中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2017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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧滚钱宝货币		
基金主代码	001211		
基金运作方式	契约型、开放式、发起式		
基金合同生效日	2015年06月12日		
报告期末基金份额总额	5,786,672,440.28份		
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的稳定收益。		
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制利率风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。		
业绩比较基准	同期7天通知存款税后利率		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
下属分级基金的交易代码	001211	004938	004939
报告期末下属分级基金的份额总额	4,820,169,468.44	700,877,509.49	265,625,462.35

注:自2017年7月12日起,本基金增加B类、C类份额,登记机构为中欧基金管理有限公司,原基金份额更名为A类份额。

§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(2017年07月01日-2017年09月30日)	报告期(2017年07月12日-2017年09月30日)	报告期(2017年07月12日-2017年09月30日)
	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
1.本期已实现收益	49,004,735.70	3,377,509.49	1,302,316.87
2.本期利润	49,004,735.70	3,377,509.49	1,302,316.87
3.期末基金资产净值	4,820,169,468.44	700,877,509.49	265,625,462.35

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
2、本基金自2017年7月12日起增加B类、C类份额,增加份额当期的相关数据和指标以实际存续期计算,下同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、中欧滚钱宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0197%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.6794%	0.0011%

2、中欧滚钱宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
自基金份额起始运作日起至今	0.9349%	0.0012%	0.2959%	0.0000%	0.6390%	0.0012%

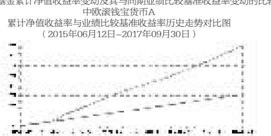
3、中欧滚钱宝货币C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
自基金份额起始运作日起至今	0.8731%	0.0013%	0.2922%	0.0000%	0.5809%	0.0013%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

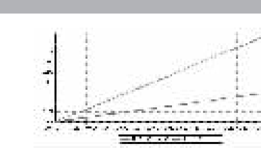
中欧滚钱宝货币A
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年06月12日-2017年09月30日)



中欧滚钱宝货币B
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年07月13日-2017年09月30日)

注:自2017年7月13日起,本基金增加B份额。图示日期为2017年7月13日至2017年9月30日。

中欧滚钱宝货币C
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年07月14日-2017年09月30日)



注:自2017年7月13日起,本基金增加C份额。图示日期为2017年7月14日至2017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		
黄华	资产配置总监、基金经理	2017年03月24日	–	9年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理,中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理,中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016年11月10日加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司基金经理助理

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遵规守信情况的说明

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

2017年三季度,国内经济整体运行大体平稳,供给端和需求端各项数据虽然略有放缓,但前瞻性指标显示后期增长动力尚未趋弱。通胀水平稳中趋升,工业品价格有再次抬头的迹象,但整体可控。金融监管大方向未变,但货币政策和监管政策更注重协调。央行操作更注重"削峰填谷",灵活运用多种流动性管理工具。

具体来看,经济运行方面,从生产端来看,工业增加值三季度略有下滑,但粗钢产量增速和耗煤量同比增长仍然稳定在偏高水平。从需求端来看,投资增速和上半年相比略有放缓。地产投资、基建投资和制造业投资增速都出现了不同程度的下滑。同时,私人部门的民间投资增速也略有放缓。从前瞻性指标来看,三季度PMI稳定在荣枯线之上,体现了经济后期增长动力尚未趋弱。三季度通胀水平稳中趋升,尽管工业品价格有再次抬头的迹象,但整体可控,核心CPI平稳运行。

货币政策方面,央行延续中性稳健的态度,维持流动性中性适度,操作更注重"削峰填谷",灵活运用多种流动性管理工具。但由于三季度银行超储水平偏低,在缴税、缴准、政府债务大量发行等时点,虽然央行在公开市场上有所对冲,但资金利率明显冲高。银行体系在MPA考核的时点也略有谨慎,整体融出偏少。叠加9月份《流动性管理新规》的影响,流动性出现断层,非银机构资金成本高企。

在债券市场运行方面,市场聚焦在基本面的变化、货币政策和资金面上。三季度银行间市场加权回购利率水平提升,债券收益率有所上行。2017年三季度,货币基金在兼顾流动性、控制风险的同时,以提高收益为主要目标,在月末、季末和缴税、缴准等关键时间点加大配置力度,重点配置存款和存单,并适度拉长剩余期限。基金在日常操作中维持偏低杠杆水平,中等偏低的剩余期限。在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值收益率为1.0197%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,B类份额净值收益率为0.9349%,同期业绩比较基准收益率为0.2959%,C类份额净值收益率为0.8731%,同期业绩比较基准收益率为0.2922%。

