

**中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2015年半年度报告**

**2015年6月30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**

**送出日期：2015年8月26日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2015年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 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	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 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贵金属投资明细	56
7.9 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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4	基金投资策略的改变 .....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8	其他重大事件 .....	61
§11	备查文件目录 .....	63
11.1	备查文件目录 .....	63
11.2	存放地点 .....	64
11.3	查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）
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
交易代码	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	78,710,170.11份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-08-16

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以沪深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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	张志永
	联系电话	021-68609600	021-62677777-212004
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95561
传真		021-33830351	021-62159217
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	福州市湖东路154号
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	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		窦玉明	高建平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	61,010,413.29
本期利润	40,556,478.74
加权平均基金份额本期利润	0.3239
本期加权平均净值利润率	23.37%
本期基金份额净值增长率	28.92%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	36,918,157.54
期末可供分配基金份额利润	0.4690
期末基金资产净值	121,253,293.38
期末基金份额净值	1.5405
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	60.34%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、所述基金业绩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。

## 3.2 基金净值表现

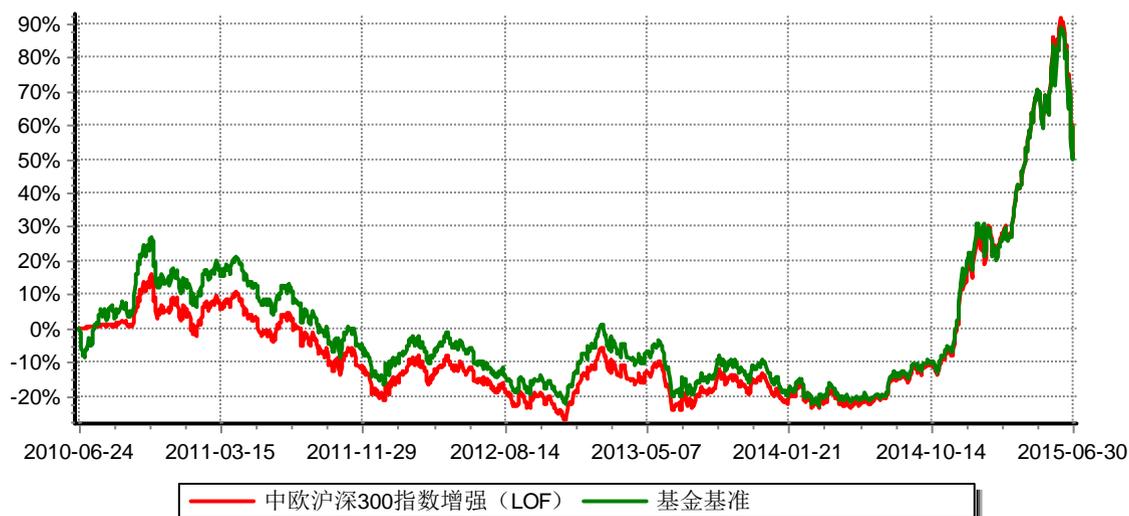
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-7.90%	3.33%	-7.18%	3.32%	-0.72%	0.01%
过去三个月	10.70%	2.49%	9.98%	2.48%	0.72%	0.01%
过去六个月	28.92%	2.19%	25.29%	2.15%	3.63%	0.04%
过去一年	103.18%	1.75%	99.67%	1.75%	3.51%	0.00%

过去三年	88.81%	1.41%	77.15%	1.42%	11.66%	-0.01%
自基金合同生效起至今	60.34%	1.33%	59.41%	1.38%	0.93%	-0.05%

注：本基金大类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的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少于基金资产净值的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。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，具有较强代表性的沪深300指数成为股票资产的标的指数，比较基准中股票的权重95%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券有限责任公司、北京百骏投资有限公司、万盛基业投资有限责任公司、窦玉明先生、刘建平先生、周蔚文先生、许欣先生和陆文俊先生，注册资本为1.88亿元人民币。截至2015年6月30日，本基金管理人共管理25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、中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）、中欧沪深300指数增

强型证券投资基金（LOF）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金、中欧价值智选回报混合型证券投资基金、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧明睿新起点混合型证券投资基金、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金和中欧永裕混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁争光	本基金基金经理，中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧价值智	2013年4月11日	2015年5月18日	9年	历任上海金信证券研究所研究员，中原证券研究所研究员，光大保德信基金研究员。2009年10月加入中欧基金管理有限公司至今，曾任研究员、高级研究员、基金经理助理、中欧纯债分级债券型证券投资基金的基金经理、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理，现任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧价值智选回报混合型证券投资基金

