

# 中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

（2011年第1号）

## 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

二〇一一年二月

### 重要提示

本基金经2010年5月4日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2010 588号文]核准，进行募集。本基金基金合同于2010年6月24日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全额取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认 申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：政治性、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金是一只股票型基金，属证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

投资人应认真阅读《基金合同》中关于基金管理人以真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，过往业绩并不代表其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对新基金业绩表现的保证。

本摘要根据《中欧沪深300指数增强型证券投资基金基金 LOF 基金合同》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金 LOF 更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件，基金投资人自依基金合同取得基金份额时，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为2010年12月23日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日（财务数据未经审计）。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

1、名称：中欧基金管理有限公司  
2、住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层  
3、办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层  
4、法定代表人：唐秀  
5、组织形式：有限责任公司  
6、设立日期：2006年7月19日  
7、批准设立机关：中国证监会  
8、批准设立文号：证监基金字〔2006〕110号  
9、存续期间：持续经营  
10、电话：021－ 68609600  
11、传真：021－33830351  
12、联系人：陈亮  
13、客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长话费费）  
14、注册资本：1.2亿元人民币  
15、股权结构：  
意大利联合银行股份有限公司（简称UBI）出资5,880万元人民币，占公司注册资本的49%；

国都证券股份有限公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的47%；  
平壤工业集团（有限）有限责任公司出资480万元人民币，占公司注册资本的4%；  
上述三个股东共出资12,000万元人民币。  
（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员  
唐秀先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍，19年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监、国际证券部负责人、国际信托投资有限公司副总经理、总经理。  
Gianluca Trombà先生，中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行国际业务部门负责人，曾任摩根士丹利 巴克士 投资银行部总监，意大利金融机构小组主管；摩根士丹利 伦敦米兰 投资银行部执行总监；瑞士联合银行 欧罗巴 金融机构小组副总监；毕马威会计师事务所 欧洲业务、米兰 审计师。  
Guido Masella先生，中欧基金管理有限公司董事，意大利意联银行欧元区商务拓展主管，意大利中央银行 罗马 国际研究处、意大利银行 北京 代表处、意大利驻华大使馆 北京 财务专员，意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办处经济师；意大利中央银行 维罗纳 银行和金融机构系统监管分析师。

陈金戈先生，中欧基金管理有限公司董事，国都证券股份有限公司副总经理，中国籍。历任中共北京市委纪律检查委员会北京市行政违法违纪办公室成员、北京国际信托投资公司金融总部和证券总部助理经理。  
Bary Livot先生，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，美国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析师、国际证券咨询有限公司 International Securities Consultancy Ltd.）咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，中欧金融服务合作项目协调员、证券部董事。

刘翔先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副教授。  
肖辉先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任合伙人，曾任中国法律事务中心律师。

2、基金管理人监事会成员  
廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学硕士、复旦大学金融研究院博士，后任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海海商律师事务所合伙人。  
刘中先生，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。  
刘敏女士，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监，成都市外事外侨投资促进中心项目经理，加拿大DESROSIERS-LOMBARDI-DOLBEZ注册会计师事务所审计师、美国 GENERAL EASTERN TRADING 公司财务总监。

3、公司高级管理人员  
唐秀先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍，简历同上。  
刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍，北京大学法学硕士，14年以上证券及基金从业经验。历任北京大学副教授、副科长；中国证券监督管理委员会基金监管部副处长；上投摩根基金资产管理公司董事长。  
马文辉先生，中欧基金管理有限公司原任督察长，中国籍，复旦大学工商管理硕士，20年以上证券及基金从业经验。历任中国证监会市场研究设计中心技术部经理、北京国际信托投资有限公司证券营业部总经理、中诚信托投资有限责任公司证券营业部总经理、国都证券有限责任公司证券营业部总经理。经中欧基金管理有限公司（以下简称“公司”）第二届董事会审议批准，同意马文辉先生辞去公司督察长职务，该决定自中国证监会核准朱彦生先生基金行业高级管理人员任职资格的批复作出之日起生效。朱彦生先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证监会监督管理委员会核准（证监许可〔2011〕102号文）。上述变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并于2011年1月22日予以公告。  
徐江先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总监，中国籍，北京大学管理学硕士，10年以上证券从业经验。历任上海华安集团基金公司证券部研究员，华安基金管理有限公司市场部总监兼销售部经理，上投摩根基金资产管理公司上海销售副总监、总经理助理兼销售部经理。  
黄辉先生，中欧基金管理有限公司分管运营副经理，中国籍，复旦大学经济学硕士，20年以上证券及基金从业经验。曾先后就职于上海爱建信托公司、上海万国证券公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司等金融机构。历任光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监、信诚基金管理有限公司运营部总监及信息技术部总监。  
4、本基金拟任基金经理  
林钟斌先生，中欧沪深300指数增强型证券投资基金 LOF 基金经理，中国籍，北京大学世界经济专业硕士，11年证券从业经验。历任招商证券研究发展中心分析师、研究员、行业研究主管，融通基金管理有限公司研究策划部总监助理，中欧基金管理有限公司研究部副总监。现任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（2009年12月15日起至今）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金 LOF 基金经理（2010年6月24日起至今，任研究部总监兼执行投资总监职责）。