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	固定收益投资	2,582,258,166.63	44.60
	其中:债券	2,510,518,166.63	43.36
	资产支持证券	71,740,000.00	1.24
2	买入返售金融资产	1,117,960,461.45	19.31
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	2,071,144,173.08	35.77
4	其他资产	18,451,960.62	0.32
5	合计	5,789,814,761.78	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	–	4.40
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	18.56	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	20.65	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	44.16	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	7.88	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	8.48	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	99.74	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	329,879,372.29	5.70
	其中:政策性金融债	329,879,372.29	5.70
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	2,180,638,794.34	37.68
8	其他	–	–
9	合计	2,510,518,166.63	43.38
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111720214	17广发银行CD214	4,000,000	396,105,398.13	6.85
2	111707249	17招商银行CD249	2,000,000	198,067,127.16	3.42
3	111710362	17兴业银行CD362	2,000,000	197,412,792.12	3.41
4	170204	17国开04	1,200,000	119,750,313.47	2.07
5	111782322	17宁波银行CD149	1,000,000	99,557,400.50	1.72
6	111720167	17广发银行CD167	1,000,000	99,539,549.79	1.72
7	111712174	17北京银行CD174	1,000,000	99,521,600.03	1.72
8	111782574	17贵阳银行CD094	1,000,000	99,519,456.22	1.72
9	111709334	17浦发银行CD334	1,000,000	99,473,886.09	1.72
10	111707210	17招商银行CD210	1,000,000	99,461,961.18	1.72

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0405%
报告期内偏离度的最低值	-0.0180%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0162%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789045	17上和1A1	2,000,000	71,740,000.00	1.24

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

5.9.2 本基金前十大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。

5.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	18,451,960.62
4	应收申购款	
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	18,451,960.62

5.9.4 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

	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
报告期期初基金份额总额	4,357,442,965.19	–	–
报告期期间基金总申购份额	10,515,763,434.81	700,877,509.49	1,071,374,616.21
减:报告期期间基金总赎回份额	10,053,036,931.56	–	805,749,153.86
报告期期末基金份额总额	4,820,169,468.44	700,877,509.49	265,625,462.35