	选回报 混合型 证券投资 基金 基金经 理				基金经理。
曲径	本基金 基金经 理,事业 部负责 人	2015年5月 18日	—	8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月加入中 欧基金管理有限公司, 现 任事业部负责人, 中欧沪 深300指数增强型证券投 资基金（LOF）基金经理。

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合规守信情况的说明

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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施。公司将以此次现场检查为契机，认真落实上海监管局各项整改意见，进一步提升公司整体内部控制水平。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

伴随着杠杆型增量资金，上半年以推动经济转型为主题的牛市走出超出预期的火爆行情，部分题材个股已经呈现了较为明显的泡沫。在报告期内，我们在保持较高被动部分仓位的情况下，利用量化选股模型，精选了估值合理，成长性较高，同时具有国企改革预期的个股，作为主动配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为28.92%，同期业绩比较基准增长率为25.29%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，我们认为随着一轮去杠杆回调的结束，以沪深300成分股为代表的蓝筹股，将率先企稳。我们看好蓝筹股中医药、消费和金融等行业中估值合理、转型成长潜力高的个股。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,167,218.17	45,765,587.16
结算备付金		158,249.23	1,167.79
存出保证金		173,376.58	20,958.13
交易性金融资产	6.4.7.2	114,643,910.78	292,557,038.94
其中：股票投资		114,643,910.78	292,527,091.92
基金投资		—	—
债券投资		—	29,947.02
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		2,562,072.85	—
应收利息	6.4.7.5	3,142.35	10,248.06
应收股利		—	—
应收申购款		525,122.21	1,513,738.62
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		125,233,092.17	339,868,738.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	19,643,623.03
应付赎回款		3,502,627.78	2,646,377.85
应付管理人报酬		118,368.09	172,680.46

应付托管费		17,755.23	25,902.06
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	123,029.96	139,063.22
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	218,017.73	274,271.93
负债合计		3,979,798.79	22,901,918.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	78,710,170.11	265,269,910.92
未分配利润	6.4.7.10	42,543,123.27	51,696,909.23
所有者权益合计		121,253,293.38	316,966,820.15
负债和所有者权益总计		125,233,092.17	339,868,738.70

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.5405元，基金份额总额78,710,170.11份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		42,491,177.39	-4,538,706.90
1.利息收入		100,319.56	80,948.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,157.78	80,024.17
债券利息收入		3.19	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		1,158.59	924.31

其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,566,566.98	-1,689,036.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	61,643,416.55	-3,178,781.27
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	10,799.71	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	912,350.72	1,489,744.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-20,453,934.55	-2,935,671.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	278,225.40	5,052.02
<b>减：二、费用</b>		1,934,698.65	1,169,347.26
1. 管理人报酬		864,821.14	677,325.88
2. 托管费		129,723.19	101,598.86
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	628,012.10	83,768.46
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	312,142.22	306,654.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		40,556,478.74	-5,708,054.16
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		40,556,478.74	-5,708,054.16

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	265,269,910.92	51,696,909.23	316,966,820.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	40,556,478.74	40,556,478.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-186,559,740.81	-49,710,264.70	-236,270,005.51
其中：1.基金申购款	43,863,218.93	17,795,058.14	61,658,277.07
2.基金赎回款	-230,422,959.74	-67,505,322.84	-297,928,282.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	78,710,170.11	42,543,123.27	121,253,293.38
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	186,708,873.97	-39,420,425.24	147,288,448.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-5,708,054.16	-5,708,054.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-17,455,846.39	4,195,046.33	-13,260,800.06
其中：1.基金申购款	6,656,093.97	-1,521,051.74	5,135,042.23

2.基金赎回款	-24,111,940.36	5,716,098.07	-18,395,842.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	169,253,027.58	-40,933,433.07	128,319,594.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

管志斌

郭雅梅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第588号《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》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,201,873,408.58元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第163号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年6月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,202,197,493.33份基金份额，其中认购资金利息折合324,084.75份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第254号文审核同意，本基金57,032,620份基金份额于2010年8月16日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的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。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%。本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数，力求控制本基金的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%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2015年8月26日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。会计估计与最近一期年度报告相比，发生变更。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关

