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

(2014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

二〇一四年一月

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,但不保证投资本基金一定盈利,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数取回其原本投资。

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:因政治、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。

投资有风险,投资人在认(申)购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》,过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本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(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,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2013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2013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:窦玉明
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]102号
9.存续期间:持续经营
10.电话:021-68609600
11.传真:021-33830351
12.联系人:顾丽萍
13.客户服务热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)
14.注册资本:1.88亿元人民币
15.股权结构:
意大利意联银行股份合作公司(简称UBI)出资6,580万元人民币,占公司注册资本的35%;
国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币,占公司注册资本的30%;
北京百能投资有限公司出资5,640万元人民币,占公司注册资本的30%;
万盛基业投资有限责任公司出资940万元人民币,占公司注册资本的5%;
上述四个股东共出资18,800万元人民币。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员
窦玉明先生,清华大学经济管理学院本科、硕士,美国杜兰大学MBA,中国籍,中欧基金管理有限公司董事长,曾任职于君安证券有限公司,大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理,富国基金管理有限公司总经理。

Marco D'Este先生,意大利籍,现任中欧基金管理有限公司副董事长,意大利意联银行股份合作公司(UBI)机构银行业务部总监,历任布雷西亚农业信贷银行(CAB)国际部总监,联合信贷银行(Unicredit)米兰总部客户业务部客户关系管理,跨国公司信用扶反管理负责人,联合信贷银行东京分行资金部经理,并曾在Credito Italiano(意大利信贷银行)圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

卢树奇先生,中国社会科学院货币银行学专业研究生,中国籍,现任国都证券董事长兼总经理,曾任职于中国民族国际信托投资公司,中煤信托投资有限责任公司,历任国都证券有限责任公司投资项目经理、天津营业部总经理、经纪业务总部总经理助理、证券投资部总经理助理及副总经理。

刘建平先生,北京大学法学硕士,中国籍,现任中欧基金管理有限公司总经理,历任北京大学助教、副科长,中国证券监督管理委员会基金监管部副处长,上投摩根基金管理有限公司督察长

David Youngson先生,英国籍,现任**IFM**(亚洲)有限公司创办者及合伙人,英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员,历任安永(中国香港特别行政区及英国伯明翰,伦敦)审计经理、副总监,赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭劳生先生,美国哈佛大学(Harvard)法学硕士(国际金融法),北京大学法学博士(国际经济法),美国南美以美大学(Southern Methodist)法学硕士(国际法/比较法),中国籍,现任北京大学法学院讲师、副教授、院聘教授、院长助理,历任美国康奈尔大学(Cornell)法学院客座教授。

周皓先生,美国杜克大学经济学博士,北京大学管理学硕士学位和经济学学士,美国籍,现任清华大学五道口金融学院教授,历任美国联邦储备委员会风险分析部高级经济学家,麻省理工学院斯隆管理学院和北京大学中国经济研究中心访问教授。

2.基金管理人监事会成员

唐步先生,中欧基金管理有限公司监事会主席,中国籍,历任中欧基金管理有限公司董事长,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,大通证券股份有限公司副总经理,国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

廖有先生,中欧基金管理有限公司监事,上海财经大学法学硕士,律师及注册会计师执业资格,现任中欧基金法律事务部负责人,曾任职于普华永道会计师事务所,毕马威会计师事务所,安永会计师事务所,历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。

黎忆海女士,中欧基金管理有限公司职工监事,监察稽核部总监,中国籍,南开大学会计学专业硕士,历任湖南省计算机高等专科学校教师,深圳世纪星源股份有限公司财务分析员,华富基金管理有限公司监察稽核员。

黄峰先生,中欧基金管理有限公司职工监事,运营副总监及信息技术部总监,中国籍,北京大学信息科学中心信号与信息处理专业硕士,历任中再资产管理有限公司信息技术部主管,海通证券股份有限公司项目经理,微软全球技术中心工程师。

3.公司高级管理人员

窦玉明先生,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,17年以上证券及基金从业经验,历任北京大学助教、副科长,中国证券监督管理委员会基金监管部副处长,上投摩根基金管理有限公司督察长。

黄峰先生,中欧基金管理有限公司督察长,中国籍,复旦大学经济硕士,23年以上证券及基金从业经验,历任上海受建信托公司纳内交易员,上海万国证券公司部门经理助理,南汇经理,中银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理,光大证券有限责任公司助理总经理,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,信息技术部总监,中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

周蔚文先生,中欧基金管理有限公司分管投资副总经理,兼任中欧基金管理有限公司投资总监,中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2011年5月起至今),中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理(自2011年8月起至今),中欧成世成长分级股票型证券投资基金基金经理(自2012年3月起至今),中国籍,北京大学管理科学与工程专业硕士,14年以上证券及基金从业经验,历任光大证券研究所研究员,富国基金管理有限公司研究员,高级研究员,富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理(自2006年11月起至2011年1月),中欧基金管理有限公司研究部总监。

