中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2010年8月16日
公告日期:2010年8月11日

一、重要声明与提示

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2010年5月14日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和中欧基金管理有限公司网站www.lcfunds.com的本基金招募说明书。

二、基金概览

1.基金简称:中欧沪深300指数增强(LOF)
场内简称:中欧300
2.交易代码:166007
3.基金份额总额:1,202,197,493.33份(截止:2010年8月9日)
4.基金份额净值:1.0098元(截止:2010年8月9日)
5.本次上市交易份额:57,032,620份
6.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
7.上市交易日期:2010年8月16日
8.基金管理人:中欧基金管理有限公司
9.基金托管人:兴业银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况:
1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2010年5月4日证监许可[2010]588号文
2.基金运作方式:上市契约型开放式
3.基金合同期限:不定期
4.发售日期:2010年5月18日至2010年6月18日
5.发售价格:1.00元人民币
6.发售方式:交易所(场内)发售和柜台(场外)发售
7.发售机构:
(1)深圳证券交易所(场内)发售机构
1)具有基金代销业务资格的深交所会员单位
国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、信达证券等(排名不分先后)。
2)本基金募集期间获得基金代销资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。
3.购未取得基金代销资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的买卖。
(2)柜台(场外)发售机构
1)直销机构:中欧基金管理有限公司上海直销中心
2)场外代销机构:兴业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、国都证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、国元证券股份有限公司、广发华福证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司
8.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
9.募集资金总额及入账情况:本次募集净销售金额为人民币1,201,873,408.58元;认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币324,084.75元,折算成基金份额共计324,084.75份,已分别计入各基金份额持有人的基金账户,归基金份额持有人所有。上述募集资金及利息已于2010年6月24日全额划入本基金托管人兴业银行股份有限公司基金托管专户。
10.基金备案情况:本基金于2010年6月24日验资完毕,当日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2010年6月24日获书面确认,本基金合同自该日起正式生效。
11.基金合同生效日:2010年6月24日。
12.基金合同生效日的基金份额总额:1,202,197,493.33份。
13.基金合同生效日的基金份额结构:
(二)本基金上市交易的主要内容:
1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2010]254号
2.上市交易日期:2010年8月16日
3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4.基金简称:中欧沪深300指数增强(LOF)
场内简称:中欧300
5.交易代码:166007
6.本次上市交易份额:57,032,620份
7.基金资产净值的披露:包括开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间的净值揭示两部分。
基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统"市盈率Ⅰ"揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人对公布的基金净值负责。
考虑到中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)作为上市开放式基金在交易所交易的特性,仅揭示每日收市后的净值不能满足交易需求,基金管理人同深圳证券交易所协商一致,决定增加中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)的基金份额参考净值揭示频率,每交易日内定时揭示四次。交易时间内基金管理人将实时计算的基金份额参考净值传给深交所,深交所通过行情系统"市盈率Ⅱ"实时揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考,基金管理人、基金托管人并不对其准确性负责,亦不对其交易作出任何保证或担保。
8.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2010年8月9日的场内基金份额持有情况:
场内基金份额持有人户数:816户
平均每户持有的场内基金份额:69,892.92份
场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有7,208,640份,占12.64%
场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例:个人持有49,823,980份,占87.36%
场内基金前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	北京地国基础市政工程有限责任公司	2,000,060.00	3.51
2	邵忠杰	1,938,060.00	3.40
3	金林	1,600,096.00	2.81
4	史亚迪	1,500,300.00	2.63
5	北京永安达机械工程有限公司	1,500,195.00	2.63
6	陈秀霞	1,000,202.00	1.75
7	文树芬	1,000,150.00	1.75
8	李国庆	1,000,070.00	1.75
9	邱镭	1,000,060.00	1.75
10	任进	1,000,060.00	1.75