于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、

债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	7,167,218.17
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	7,167,218.17

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,200,126.66	114,643,910.78	27,443,784.12
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—

	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	87,200,126.66	114,643,910.78	27,443,784.12

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	3,007.52
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	64.08
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.55
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	70.20
合计	3,142.35

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	123,029.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	123,029.96

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	7,619.92
指数使用费	6,226.87
其他应付款	4,907.69
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	138,848.72
预提上市费	29,752.78
应付转换费	908.97
合计	218,017.73

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	265,269,910.92	265,269,910.92
本期申购	43,863,218.93	43,863,218.93
本期赎回（以“-”号填列）	-230,422,959.74	-230,422,959.74
本期末	78,710,170.11	78,710,170.11

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2015年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,479,298.00份(2014年6月30日)；

4,479,355.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为77,230,872.11份(2014年6月30日：164,773,672.58份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,504,099.86	67,201,009.09	51,696,909.23
本期利润	61,010,413.29	-20,453,934.55	40,556,478.74
本期基金份额交易产生的变动数	-8,588,155.89	-41,122,108.81	-49,710,264.70
其中：基金申购款	5,452,642.19	12,342,415.95	17,795,058.14
基金赎回款	-14,040,798.08	-53,464,524.76	-67,505,322.84
本期已分配利润	—	—	—
本期末	36,918,157.54	5,624,965.73	42,543,123.27

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	95,983.52
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	1,938.80
其他	1,235.46
合计	99,157.78

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	61,643,416.55

股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	61,643,416.55

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	279,683,271.39
减：卖出股票成本总额	218,039,854.84
买卖股票差价收入	61,643,416.55

注：买卖投资差价收入包含股票吸收合并产生的差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,799.71
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	10,799.71

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,008.20
减：卖出债券（债转股及债券	24,200.00

到期兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	8.49
买卖债券差价收入	10,799.71

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	912,350.72
基金投资产生的股利收益	—
合计	912,350.72

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-20,453,934.55
——股票投资	-20,448,187.53
——债券投资	-5,747.02
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—

合计	-20,453,934.55
----	----------------

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	258,876.63
转换费收入	19,348.77
合计	278,225.40

注：1. 本基金的场内赎回费率为赎回金额的0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	628,012.10
银行间市场交易费用	—
合计	628,012.10

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	138,848.72
银行费用	245.00
上市费	29,752.78
债券账户服务费	13,500.00
指数使用费	100,042.94

开户费	—
其他费用	—
合计	312,142.22

注：根据《中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》及《中证指数有限公司指数使用许可协议》，本基金的指数使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的0.016%，收取下限为每季度5万元。

在通常情况下，指数使用费按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：

日指数使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.016% / 当年天数。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司（“北京百骏”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.c.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东
窦玉明、刘建平、周蔚文、许欣、陆文俊	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	9,712,600.43	2.85%	8,348,448.35	16.76%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	8,842.36	2.85%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	7,600.52	16.76%	2,825.14	15.48%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 6.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券	35,008.20	100.00%	—	—

#### 6.4.10.1.5 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	864,821.14	677,325.88
其中：支付销售机构的客户维护费	222,257.80	174,172.62

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×1.00% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	129,723.19	101,598.86

注：支付基金托管人 兴业银行 的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 ×0.15% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
期初持有的基金份额	75,466.54	75,466.54
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	75,466.54	—
期末持有的基金份额	—	75,466.54
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	0.04%

注：本基金的基金管理人于2015年2月9日通过国都证券赎回75,466.54份，赎回费为220.76元，符合本基金招募说明书规定的赎回费率。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份 有限公司	7,167,218.17	95,983.52	10,320,045.09	79,491.25