5、公司投资决策委员会成员

公司投资决策委员会的成员为：公司研究部总监林钟斌先生（执行投资总监职责）、公司总经理唐建平先生、基金经理沈洋先生、基金经理苟开红女士、基金经理廖曙光先生。其中公司研究部总监林钟斌先生任投资决策委员会主席（执行）。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 二、基金托管人

1、基本情况  
名称：兴业银行股份有限公司  
住所：福州市湖东路154号  
办公地址：福州市湖东路154号  
法定代表人：高建平  
注册日期：1988年7月20日  
注册资本：50亿元人民币  
托管部联系人：刘峰  
电话：021-62677777-212017  
传真：021-62159217  
兴业银行股份有限公司成立于1988年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于福建省福州市，注册资本50亿元。开业21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，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2009年9月末，兴业银行资产总额为12663.12亿元，股东权益为558.48亿元，不良贷款率为0.61%，今年1至9月累计实现税后利润95.72亿元。根据美国《银行家》杂志2010年7月发布的全球银行1000强排名，兴业银行2009年排名第99位，按一级资本排名第245位。在113家上榜的中国内地企业中排名第14位。

2、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40余人，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。

3、基金托管业务经营情况  
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12月31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、兴业全球视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、光大永定价值成长长期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指数增强型证券投资基金。托管基金资产规模346.66亿元。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标  
严格遵守国家有关托管业务的法律法规，行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作，严格执行业务，确保业务各环节的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构  
兴业银行基金托管业务内部控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独

立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则  
①全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

②独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

③相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡机制。

④定性和定量相结合原则：建立完善的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

⑤防火防盗原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则：内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

⑦审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

⑧责任追究原则：各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

4、内部控制制度及措施  
① 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。  
② 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。  
③ 建立风险识别与评估、稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估、制定并实施风险控制措施。

④ 相对独立的业务操作空间，业务操作相对独立，实施门禁管理和音像监控。  
⑤ 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序  
基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人存在违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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。

基金托管人发现基金管理人指令违反法律法规和中国证监会规定，或者违反基金合同约定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。法律法规和中国证监会另有规定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监报告。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

1、场外发售机构  
①直销机构：  
名称：中欧基金管理有限公司  
住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层  
办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层  
法定代表人：唐秀  
成立时间：2006年7月19日  
批准设立机关：中国证监会  
批准设立文号：证监基金字〔2006〕110号  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：1.2亿元人民币  
存续期间：持续经营  
电话：021-68609600  
传真：021-68609601  
联系人：陈亮  
客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长话费费）  
网址：www.fundscn.com

②代销机构：  
1) 兴业银行股份有限公司  
住所：福州市湖东路154号  
办公地址：福州市湖东路154号  
法定代表人：高建平  
联系电话：021-52629999  
联系人：曾鸣  
客服电话：95561  
网址：www.cib.com.cn

2) 中国建设银行股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街25号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
法定代表人：郭树清  
联系电话：010-67591369  
传真：010-67562564  
客服电话：95533  
联系人：王琳  
网址：www.ccb.com

3) 中国工商银行股份有限公司  
住所：北京市西城区复兴门内大街2号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号  
法定代表人：姜建清  
联系人：董云巍  
联系电话：010-83191283  
客户服务电话：95588  
网址：www.icbc.com

4) 中国民生银行股份有限公司  
住所：北京市东城区朝阳门内大街2号  
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街2号  
法定代表人：刘安东  
联系电话：010-66599805  
传真：010-66411594  
联系人：陈凤英  
客服电话：95580  
网址：www.cmbc.com.cn

5) 中国光大银行股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座4层  
法定代表人：陈敬达  
客服电话：010-66455678  
联系人：董文洲  
联系电话：010-66405500  
传真：010-66405508  
客服电话：95511  
网址：www.pingan.com