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1.名称:中欧基金管理有限公司
2.法定代表人:常蛟
3.总经理:刘建平
4.注册资本:1.2亿元人民币
5.注册地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
6.设立批准文号:中国证监会证监基字[2006]102号
7.企业法人营业执照注册号:310000400578800
8.经营范围:基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务。
9.存续期限:持续经营
10.股东及其出资比例:意大利意联银行股份合作公司出资持股49%;国都证券有限责任公司持股47%;平顶山煤业(集团)有限责任公司持股4%。
11.内部组织结构及职能
公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,对基金投资的所有重大问题进行决策。风险控制委员会是公司日常运作的最高风险控制机构。
公司目前下设投资部、研究部、金融工程部、中央交易室、营销策划部、基金销售部、产品开发部、电子商务部、客户服务中心、公司财务部、基金运营部、行政部、信息技术部、人力资源部、监察稽核部等部门,各部门主要职责如下:
①投资部为基金投资业务的核心部门,负责基金资产的投资管理。
②研究部负责对宏观经济、市场动态、行业及上市公司等领域进行调查研究,为投资决策提供研究支持。
③金融工程部负责定量投资的研究、基金业绩评估分析、基金风险评价、研究员业绩考核、衍生品的研究以及数量化程序开发。
④中央交易室负责执行各项交易指令,及时向基金经理汇报市场异常交易情况以及重大消息。
⑤营销策划部负责公司各类产品的市场调研、产品推广、公司品牌建设以及对外交流与合作等事务。
⑥基金销售部负责基金客户的开发和维护、基金代销渠道网络的建设和维护。
⑦业务发展部负责新的基金产品的设计及协调、新业务的开拓及协调。
⑧电子商务部负责公司网站的建设与维护及为基金网上交易提供服务支持。
⑨客户服务中心负责日常客户服务工作、并提供销售支持及客户服务相关工作。
⑩公司财务部负责公司的财务管理和会计核算。
⑪基金运营部负责基金注册登记、基金直销业务办理、基金资金清算以及基金会计核算等事务。
⑫行政部负责公司日常行政事务管理。
⑬信息技术部负责公司信息系统的建设、维护与管理,为公司管理和业务活动提供技术支持。
⑭人力资源部负责公司人力资源管理。
⑮监察稽核部负责公司法务、合规监察及内部稽核审计。
12.人员情况:
截至2010年8月9日,我公司共有69名员工,其中博士学位3人、硕士学位39人、学士学位23人。
13.信息披露负责人及咨询电话:黎忆海 021-68609600-2001
14.基金管理业务情况:
截至本公告编制日,本基金管理人共管理6只开放式基金,即中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)和中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)。
15.本基金基金经理:
林钟斌先生,中国籍,北京大学世界经济学硕士,11年证券从业经验。历任招商证券研究发展中心研究员、行业研究主管,融通基金管理有限公司研究发展部总监助理。2009年6月加入中欧基金管理有限公司,任研究部副总监;自2009年12月15日起任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理;自2010年2月9日起任公司研究部总监;自2010年6月24日起任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。
(二)基金托管人
名称:兴业银行股份有限公司(简称:兴业银行)
法定代表人:高建平
注册资本:50亿元人民币
注册地址:福州市湖东路154号
托管部负责人:崔建生
信息披露负责人:张志永
电话:021-52629999-212004
主要人员情况:兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处、产品研发处等处室,共有员工43人,平均年龄30岁,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。
基金托管业务情况:兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截止2010年6月30日,兴业银行已托管开放式基金12只——兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球观野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型基金(LOF)。托管基金总资产净值341.88亿元。
开业二十二年来,兴业银行始终坚持与客户"同发展、共成长"和"服务源自真诚"的经营理念,致力于为客户提供金面、优质、高效的金融服务。截至2009年末,兴业银行资产总额为13321.62亿元,股东权益为595.97亿元,不良贷款比率为0.54%。全年累计实现税后利润132.82亿元。根据英国《银行家》杂志2009年7月发布的全球银行1000强排名,兴业银行按总资产排名列第108位,按一级资本排名117位。根据美国《布斯》杂志的2009全球上市公司2000强排名,兴业银行综合排名第389位,在307家上榜的全球银行中排名第62位。
(三)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
法定代表人:杨绍信
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
经办注册会计师:薛竞 金毅
电话:021-23238888