注：本基金的银行存款由基金托管人 兴业银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
000024	招商地产	2015-04-03	筹划重大事项	31.64		—	15,357	266,018.53	485,895.48
000539	粤电力A	2015-06-08	筹划重大事项	11.94	2015-07-21	10.75	10,800	97,711.50	128,952.00
000543	皖能电力	2015-06-12	筹划重大事项	21.36	2015-07-14	19.22	14,400	250,361.00	307,584.00
000630	铜陵有色	2015-03-09	筹划重大事项	8.44		—	25,266	247,154.72	213,245.04
000709	河北钢铁	2015-06-30	筹划重大事项	7.00		—	39,228	145,074.44	274,596.00
000778	新兴铸管	2015-06-15	筹划重大事项	12.96		—	16,894	91,747.58	218,946.24
000793	华闻传媒	2015-05-26	筹划重大事项	20.75		—	14,406	175,634.06	298,924.50
000839	中信国安	2015-06-29	筹划重大事项	23.57		—	8,651	110,028.61	203,904.07
000878	云南铜业	2015-06-08	筹划重大事项	24.50		—	5,944	109,396.15	145,628.00
000917	电广传媒	2015-05-28	筹划重大事项	42.89		—	7,827	126,364.75	335,700.03
000963	华东医药	2015-06-26	筹划重大事项	71.48		—	1,981	93,732.76	141,601.88
002001	新和成	2015-06-30	筹划重大事项	17.09	2015-07-13	18.80	5,045	81,225.99	86,219.05

002292	奥飞动漫	2015-05-18	筹划重大事项	37.85		—	4,988	81,210.50	188,795.80
002309	中利科技	2015-06-02	筹划重大事项	33.39	2015-07-21	30.05	1,500	43,115.29	50,085.00
002310	东方园林	2015-05-27	筹划重大事项	38.30		—	4,638	74,922.08	177,635.40
002353	杰瑞股份	2015-05-27	筹划重大事项	44.35		—	5,789	166,880.91	256,742.15
002375	亚厦股份	2015-06-17	筹划重大事项	29.21	2015-07-20	26.29	4,802	63,046.58	140,266.42
002416	爱施德	2015-05-05	筹划重大事项	20.99	2015-07-29	18.60	2,719	35,810.52	57,071.81
002557	洽洽食品	2015-06-29	筹划重大事项	16.38		—	1,900	41,002.00	31,122.00
300094	国联水产	2015-06-29	筹划重大事项	31.14		—	11	391.42	342.54
600153	建发股份	2015-06-30	筹划重大事项	17.51		—	15,741	147,486.46	275,624.91
600277	亿利能源	2015-06-01	筹划重大事项	14.62		—	8,600	73,080.73	125,732.00
600395	盘江股份	2015-06-09	筹划重大事项	15.71		—	5,139	74,997.11	80,733.69
600886	国投电力	2015-06-24	筹划重大事项	14.87		—	35,364	237,980.42	525,862.68
600900	长江电力	2015-06-15	筹划重大事项	12.38		—	48,284	428,182.85	597,755.92
601021	春秋航空	2015-06-26	筹划重大事项	126.09	2015-07-21	130.14	1,100	146,042.22	138,699.00
601111	中国国航	2015-06-30	筹划重大事项	15.36	2015-07-29	14.50	23,606	252,872.21	362,588.16
601216	内蒙君正	2015-06-29	筹划重大事项	24.07	2015-07-02	21.66	5,680	56,481.74	136,717.60
601663	长城汽车	2015-06-19	筹划重大事项	36.69	2015-07-13	44.89	4,658	142,224.14	170,902.02

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票指数增强型基金，以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数，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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控

制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2014年12月31日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2015年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,167,218.17	—	—	—	7,167,218.17
结算备付金	158,249.23	—	—	—	158,249.23
存出保证金	173,376.58	—	—	—	173,376.58
交易性金融资产	—	—	—	114,643,910.78	114,643,910.78
应收证券清算款	—	—	—	2,562,072.85	2,562,072.85
应收利息	—	—	—	3,142.35	3,142.35
应收申购款	13,622.13			511,500.08	525,122.21
资产总计	7,512,466.11	—	—	117,720,626.06	125,233,092.17
负债					
应付赎回款	—	—	—	3,502,627.78	3,502,627.78
应付管理人报酬	—	—	—	118,368.09	118,368.09
应付托管费	—	—	—	17,755.23	17,755.23
应付交易费用	—	—	—	123,029.96	123,029.96
其他负债	—	—	—	218,017.73	218,017.73
负债总计	—	—	—	3,979,798.79	3,979,798.79
利率敏感度缺	7,512,466.11	—	—	113,740,827.27	121,253,293.38