6) 招商证券股份有限公司  
住所：深圳市福田区益田路19号招商大厦B座1709号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人：李飞  
联系电话：0551-2207936  
联系传真：0551-2207965  
客服电话：95578、4008888777  
网址：www.zs.com.cn

7) 中信证券股份有限公司  
住所：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦C座  
法定代表人：王东明  
联系人：孔丹  
联系电话：010-65541885  
传真：010-65541230  
客服电话：95558  
网址：www.citic.com

8) 光大证券股份有限公司  
住所：上海市静安区新闻路1508号  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：徐浩明  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
联系人：李茂  
客服电话：400888788、10108998  
网址：www.ebscn.com

9) 广发证券股份有限公司  
住所：广州市天河区珠江东路183号大都会广场43楼  
办公地址：广东广州天河区北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼  
法定代表人：王志伟  
联系电话：961133或致电各地营业网点  
传真：020-87555305  
联系人：肖冉梅  
网址：www.gf.com.cn

10) 湘财证券股份有限公司  
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼  
法定代表人：何如  
电话：0755-82133083  
传真：0755-82133302  
联系人：乔晓旻  
客服电话：95536  
网址：www.xcf.com.cn

11) 深圳泰康证券有限责任公司  
住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马鸣明  
电话：0755-82492000  
联系人：陈昱宗、庞晓芸  
客服电话：400-8888-555、95513  
网址：www.hllq.com

12) 齐鲁证券有限公司  
住所：山东省济南市经十路128号  
办公地址：山东省济南市经七路86号23层  
法定代表人：李玮  
联系人：傅梅梅  
电话：0531-81283938  
传真：0531-81283900  
客服电话：95538  
网址：www.qlzq.com.cn

13) 申银万国证券股份有限公司  
住所：上海市浦东新区世纪大道171号  
办公地址：上海南京东路171号  
法定代表人：丁国荣  
电话：021-54033888  
传真：021-54038844  
联系人：李倩倩  
客服电话：021-962505

14) 兴业证券股份有限公司  
住所：福州市湖东路99号标力大厦  
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄正大道口广场1号楼21层  
法定代表人：兰荣  
电话：021-38565783  
传真：021-38565785  
联系人：谢海峰  
客服电话：4008888123  
网址：www.xyzq.com.cn

15) 中国银河证券股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人：顾伟国  
电话：010-66586888  
传真：010-66586836  
联系人：田薇  
客服电话：4008-888-888  
网址：www.chinastock.com.cn

16) 招商证券股份有限公司  
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层  
法定代表人：肖李洪  
电话：0755-82943666  
联系人：林生迎  
客服电话：95565、4008881111  
网址：www.newone.com.cn

17) 中信建投证券股份有限公司  
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市朝阳区内大街188号  
法定代表人：张佑君  
电话：4008881108  
传真：010-65182261  
联系人：权鹏  
客服电话：95582  
网址：www.csc108.com

18) 宏源证券股份有限公司  
住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号  
办公地址：北京海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层  
法定代表人：陈敬达  
电话：010-62267799-6416  
传真：010-62296401  
联系人：张智军  
客服电话：400800-562、010-62294600  
网址：www.hysec.com

19) 海通证券股份有限公司  
住所：上海市淮海中路98号  
办公地址：上海广东路68号  
法定代表人：王开国  
电话：021-23219000  
传真：021-23219100  
联系人：金宏、李奕鸣  
客服电话：95553  
网址：www.htsec.com

20) 平安证券有限责任公司  
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼  
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼  
法定代表人：杨敬达  
全国免费业务咨询热线：95511  
开放式基金业务传真：0755-82433794  
联系人：郑舒丽  
联系电话：4008866338  
网址：www.pingan.com

21) 国元证券股份有限公司  
住所：安徽省合肥市寿春路179号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人：陈良志  
联系人：李飞  
联系电话：0551-2207936  
联系传真：0551-2207965  
客服电话：95578、4008887777  
网址：www.gy.com.cn

22) 天相投资顾问有限公司  
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701  
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层  
法定代表人：陈敬达  
客服电话：010-66455678  
联系人：林奕  
联系电话：010-66405500  
传真：010-66405508  
客服电话：95511  
网址：www.txsec.com

23) 国泰君安证券股份有限公司  
住所：上海市浦东新区商城路618号良友大厦  
办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦4号楼  
联系人：李晔  
联系电话：0551-2207936  
联系传真：0551-2207965  
客服电话：95578、4008887777  
网址：www.gtja.com

24) 广发证券股份有限公司  
住所：广州市天河区珠江东路183号大都会广场43楼  
办公地址：广东广州天河区北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼  
法定代表人：王志伟  
联系电话：961133或致电各地营业网点  
传真：020-87555305  
联系人：肖冉梅  
网址：www.gf.com.cn