六、基金合同摘要

(一)基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
1.基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利:
①自本基金同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
②依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
③发售基金份额;
④依照有关规定使因基金财产投资于证券所产生的权利;
⑤在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
⑥根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或者有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
⑦在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
⑧在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
⑨自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
⑩选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
⑪选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
⑫在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
⑬依法召集基金份额持有人大会;
⑭法律法规和基金合同规定的其他权利。
2.基金管理人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:
①依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
②办理基金备案手续;
③自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
⑥除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
⑦依法接受基金托管人的监督;
⑧计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
⑨采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
⑩按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
⑫编制季度、半年度和年度基金报告;
⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
⑭保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
⑮按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
⑯依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
⑰保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
⑱以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
⑲组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
㉒规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
㉓面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
㉔执行生效的基金份额持有人大会决议;
㉕不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
㉖)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;
㉗法律法规和基金合同规定的其他义务。
3.基金托管人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:
①依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
②监督基金管理人对本基金的投资运作;
③自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;
④在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;
⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
⑥依法召集基金份额持有人大会;
⑦按规定取得基金份额持有人名册资料;
⑧法律法规和基金合同规定的其他权利。
4.基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:
①安全保管基金财产;
②设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
③对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;
④除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
⑥按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
⑦保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
⑧对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
⑨保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
⑩按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
⑪办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
⑫复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
⑬按照规定监督基金管理人的投资运作;
⑭按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
⑮依据基金管理人的指令或者有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
⑯按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人大会;
⑰因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
⑱基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;
⑲参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
⑳面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金管理人;
㉑执行生效的基金份额持有人大会决议;
㉒建立并保存基金份额持有人名册;
㉓法律法规和基金合同规定的其他义务。
5.基金份额持有人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:
①分享基金财产收益;
②参与分配清算后的剩余基金财产;
③依法申请赎回其持有的基金份额;
④按照规定要求召开基金份额持有人大会;
⑤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
⑥查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
⑦监督基金管理人的投资运作;
⑧对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
⑨法律法规和基金合同规定的其他权利。
每份基金份额具有同等的合法权益。
6.基金份额持有人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:
①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
②交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
③在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
⑤执行生效的基金份额持有人大会决议;
⑥返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
⑦法律法规和基金合同规定的其他义务。
(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
1.基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。
2.召开事由
①当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会:
1)提前终止基金合同;
2)转换基金运作方式;
3)变更基金类别;
4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
5)变更基金份额持有人大会程序;
6)更换基金管理人、基金托管人;
7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;
8)本基金与其他基金的合并;
9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
②出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:
1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调低基金的赎回费率;
3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化;
5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
③关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。
2.本基金合同的终止
有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:
①基金份额持有人大会决定终止的;
②基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
③基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
④中国证监会规定的其他情况。
3.基金财产的清算
①基金财产清算组
1)自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算组,基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
②基金财产清算程序
基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:
1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;
3)对基金财产进行清理和确认;
4)对基金财产进行估价和变现;
5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
6)聘请律师事务所出具法律意见书;
7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
9)公布基金财产清算结果;
10)对基金剩余财产进行分配。
③清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。
④基金财产按下列顺序清偿:
1)支付清算费用;
2)交纳所欠税款;
3)清偿基金债务;
⑤按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
基金财产未按前款(1)-(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。
⑥基金财产清算的公告
基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。
⑦基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
(八)争议解决方式
对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。
争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。
本基金合同受中国法律管辖。
(九)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式
本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况(未经审计)

深圳证券交易所在中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)2010年8月9日资产负债表如下:

项目	行次	2010年8月9日
资产		
银行存款	1	1,118,703,359.94
清算备付金	2	1,496,779.61
交易保证金	3	
应收证券清算款	4	
应收股利	5	
应收利息	6	1,129,678.68
应收申购款	7	
其他应收款	8	
股票投资-市值	9	93,412,010.86
其中:股票投资成本	10	88,773,703.04
债券投资-市值	11	
其中:债券投资成本	12	
权证投资	13	
其中:权证投资成本	14	
买入返售证券	15	
待摊费用	16	
其他资产	17	
资产总计	18	1,214,741,829.09
负债		
应付证券清算款	19	
应付赎回款	20	
应付赎回费	21	
应付管理人报酬	22	298,881.30
应付托管费	23	44,832.20
应付佣金	24	
应付利息	25	
应付收益	26	
未交税金	27	
其他应付款项	28	
卖出回购证券款	29	
短期借款	30	
预提费用	31	92,276.98
其他负债	32	332,799.00
负债合计	33	768,789.48
持有人权益		
实收基金	34	1,202,197,493.33
未实现利得	35	
未分配收益	36	11,775,546.28
持有人权益合计	37	1,213,973,039.61
负债及持有人权益总计	38	1,214,741,829.09