注:总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年07月03日	60,268.13	60,268.13	–
2	申赎	2017年07月03日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	–
3	红利再投	2017年07月04日	18,582.71	18,582.71	–
4	红利再投	2017年07月05日	18,762.19	18,762.19	–
5	红利再投	2017年07月06日	18,300.96	18,300.96	–
6	红利再投	2017年07月07日	17,917.21	17,917.21	–
7	红利再投	2017年07月10日	51,859.65	51,859.65	–
8	红利再投	2017年07月11日	16,743.02	16,743.02	–
9	红利再投	2017年07月12日	16,289.07	16,289.07	–
10	红利再投	2017年07月13日	15,463.94	15,463.94	–
11	红利再投	2017年07月14日	15,613.67	15,613.67	–
12	红利再投	2017年07月17日	46,932.72	46,932.72	–
13	红利再投	2017年07月18日	15,764.11	15,764.11	–
14	红利再投	2017年07月19日	16,041.98	16,041.98	–
15	红利再投	2017年07月20日	16,232.78	16,232.78	–
16	红利再投	2017年07月21日	16,570.81	16,570.81	–
17	红利再投	2017年07月24日	49,624.94	49,624.94	–
18	红利再投	2017年07月25日	16,475.25	16,475.25	–
19	红利再投	2017年07月26日	16,632.35	16,632.35	–
20	红利再投	2017年07月27日	19,430.78	19,430.78	–
21	红利再投	2017年07月28日	16,709.95	16,709.95	–
22	红利再投	2017年07月31日	50,476.36	50,476.36	–
23	红利再投	2017年08月01日	16,946.27	16,946.27	–
24	红利再投	2017年08月02日	16,852.40	16,852.40	–
25	红利再投	2017年08月03日	17,115.70	17,115.70	–
26	红利再投	2017年08月04日	17,080.47	17,080.47	–
27	红利再投	2017年08月07日	51,105.17	51,105.17	–
28	红利再投	2017年08月08日	16,891.14	16,891.14	–
29	红利再投	2017年08月09日	16,761.84	16,761.84	–
30	红利再投	2017年08月10日	16,576.46	16,576.46	–
31	红利再投	2017年08月11日	16,650.80	16,650.80	–
32	红利再投	2017年08月14日	50,605.49	50,605.49	–
33	红利再投	2017年08月15日	16,871.72	16,871.72	–
34	红利再投	2017年08月16日	16,363.12	16,363.12	–
35	红利再投	2017年08月17日	16,347.87	16,347.87	–
36	红利再投	2017年08月18日	16,535.18	16,535.18	–
37	红利再投	2017年08月21日	50,052.10	50,052.10	–
38	红利再投	2017年08月22日	16,638.93	16,638.93	–
39	红利再投	2017年08月23日	16,053.56	16,053.56	–
40	红利再投	2017年08月24日	15,893.91	15,893.91	–
41	红利再投	2017年08月25日	16,246.56	16,246.56	–
42	红利再投	2017年08月28日	59,051.13	59,051.13	–
43	红利再投	2017年08月29日	18,468.11	18,468.11	–
44	红利再投	2017年08月30日	16,322.80	16,322.80	–
45	红利再投	2017年08月31日	16,099.51	16,099.51	–
46	红利再投	2017年09月01日	25,890.21	25,890.21	–
47	红利再投	2017年09月04日	58,188.14	58,188.14	–
48	红利再投	2017年09月05日	16,654.90	16,654.90	–
49	红利再投	2017年09月06日	16,616.20	16,616.20	–
50	红利再投	2017年09月07日	16,397.76	16,397.76	–
51	红利再投	2017年09月08日	16,130.70	16,130.70	–
52	红利再投	2017年09月11日	48,514.22	48,514.22	–
53	红利再投	2017年09月12日	16,275.01	16,275.01	–
54	红利再投	2017年09月13日	16,259.65	16,259.65	–
55	红利再投	2017年09月14日	16,486.28	16,486.28	–
56	红利再投	2017年09月15日	16,614.34	16,614.34	–
57	红利再投	2017年09月18日	49,575.29	49,575.29	–
58	红利再投	2017年09月19日	16,772.31	16,772.31	–
59	红利再投	2017年09月20日	16,526.17	16,526.17	–
60	红利再投	2017年09月21日	16,873.79	16,873.79	–
61	红利再投	2017年09月22日	17,146.42	17,146.42	–
62	红利再投	2017年09月25日	52,047.92	52,047.92	–
63	红利再投	2017年09月26日	16,774.67	16,774.67	–
64	申赎	2017年09月26日	-30,000,000.00	-30,000,000.00	–
65	红利再投	2017年09月27日	15,071.09	15,071.09	–
66	红利再投	2017年09月28日	13,559.23	13,559.23	–
67	红利再投	2017年09月29日	13,420.78	13,420.78	–
合计			-43,449,982.10	-43,449,982.10	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	125,565,103.82	2.17%	10,000,000.00	0.17%	三年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	
基金经理等人员	–	–	–	–	
基金管理人股东	–	–	–	–	
其他	–	–	–	–	
合计	125,565,103.82	2.17%	10,000,000.00	0.17%	三年

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中欧滚钱宝发起式货币市场基金相关批准文件
2、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》
3、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金托管协议》
4、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金招募说明书》
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
9.2 存放地点
基金管理人的办公场所。
9.3 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
二〇一七年十月二十六日

中欧消费主题股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月28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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧消费主题股票	
基金主代码	002621	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年07月22日	
报告期末基金份额总额	75,066,972.82份	
投资目标	本基金主要投资于消费主题相关的具有持续增长潜力的优质上市公司,在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金持续跟踪宏观经济面、政策面等重要指标,进行自上而下宏观分析,并有机结合市场环境趋势分析,综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产的大类资产配置比例。本基金为股票型基金,长期来看整体将积极配置于股票类资产,并根据市场环境动态调整。	
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于较高预期收益风险水平的投资品种。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧消费主题股票A	中欧消费主题股票C
下属分级基金的交易代码	002621	002697
报告期末下属分级基金的份额总额	71,530,524.21份	3,536,448.61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(2017年07月01日-2017年09月30日)	
	中欧消费主题股票A	中欧消费主题股票C
1.本期已实现收益	13,633,893.74	536,002.14
2.本期利润	4,856,777.02	240,268.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0442	0.0569
4.期末基金资产净值	82,063,643.45	4,070,863.35
5.期末基金份额净值	1.147	1.151

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

中欧消费主题股票A

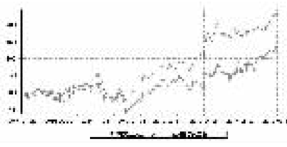
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.84%	3.77%	0.68%	2.34%	0.16%

中欧消费主题股票C

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	5.99%	0.83%	3.77%	0.68%	2.22%	0.15%

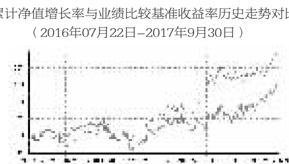
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧消费主题股票A
基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月22日-2017年9月30日)