口					
上年度末 2014年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,765,587.16	—	—	—	45,765,587.16
结算备付金	1,167.79	—	—	—	1,167.79
存出保证金	20,958.13	—	—	—	20,958.13
交易性金融资产	—	—	29,947.02	292,527,091.92	292,557,038.94
应收利息	—	—	—	10,248.06	10,248.06
应收申购款	—	—	—	1,513,738.62	1,513,738.62
资产总计	45,787,713.08	—	29,947.02	294,051,078.60	339,868,738.70
负债					
应付证券清算款	—	—	—	19,643,623.03	19,643,623.03
应付赎回款	—	—	—	2,646,377.85	2,646,377.85
应付管理人报酬	—	—	—	172,680.46	172,680.46
应付托管费	—	—	—	25,902.06	25,902.06
应付交易费用	—	—	—	139,063.22	139,063.22
其他负债	—	—	—	274,271.93	274,271.93
负债总计	—	—	—	22,901,918.55	22,901,918.55
利率敏感度缺口	45,787,713.08	—	29,947.02	271,149,160.05	316,966,820.15

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金未持有债券资产(2014年12月31日：基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以沪深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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	114,643,910.78	94.55	292,527,091.92	92.29
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	114,643,910.78	94.55	292,527,091.92	92.29

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	608.42	1,509.82
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-608.42	-1,509.82

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 公允价值
  - (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

- (b) 持续的以公允价值计量的金融工具
  - (i) 各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为108,486,037.39元，属于第二层次的余额为6,157,873.39元，无属于第三层次的余额。（2014年12月31日：第一层次289,672,145.69元，第二层次2,884,893.25元，无第三层次）。于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注6.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	114,643,910.78	91.54
	其中：股票	114,643,910.78	91.54
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	7,325,467.40	5.85
7	其他资产	3,263,713.99	2.61
8	合计	125,233,092.17	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	255,768.60	0.21
B	采矿业	4,961,792.98	4.09
C	制造业	35,774,227.89	29.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,542,895.83	3.75
E	建筑业	4,708,314.49	3.88
F	批发和零售业	2,260,279.88	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	4,349,696.99	3.59

H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,031,104.00	4.97
J	金融业	36,429,547.83	30.04
K	房地产业	4,329,774.74	3.57
L	租赁和商务服务业	1,086,123.74	0.90
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	857,151.63	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	117,716.74	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,341,402.36	1.11
S	综合	293,638.10	0.24
	合计	107,339,435.80	88.52

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	342.54	—
B	采矿业	602,647.00	0.50
C	制造业	1,922,359.00	1.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	307,584.00	0.25
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	233,631.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	480,670.00	0.40
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	604,678.94	0.50
K	房地产业	3,133,806.50	2.58
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	—	—
S	综合	18,756.00	0.02
	合计	7,304,474.98	6.02

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	510,534	5,074,707.96	4.19
2	601318	中国平安	48,973	4,012,847.62	3.31
3	600036	招商银行	152,351	2,852,010.72	2.35
4	600030	中信证券	72,716	1,956,787.56	1.61
5	600000	浦发银行	103,338	1,752,612.48	1.45
6	600837	海通证券	73,210	1,595,978.00	1.32
7	601766	中国中车	82,996	1,523,806.56	1.26
8	601328	交通银行	181,193	1,493,030.32	1.23
9	000651	格力电器	22,238	1,421,008.20	1.17
10	000002	万科A	89,565	1,300,483.80	1.07
11	601989	中国重工	84,734	1,254,063.20	1.03
12	601398	工商银行	224,001	1,182,725.28	0.98
13	601668	中国建筑	135,728	1,127,899.68	0.93
14	600519	贵州茅台	4,228	1,089,344.20	0.90
15	600887	伊利股份	55,486	1,048,685.40	0.86
16	601169	北京银行	77,981	1,038,706.92	0.86
17	601818	光大银行	180,104	965,357.44	0.80
18	601988	中国银行	196,825	962,474.25	0.79
19	601288	农业银行	244,382	906,657.22	0.75