4.本基金基金经理

(1)现任基金经理

裘争光先生,中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,中国籍,上海财经大学金融学专业硕士,7年以上证券从业经验,历任上海金信证券研究所有限责任公司研究员,中原证券股份有限公司证券研究所研究员,光大保德信基金管理有限公司研究员,中欧基金管理有限公司研究员,高级研究员,中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理助理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理,中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理,中欧货币市场基金基金经理助理,现任中欧基金管理有限公司中欧纯债分级债券型证券投资基金的基金经理(2013年1月31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(2013年4月11日起至今)。

凌辉女士,中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,中国籍,美国华威大学金融学专业硕士,5年以上证券从业经验,历任中欧基金管理有限公司培训生、助理研究员、研究员、金融工程研究员兼风控专员,中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理助理,现任中欧基金管理有限公司中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理(2013年5月17日起至今)。

(2)历任基金经理

张大方先生,于2011年9月1日至2013年4月11日期间担任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。

林钟斌先生,于2010年6月24日至2012年4月25日期间担任中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。

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:总经理刘建平先生、分管投资副总经理周蔚文先生、基金经理苟开红女士、基金经理聂曙光先生、专户投资总监陆文俊先生,其中总经理刘建平先生任投资决策委员会主席。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

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:人民币127.02亿元
托管部门联系人:刘峰
电话:021-62677777-212017
传真:021-62159217

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本127.02亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持"真诚服务,相伴成长"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2012年12月31日,兴业银行资产总额达到32,509.75亿元,归属于母公司股东权益1695.77亿元,不良贷款比率为0.43%,全年实现归属于母公司股东的净利润347.18亿元,在英国《银行家》杂志本月最新发布的2013年全球银行1000强排名中,兴业银行按一级资本排名第55位,按资产总额排名第50位,美国《财富》杂志公布了2013年《财富》世界500强排行榜,兴业银行(601166)入围并居榜单第428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,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室,共有员工97人,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2013年12月31日,兴业银行已托管开放式基金22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、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长股票型证券投资基金、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、兴全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、民生加银内需增长股票型证券投资基金、兴全保本混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、华安沪深300量化增强证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、易方达稳健回报债券型证券投资基金,托管基金财产规模370.81亿元。

(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、严格监察,确保业务的稳健运行,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风险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。各业务处室在各日常业务流程中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要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

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

(5)防火墙原则:托管部门与开展业务部门、托管业务与其他业务品种实行物理隔离。

(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)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,业务操作区相对独立,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式、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有违反《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,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,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的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,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。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