注:本基金基金合同生效日期为2016年7月22日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

中欧消费主题股票C
基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月22日-2017年9月30日)



注:本基金基金合同生效日期为2016年7月22日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

§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		
周晶	基金经理	2016年07月22日		10年	历任银华基金管理有限公司能源、家电、旅游行业分析师,大宗商品研究组组长、基金经理助理、基金经理。2015年5月11日加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司基金经理助理

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遵规守信情况的说明

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

2017年三季度,在经济好于预期和供给侧改革的双重刺激下,钢铁、有色为首的周期性行业表现出色,而上半年表现出色的大消费板块,除了白酒以外都出现了比较明显的调整。市场整体从偏好白马的风格转向为寻求价格弹性最大的周期品。

本基金在三季度由于将部分仓位配置到前期下跌较多的成长股上,在一定程度上分享到了成长股龙头的回升行情。

展望四季度,我们依然看好优质消费龙头的投资机会,消费品的投资最大的魅力在于长期稳定的收益,而不是某一年风格偏好带来的板块性行情。寻找具备中长期保持较高净资产收益率水平的、竞争壁垒高的龙头公司,长期持有以赚取长期稳健的收益是任何时候都适用的消费品投资逻辑。自2015年底启动的这一轮消费白马行情走到今天,我们仍然能够找到一些估值和增长能够匹配的好公司,值得在持仓中长期持有,对于这类具备长期投资价值的白马品种,我们会选择长期持有。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值增长率为6.11%,同期业绩比较基准收益率为3.77% ;C类份额净值增长率为5.99%,同期业绩比较基准收益率为3.77%。

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的情形。

§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	79,984,211.11	90.07
	其中:股票	79,984,211.11	90.07
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	8,649,717.64	9.74
8	其他资产	171,551.92	0.19
9	合计	88,805,480.67	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

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	2,860,572.00	3.32
B	采矿业	39,793.60	0.05
C	制造业	54,680,603.46	63.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.04
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	1,988,984.21	2.31
G	交通运输、仓储和邮政业	887,524.00	1.03
H	住宿和餐饮业	3,658,482.42	4.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	3,520,400.00	4.09
K	房地产业	1,692,290.50	1.96
L	租赁和商务服务业	5,785,325.00	6.72
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	304,002.12	0.35
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	4,535,140.36	5.27
S	综合	–	–
	合计	79,984,211.11	92.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	000858	五粮液	131,633	7,539,938.24	8.75
2	600519	贵州茅台	14,361	7,433,828.04	8.63
3	600887	伊利股份	206,100	5,667,750.00	6.58
4	000568	泸州老窖	98,900	5,548,290.00	6.44
5	603589	口子窖	99,307	4,854,126.16	5.64
6	300338	开元股份	175,804	4,386,309.80	5.09
7	601318	中国平安	65,000	3,520,400.00	4.09
8	601888	中国国旅	86,500	2,983,385.00	3.46
9	603096	新经典	48,300	2,901,864.00	3.37
10	000998	隆平高科	110,022	2,860,572.00	3.32

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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 本基金投资的前十大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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,296.55
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,852.24
5	应收申购款	30,403.13
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	171,551.92

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

	中欧消费主题股票A	中欧消费主题股票C
报告期期初基金份额总额	153,753,677.87	4,873,669.18
报告期期间基金总申购份额	1,846,909.31	1,042,159.61
减:报告期期间基金总赎回份额	84,070,062.97	2,379,380.18
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	71,530,524.21	3,536,448.61

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

本基金管理人本报告期内未持有本基金份额。

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、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧消费主题股票型证券投资基金相关批准文件
2、《中欧消费主题股票型证券投资基金基金合同》
3、《中欧消费主题股票型证券投资基金托管协议》
4、《中欧消费主题股票型证券投资基金招募说明书》
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
二〇一七年十月二十六日

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

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:2017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2017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2017年7月1日起至2017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	71,689,847.43份	
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。	
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,属于较高预期收益、较高预期风险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	70,598,652.91份	1,091,194.52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(2017年07月01日-2017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	3,393,088.83	58,902.32
2.本期利润	3,336,865.37	49,437.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0534	0.0501
4.期末基金资产净值	95,611,761.71	1,480,381.03
5.期末基金份额净值	1.3543	1.3567

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

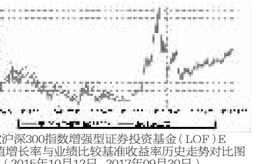
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.99%	0.59%	4.40%	0.56%	-0.41%	0.03%