20	601601	中国太保	29,040	876,427.20	0.72
21	601390	中国中铁	61,874	847,055.06	0.70
22	000001	平安银行	52,884	768,933.36	0.63
23	601006	大秦铁路	53,853	756,096.12	0.62
24	000333	美的集团	19,502	727,034.56	0.60
25	601688	华泰证券	30,274	700,237.62	0.58
26	600104	上汽集团	30,542	690,249.20	0.57
27	300059	东方财富	10,900	687,681.00	0.57
28	600028	中国石化	97,092	685,469.52	0.57
29	600048	保利地产	59,411	678,473.62	0.56
30	000166	申万宏源	41,132	668,395.00	0.55
31	600015	华夏银行	41,155	625,967.55	0.52
32	002024	苏宁云商	40,875	625,387.50	0.52
33	600795	国电电力	88,922	619,786.34	0.51
34	000776	广发证券	27,285	618,005.25	0.51
35	600900	长江电力	48,284	597,755.92	0.49
36	600050	中国联通	78,286	573,836.38	0.47
37	600999	招商证券	21,471	568,122.66	0.47
38	000858	五粮液	17,504	554,876.80	0.46
39	600011	华能国际	38,795	544,293.85	0.45
40	601939	建设银行	75,612	539,113.56	0.44
41	000768	中航飞机	12,256	534,116.48	0.44
42	600886	国投电力	35,364	525,862.68	0.43
43	601377	兴业证券	38,370	525,285.30	0.43
44	600570	恒生电子	4,600	515,430.00	0.43
45	600637	东方明珠	12,079	508,284.32	0.42
46	601857	中国石油	44,825	507,867.25	0.42
47	002415	海康威视	11,288	505,702.40	0.42
48	600518	康美药业	28,378	503,141.94	0.41
49	000725	京东方A	93,997	487,844.43	0.40

50	000024	招商地产	15,357	485,895.48	0.40
51	601628	中国人寿	15,384	481,826.88	0.40
52	600276	恒瑞医药	10,810	481,477.40	0.40
53	600705	中航资本	20,730	479,899.50	0.40
54	600029	南方航空	32,389	470,936.06	0.39
55	601336	新华保险	7,684	469,185.04	0.39
56	600010	包钢股份	90,198	468,127.62	0.39
57	601899	紫金矿业	87,566	448,337.92	0.37
58	000100	TCL 集团	78,899	445,779.35	0.37
59	601186	中国铁建	28,456	444,767.28	0.37
60	000625	长安汽车	20,830	440,554.50	0.36
61	300104	乐视网	8,500	439,960.00	0.36
62	000069	华侨城 A	33,557	435,569.86	0.36
63	601669	中国电建	38,080	431,827.20	0.36
64	000063	中兴通讯	18,117	431,365.77	0.36
65	000783	长江证券	30,684	428,041.80	0.35
66	600690	青岛海尔	14,109	427,925.97	0.35
67	600703	三安光电	13,275	415,507.50	0.34
68	000728	国元证券	10,902	414,057.96	0.34
69	000538	云南白药	4,776	412,025.52	0.34
70	600109	国金证券	16,798	409,871.20	0.34
71	601727	上海电气	27,300	407,589.00	0.34
72	002450	康得新	13,190	403,614.00	0.33
73	601009	南京银行	17,568	400,550.40	0.33
74	600019	宝钢股份	45,653	399,007.22	0.33
75	600585	海螺水泥	18,485	396,503.25	0.33
76	600115	东方航空	31,341	386,121.12	0.32
77	600415	小商品城	25,164	384,505.92	0.32
78	601088	中国神华	18,298	381,513.30	0.31
79	601600	中国铝业	40,446	377,361.18	0.31

80	600111	北方稀土	20,174	365,956.36	0.30
81	601111	中国国航	23,606	362,588.16	0.30
82	601901	方正证券	30,282	360,052.98	0.30
83	600089	特变电工	23,975	355,069.75	0.29
84	000338	潍柴动力	11,166	353,515.56	0.29
85	600221	海南航空	54,559	348,632.01	0.29
86	600100	同方股份	16,461	345,516.39	0.28
87	601919	中国远洋	27,600	344,448.00	0.28
88	600031	三一重工	35,143	340,535.67	0.28
89	600583	海油工程	20,402	339,897.32	0.28
90	601788	光大证券	12,600	339,570.00	0.28
91	600839	四川长虹	34,142	335,957.28	0.28
92	000917	电广传媒	7,827	335,700.03	0.28
93	600271	航天信息	5,141	332,674.11	0.27
94	000157	中联重科	40,571	329,030.81	0.27
95	600150	中国船舶	6,330	325,995.00	0.27
96	601618	中国中冶	44,998	325,335.54	0.27
97	000503	海虹控股	6,627	324,723.00	0.27
98	300024	机器人	4,200	324,492.00	0.27
99	002142	宁波银行	15,022	317,715.30	0.26
100	601018	宁波港	35,460	313,466.40	0.26
101	000402	金融街	22,067	311,806.71	0.26
102	600118	中国卫星	5,446	310,204.16	0.26
103	600196	复星医药	10,576	306,069.44	0.25
104	600804	XD鹏博士	10,242	305,826.12	0.25
105	300027	华谊兄弟	8,000	305,120.00	0.25
106	600256	广汇能源	28,971	301,298.40	0.25
107	000793	华闻传媒	14,406	298,924.50	0.25
108	600588	用友网络	6,515	298,908.20	0.25
109	600068	葛洲坝	25,460	297,627.40	0.25