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:
1)中欧基金管理有限公司上海直销中心
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
联系人:顾丽萍
电话:021-68609602
传真:021-68609601
客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)
网址:www.defunds.com
2)中欧基金管理有限公司网上交易系统
网址:www.defunds.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
联系人:刘玲
电话:021-52629999
客服热线: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:王洪章
联系人:张静
电话:010-66275654
传真:010-66275654
客服热线:95533
网址:www.ccb.com
3)中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层
法定代表人:李国华
联系人:文亚娜
传真:010-68858117
客服热线:95580
网址:www.psbc.com
4)中国民生银行股份有限公司
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:董文标
联系人:董云巍
电话:010-58560666
传真:010-57092611
客服热线:95568
网站:www.cmbc.com.cn
5)招商银行股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
联系人:邓飞鹏
电话:0755-83198888
传真:0755-83195109
客服热线:95555
网址:www.cmbchina.com
6)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人:田国立
联系人:赵树林
电话:010-65556960
传真:010-65550828
客服热线:95558
网址:bank.ecitic.com
7)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:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
客服热线:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn
8)国信证券股份有限公司
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
法人代表人:何如
联系人:齐晓杰
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客服热线:95536
网址:www.guosen.com.cn
9)广发证券股份有限公司
住所:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
传真:020-87555305
客服热线:95575或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn
10)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:4008888108
传真:010-65182261
客服热线:4008888108
网址:www.csc108.com
11)国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:席静
传真:010-84183311-3389
电话:010-84183333
客服热线:400-818-8118
网址:www.guodu.com
12)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄正大五道口广场1号楼22层
法定代表人:兰荣
电话:0591-38162212
传真:0591-38507538
联系人:黄英
客服热线:95562
网址:www.xyzq.com.cn
13)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:林义相
联系人:林爽
电话:010-66045608
传真:010-66045521
客服热线:010-66045678
网址:www.txsec.com jijin.txsec.com
14)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:袁长清(代行)
联系人:刘慧
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客服热线:95525,4008888788,10108998
网址:www.ebscn.com
15)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
客服热线:0591-96326
网址:www.hfzq.com.cn
16)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010-88085201
传真:010-88085195
客服热线:4008-000-562,网址:www.hysec.com
17)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:陈有安
联系人:田薇
电话:010-66568888
传真:010-66568990
客服热线:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn
18)齐鲁证券有限公司
住所:济南市经七路86号
办公地址:济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889185
客服热线:95538
网址:www.qlzq.com.cn
19)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
联系人:李清怡
电话:021-54033888 或 21-54033888
传真:021-54038844
客服热线:95523 或 4008895523
网址:www.swhy.com.cn
20)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:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客服热线:95553
网址:www.htsec.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
法人代表:凤良志
联系人:李飞
电话:0551-2246298
传真:0551-2272100
客服热线:95578,4008888777
网址:www.gyzq.com.cn
22)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:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
传真:0755-82400862
客服热线:95511-8
网址:www.pingan.com
23)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海浦东新区商城路618号
办公地址:上海市静安区南京西路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:吴倩
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客服热线:4008888666
网址:www.gtja.com
24)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A02
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
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
联系人:陈剑虹
电话:0755-82558305
传真:0755-82558365
客服热线:4008-001-001
网址:www.essence.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9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
26)华泰证券股份有限公司
住所:南京市中山东路90号
办公地址:南京市中山东路90号
法定代表人:吴万善
联系人:万鸣
电话:025-83290979
传真:025-51863323
客服热线:95597
网址:www.htsc.com.cn
27)德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
联系人:叶露
电话:021-68761616
传真:021-68767880
客服热线:400-888-128
网址:www.tebon.com.cn
28)英大证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦西区11楼1105B
法定代表人:赵文安
联系人:李欣
电话:0755-83007179
传真:0755-83007167
客服热线:4008-698-698
网址:www.ydsc.com.cn
29)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈芝
电话:021-20370888
传真:010-60838888
客服热线:010-60833739
网址:www.citics.com
30)爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
联系人:陈敏
电话:021-32229888-25113
传真:021-68728703
客服热线:021-63340678
网址:www.ajzq.com
31)金元证券股份有限公司
住所:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人:杨咏
联系人:马贤清
电话:0755-83025022
客服热线:4008-888-228
网址:www.jyzq.cn
32)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客服热线:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn
33)中信证券(浙江)有限责任公司
住所:中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼
办公地址:中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼
法定代表人:沈强
联系人:周研
电话:0571-86078823
传真:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn
34)联讯证券股份有限责任公司
住所:广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼
办公地址:广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼
法定代表人:徐刚
联系人:张恺
电话:0752-2119391
客服热线:400-8888-929
网址:www.lxzq.com.cn
35)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼
办公地址:甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890619
客服热线:0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618
网址:www.hlzqgs.com
36)国联证券股份有限公司
住所:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号
法定代表人:雷建辉
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客服热线:95570
网址:www.glsc.com.cn
37)西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
网址:www.swsc.com.cn
38)东吴证券股份有限公司
住所:苏州市工业园区星阳街5号
办公地址:苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客服热线:4008601555
网址:www.dwzq.com.cn
39)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号 A座3层、5层
法定代表人:宋德清
联系人:黄恒
电话:010-58568235
传真:010-58568062
客服热线:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
40)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1_J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1_J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227953
传真:0755-82080798
客服热线:4006-788-887
众禄基金销售网:www.zlfund.cn
基金买卖网:www.jjmmw.com
41)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:0571-28829790
传真:0571-26698533
客服热线:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
42)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:021-58788678
传真:021-58787698
客服热线:400-089-1289
网址:www.erichfund.com
43)上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
电话:021-54509998-7019
传真:021-64385308
客服热线:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
44)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
电话:021-58870011
传真:021-68596916
客服热线:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
45)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38602377
传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
46)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区
法定代表人:王莉
电话:021-68419822
传真:021-68419822-8566
客服热线:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
47)北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:010-62020088
传真:010-62020088--8802
客服热线:400-888-6661
网址:www.myfp.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

2.场内发售机构
具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)

(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:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法人代表:金颖
联系人:朱立元
电话:010-59378839
传真:010-59378907

(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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:张振波
经办会计师:单峰 张振波

四、基金的名称

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

上市契约型开放式

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。

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、资产支持证券以及法律法规或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,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中被动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定。

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配。

在资产配置类别上,本基金投资于股票资产的比例为90%-95%,其中被动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

本基金被动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挑选其它品种予以替代。主动投资依据国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性,综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素对指数标的成份股及备选成份股进行优化;同时,根据研究员的研究成果,谨慎地挑选少数沪深300指数成份股及备选成份股以外的股票作为增强股票库,进入基金股票池,构建主动型投资组合。

(1)股票投资组合的构建

1)指数跟踪部分的构建策略

本基金在建仓期内,将按照沪深300指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在有效跟踪业绩比较基准的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。

2)指数增强部分投资策略

①成份股及备选成份股的增强型策略

从定量分析和定性分析两个角度进行考察,依据行业相对投资价值评估结果,精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行增强型配置。

由于沪深300指数成份股及备选成份股多为大盘蓝筹股,公司经营状况稳定,因而选择其中价值被低估的指数成份股及备选成份股进行个股增强型配置。在各行业内部根据成份股及备选成份股的价值因子的对比情况,将成份股及备选成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股及备选成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股及备选成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股及备选成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,有限度地增加价值被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限度地减少价值被高估的成份股及备选成份股的权重。

A.定量分析方面,主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选,在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,有限度地增加价值被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限度地减少价值被高估的成份股及备选成份股的权重。

B.定性分析方面,以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础,结合对我国行业周期轮动特征的考察,从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势,超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

②成份股及备选成份股以外的股票增强