中欧沪深300指数增强(LOF)E

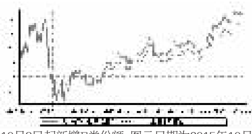
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.99%	0.59%	4.40%	0.56%	-0.41%	0.03%

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(LOF)A
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-2017年09月30日)



中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)E
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-2017年09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2017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		10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1日加入中欧基金管理有限公司

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遵规守信情况的说明

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

去年四季度以来A股市场市场波动率和市场风险均较低,蓝筹股经历了12个月的牛市行情;8月中旬开始,大盘蓝筹股的估值到达历史相对高位,有业绩支持的中小盘股逐步体现出估值优势,进入补涨,表现出财富的溢出效应。三季度,我们维持了一贯的投资策略,在保持被动仓位完全复制沪深300的情况下,通过量化选股模型在化工、轻工制造和银行等板块上进行了超配。

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3.99%,同期业绩比较基准收益率为4.40%;E类份额净值增长率为3.99%,同期业绩比较基准收益率为4.40%。

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	91,912,176.04	91.91
	其中:股票	91,912,176.04	91.91
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	8,004,842.37	8.00
8	其他资产	87,470.87	0.09
9	合计	100,004,489.28	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

5.2.1.1 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	227,052.90	0.23
B	采矿业	2,468,590.08	2.54
C	制造业	29,938,214.43	30.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,876,282.06	1.93
E	建筑业	3,517,244.82	3.62
F	批发和零售业	1,723,026.03	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	2,287,335.36	2.36
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,038,444.49	4.16
J	金融业	28,000,040.48	28.84
K	房地产业	4,209,289.25	4.34
L	租赁和商务服务业	715,781.70	0.74
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	630,547.29	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	164,997.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	789,169.37	0.81
S	综合	250,725.30	0.26
	合计	80,836,740.56	83.26

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	1,416,727.00	1.46
C	制造业	5,503,261.43	5.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,175,776.00	1.21
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	1,934,872.00	1.99
K	房地产业	1,032,300.00	1.06
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	12,499.05	0.01
S	综合	–	–
	合计	11,075,435.48	11.41

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	601318	中国平安	79,646	4,313,627.36	4.44
2	600036	招商银行	101,044	2,581,674.20	2.66
3	600016	民生银行	258,935	2,076,658.70	2.14
4	600519	贵州茅台	3,553	1,839,174.92	1.89
5	000333	美的集团	36,053	1,593,182.07	1.64
6	000651	格力电器	38,776	1,469,610.40	1.51
7	000002	万科A	54,365	1,427,081.25	1.47
8	601328	交通银行	202,993	1,282,915.76	1.32
9	600887	伊利股份	43,986	1,209,615.00	1.25
10	601288	农业银行	283,082	1,081,373.24	1.11

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	600309	万华化学	58,100	2,448,915.00	2.52
2	002597	金禾实业	98,500	2,181,775.00	2.25
3	601939	建设银行	277,600	1,934,872.00	1.99
4	002128	露天煤业	107,900	1,416,727.00	1.46
5	601668	中国建筑	126,700	1,175,776.00	1.21

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 本基金投资的万华化学集团股份有限公司(简称:"万华化学",代码:600309.SH)于2017年7月6日发布《万华化学集团股份有限公司关于2016年9月20日安全事故调查结果的公告》(编号:临[2017]48号)。公告就烟台工业园"9.20"较大爆炸事故解释情况。事故造成4人死亡、4人受伤,直接经济损失573.62万元。调查认定此事故为较大生产安全事故。公司对9名相关责任人给予相应责任追究,包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分;烟台市安监局对万华化学负责人处上一年收入40%的罚款,对万华化学处以80万元罚款。在上述公告公布后,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对万华化学(600309.SH)的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。其余九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	13,048.09
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,277.69
5	应收申购款	71,145.09
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	87,470.87

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
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。
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	53,426,012.64	850,587.85
报告期期间基金总申购份额	30,150,030.70	358,193.47
减:报告期期间基金总赎回份额	12,977,390.43	117,586.80
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	70,598,652.91	1,091,194.52

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(%)	–	11.18

注:买入/申购总份额包含红利再投份额、转换入份额,卖出/赎回总份额含转换出份额。

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年8月30日至2017年9月30日	0.00	18,466,105.31	0	18,466,105.31	25.76%

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,并在基金运作中对流动性进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。

注:申购份额含红利再投份额、转换入份额,赎回份额含转换出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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
9.2 存放地点
基金管理人的办公场所。
9.3 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
二〇一七年十月二十六日