八、基金投资组合

截止到2010年8月9日,中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)的投资组合如下:
(一)期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	93,412,010.86	7.69%
2	债券		
3	权证		
4	银行存款及清算备付金	1,120,200,139.55	92.22%
5	其他资产	1,129,678.68	0.09%
	合计	1,214,741,829.09	100.00%

(二)期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A农、林、牧、渔业		
2	B采掘业		
3	C制造业	63,704,288.10	5.25%
其中:	C0食品、饮料	19,838,200.80	1.63%
	C1纺织、服装、皮毛		
	C2木材、家具		
	C3造纸、印刷		
	C4石油、化学、塑胶、塑料	4,017,000.00	0.33%
	C5电子	4,756,727.36	0.39%
	C6金属、非金属		
	C7机械、设备、仪表	24,016,306.10	1.98%
	C8医药、生物制品	11,076,053.84	0.91%
	C99其他制造业		
4	D电力、煤气及水的生产和供应业		
5	E建筑业	1,493,337.36	0.12%
6	F交通运输、仓储业		
7	G信息技术业	8,927,000.00	0.74%
8	H批发和零售贸易	6,922,537.00	0.57%
9	I金融、保险业	12,364,848.40	1.02%
10	J房地产业		
11	K社会服务业		
12	L传播与文化产业		
13	M综合类		
合计		93,412,010.86	7.69%

(三)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	399,948	13,838,200.80	1.14%
2	000425	徐工机械	280,000	10,304,000.00	0.85%
3	600036	招商银行	660,100	9,446,031.00	0.78%
4	600690	青岛海尔	399,957	8,895,043.68	0.73%
5	000858	五粮液	200,000	6,000,000.00	0.49%
6	600487	亨通光电	200,000	5,850,000.00	0.48%
7	600329	中新药业	400,000	5,672,000.00	0.47%
8	600062	双鹤药业	199,928	5,404,053.84	0.45%
9	600360	华微电子	609,056	4,756,727.36	0.39%
10	002024	苏宁电器	350,000	4,595,500.00	0.38%

(四)期末按券种分类的债券投资组合
本报告期末本基金未持有债券。
(五)期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券名细
本报告期末本基金未持有债券。
(六)股票组合报告附注
1.本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。
2.本基投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
3.其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	交易保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收利息	1,129,678.68
4	应收申购款	
5	待摊费用	
6	其他应收款	
合计		1,129,678.68

4.本报告期末本基金未持有资产支持证券。
5.本报告期末本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

基金管理人于2010年7月28日发布公告,经中欧基金管理有限公司第二届董事会审议通过,选举唐步先生为公司董事长。唐步先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2010]977号文)。
基金管理人于2010年8月5日发布公告,经中欧基金管理有限公司第二届董事会审议通过,同意聘任徐红光先生为公司副总经理。徐红光先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2010]1031号文)。
除上述事件外,本基金自合同生效至上市交易期间未发生其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金份格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:
(一)中国证监会核准中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)募集的文件;
(二)中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同;
(三)中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)托管协议;
(四)中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书;
(五)法律意见书;
(六)基金管理人业务资格批件和营业执照;
(七)基金托管人业务资格批件和营业执照;
(八)中国证监会要求的其他文件。
存放地点:基金管理人和基金托管人的住所
查阅方式:基金投资者可在营业时间免费查阅,或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.lcfunds.com)查阅。

中欧基金管理有限公司
2010年8月11日

中欧基金管理有限公司关于中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)开放申购、赎回及跨系统转托管业务的公告

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)",基金代码:166007;以下简称"本基金")的基金合同已于2010年6月24日正式生效,根据《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,中欧基金管理有限公司定于2010年8月16日起办理本基金场内、场外的申购、赎回及跨系统转托管业务。

一、申购、赎回业务办理时间

申购