25) 信达证券股份有限公司  
住所：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
法定代表人：高冠华  
客服电话：9591-96326  
传真：0591-87841150  
联系人：张雷  
联系电话：0591-87383623  
网址：www.cindasc.com

26) 安信证券股份有限公司  
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A2层  
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02层  
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层  
法定代表人：牛冠兴  
客服热线：4008-001-001  
客服传真：0755-82583355  
联系人：陈剑虹  
联系电话：0755-82583305  
网址：www.essence.com.cn

26) 信达证券股份有限公司  
住所：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层  
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心  
法定代表人：张志刚  
客服热线：400-800-8899  
传真：010-63080978  
联系人：唐静  
联系电话：010-63081000  
网址：www.cindasc.com

27) 华泰证券股份有限公司  
住所：南京市江东门东大街90号  
办公地址：南京市中山北路90号  
法定代表人：吴万善  
客服热线：95597  
传真：025-84579673  
联系人：刁鸣  
联系电话：025-83290979  
网址：www.htsec.com

28) 渤海证券股份有限公司  
住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼  
办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼  
法定代表人：魏文斌  
客服电话：400-888-128  
传真：021-68767880  
联系人：徐闯  
联系电话：68761616  
网址：www.bhsc.com.cn

29) 方正证券股份有限公司  
住所：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
办公地址：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
法定代表人：李国华  
客服电话：95508  
传真：0431-84996735  
联系人：李国华  
网址：www.founders.com.cn

30) 光大证券股份有限公司  
住所：上海市静安区新闻路1508号  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：徐浩明  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
联系人：李茂  
客服电话：400888788、10108998  
网址：www.ebscn.com

31) 光大证券股份有限公司  
住所：上海市静安区新闻路1508号  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：徐浩明  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
联系人：李茂  
客服电话：400888788、10108998  
网址：www.ebscn.com

32) 方正证券股份有限公司  
住所：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
办公地址：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
法定代表人：李国华  
客服电话：95508  
传真：0431-84996735  
联系人：李国华  
网址：www.founders.com.cn

33) 方正证券股份有限公司  
住所：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
办公地址：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
法定代表人：李国华  
客服电话：95508  
传真：0431-84996735  
联系人：李国华  
网址：www.founders.com.cn

34) 方正证券股份有限公司  
住所：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
办公地址：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
法定代表人：李国华  
客服电话：95508  
传真：0431-84996735  
联系人：李国华  
网址：www.founders.com.cn

35) 方正证券股份有限公司  
住所：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
办公地址：吉林省长春市净月开发区净月大街6888号  
法定代表人：李国华  
客服电话：95508  
传真：0431-84996735  
联系人：李国华  
网址：www.founders.com.cn

（二）基金注册登记机构  
名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京西城区金融大街27号投资广场22、23层  
办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场22、23层  
法人代表：金颖  
联系人：朱立元  
电话：010-58598839  
传真：010-58598907

（三）律师事务所与经办律师  
律师事务所名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：韩炯  
经办律师：吕红、黎明  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：吕红

（四）会计师事务所和经办注册会计师  
会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所：上海市静安区南京西路1318号凯信银行大厦6楼  
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
法定代表人：杨绍信  
电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：张鸿  
经办会计师：薛竞、张鸿

四、基金的名称  
中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

上市契约型开放式

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前提下，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均跟踪误差不得超过0.5%，年化跟踪误差率不超过7.75%，以实现高于指数的投资收益和基金资产的长期增值。

#### 六、基金的投资目标

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前提下，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均跟踪误差不得超过0.5%，年化跟踪误差率不超过7.75%，以实现高于指数的投资收益和基金资产的长期增值。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，本基金投资于该等资产的比例为90%—95%，可以将纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比重为90%—95%，其中被投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规范。

#### 八、基金的投资策略

（一）投资策略  
本基金为指数增强型基金，以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。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度风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。

##### 1. 资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期稳定增长为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人将在股票、债券、权证和现金等各类资产之间进行适度主动投资的调整。

在资产配置类别上，本基金投资于股票资产的比例为90%—95%，其中被投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

##### 2. 股票投资策略

本基金投资组合采用复制标的指数的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票资产采用抽样复制替代。主动投资依据国内股票市场的完全有效性和指数跟踪本身的局限性及时性综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例调整等因素对指数的成份股及备选成份股进行优化；同时，根据研究人员的研究报告，谨慎地挑选少数沪深300指数成份股及备