累计数据和指标

2014年末 2013年末 2012年末

期末基金资产净值 316,966,820.15 147,288,448.73 188,932,899.69

期末基金份额净值 1.1949 0.7889 0.8277

注:1.本期实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和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.期初未分配利润采用资产负债表日分配比例计算的期末未分配利润在本期利润中体现，具体比例见“附注四、5 所述的利润分配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.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 份额净值 基金份额净值增长率

份额净值增长率

份额净值增长率