110	600352	浙江龙盛	21,002	297,598.34	0.25
111	600340	华夏幸福	9,738	296,522.10	0.24
112	600535	天士力	5,953	296,221.28	0.24
113	601099	太平洋	22,800	294,576.00	0.24
114	002673	西部证券	10,320	292,778.40	0.24
115	002304	洋河股份	4,210	292,005.60	0.24
116	601106	中国一重	24,100	291,851.00	0.24
117	600893	中航动力	5,443	289,295.45	0.24
118	002736	国信证券	11,300	283,517.00	0.23
119	600009	上海机场	8,858	280,798.60	0.23
120	600958	东方证券	9,800	280,476.00	0.23
121	601866	中海集运	29,305	278,397.50	0.23
122	600406	国电南瑞	13,412	277,494.28	0.23
123	600739	辽宁成大	11,278	275,747.10	0.23
124	002202	金风科技	14,160	275,695.20	0.23
125	600649	城投控股	29,481	275,647.35	0.23
126	600153	建发股份	15,741	275,624.91	0.23
127	000709	河北钢铁	39,228	274,596.00	0.23
128	002230	科大讯飞	7,805	272,706.70	0.22
129	000423	东阿阿胶	4,855	264,597.50	0.22
130	600177	雅戈尔	14,396	262,870.96	0.22
131	600005	武钢股份	37,300	262,219.00	0.22
132	600383	金地集团	20,686	261,677.90	0.22
133	601333	广深铁路	31,276	257,088.72	0.21
134	000039	中集集团	7,958	257,043.40	0.21
135	002353	杰瑞股份	5,789	256,742.15	0.21
136	601555	东吴证券	12,487	255,608.89	0.21
137	600369	西南证券	12,990	255,253.50	0.21
138	600674	川投能源	20,396	255,153.96	0.21
139	002241	歌尔声学	7,071	253,848.90	0.21

140	600066	宇通客车	12,321	253,196.55	0.21
141	600023	浙能电力	25,074	248,734.08	0.21
142	601800	XD中国交	14,053	246,770.68	0.20
143	601888	中国国旅	3,649	241,928.70	0.20
144	600309	万华化学	9,943	240,421.74	0.20
145	300070	碧水源	4,900	239,071.00	0.20
146	002594	比亚迪	4,302	237,599.46	0.20
147	002465	海格通信	7,353	236,693.07	0.20
148	000559	万向钱潮	10,580	231,278.80	0.19
149	002081	金螳螂	8,153	229,833.07	0.19
150	600085	同仁堂	6,356	228,243.96	0.19
151	000060	中金岭南	12,223	227,225.57	0.19
152	600875	东方电气	11,059	226,377.73	0.19
153	600398	海澜之家	12,416	225,102.08	0.19
154	002008	大族激光	7,796	223,901.12	0.18
155	601991	大唐发电	27,700	221,046.00	0.18
156	000623	吉林敖东	6,574	220,886.40	0.18
157	600863	内蒙华电	26,824	219,420.32	0.18
158	000778	新兴铸管	16,894	218,946.24	0.18
159	600027	华电国际	19,685	218,897.20	0.18
160	601933	永辉超市	18,767	217,509.53	0.18
161	600688	上海石化	20,254	217,325.42	0.18
162	600315	上海家化	4,955	215,047.00	0.18
163	000750	国海证券	12,789	214,855.20	0.18
164	600157	永泰能源	31,039	213,548.32	0.18
165	000630	铜陵有色	25,266	213,245.04	0.18
166	000629	攀钢钒钛	39,652	212,534.72	0.18
167	000686	东北证券	10,879	211,814.13	0.17
168	000568	泸州老窖	6,488	211,573.68	0.17
169	002500	山西证券	11,651	210,766.59	0.17

170	300017	网宿科技	4,538	210,653.96	0.17
171	600642	申能股份	21,039	210,600.39	0.17
172	300124	汇川技术	4,300	206,400.00	0.17
173	600741	华域汽车	9,571	204,340.85	0.17
174	000839	中信国安	8,651	203,904.07	0.17
175	002065	东华软件	7,076	203,435.00	0.17
176	601998	中信银行	26,049	200,837.79	0.17
177	300058	蓝色光标	12,492	197,498.52	0.16
178	601607	上海医药	8,846	197,000.42	0.16
179	000895	双汇发展	9,147	195,105.51	0.16
180	601179	中国西电	18,918	193,909.50	0.16
181	601898	中煤能源	16,936	193,409.12	0.16
182	002456	欧菲光	5,726	193,195.24	0.16
183	600252	中恒集团	8,374	192,602.00	0.16
184	601168	西部矿业	17,564	191,798.88	0.16
185	000009	中国宝安	11,714	191,055.34	0.16
186	002292	奥飞动漫	4,988	188,795.80	0.16
187	000800	一汽轿车	7,557	188,018.16	0.16
188	002385	大北农	13,853	187,292.56	0.15
189	600018	上港集团	23,530	186,122.30	0.15
190	600663	陆家嘴	3,741	186,077.34	0.15
191	000876	新希望	9,581	185,967.21	0.15
192	600660	福耀玻璃	12,898	184,183.44	0.15
193	000046	泛海控股	12,500	183,125.00	0.15
194	300003	乐普医疗	4,500	182,565.00	0.15
195	000826	桑德环境	4,693	182,510.77	0.15
196	600873	梅花生物	17,217	179,745.48	0.15
197	601117	中国化学	18,255	178,533.90	0.15
198	600060	海信电器	7,244	178,129.96	0.15
199	002310	东方园林	4,638	177,635.40	0.15

200	002146	荣盛发展	14,108	176,350.00	0.15
201	600489	中金黄金	13,629	175,405.23	0.14
202	600208	新潮中宝	22,502	173,715.44	0.14
203	000425	徐工机械	13,090	173,704.30	0.14
204	002236	大华股份	5,397	172,272.24	0.14
205	000883	湖北能源	19,745	172,176.40	0.14
206	600718	东软集团	7,910	171,884.30	0.14
207	601633	长城汽车	4,658	170,902.02	0.14
208	600372	中航电子	4,880	170,458.40	0.14
209	600332	白云山	4,919	169,508.74	0.14
210	000581	威孚高科	5,454	169,019.46	0.14
211	300002	神州泰岳	11,056	168,493.44	0.14
212	000792	盐湖股份	5,921	168,037.98	0.14
213	002129	中环股份	8,485	167,918.15	0.14
214	600362	江西铜业	7,688	165,368.88	0.14
215	002252	上海莱士	2,500	163,600.00	0.13
216	601258	庞大集团	29,914	163,330.44	0.13
217	000970	中科三环	7,855	161,891.55	0.13
218	600547	山东黄金	6,534	161,389.80	0.13
219	600867	通化东宝	7,346	161,097.78	0.13
220	000061	农产品	7,868	160,507.20	0.13
221	000598	兴蓉环境	16,505	157,952.85	0.13
222	002475	立讯精密	4,600	155,526.00	0.13
223	600170	上海建工	16,453	154,329.14	0.13
224	601808	中海油服	5,472	152,887.68	0.13
225	000413	东旭光电	15,600	152,568.00	0.13
226	601225	陕西煤业	18,500	151,330.00	0.12
227	601098	中南传媒	6,596	151,114.36	0.12
228	600600	青岛啤酒	3,229	150,439.11	0.12
229	000825	太钢不锈	21,000	149,310.00	0.12

230	600108	亚盛集团	14,370	148,873.20	0.12
231	600827	百联股份	7,101	147,771.81	0.12
232	002410	广联达	6,250	146,250.00	0.12
233	000878	云南铜业	5,944	145,628.00	0.12
234	000712	锦龙股份	4,100	143,910.00	0.12
235	002153	石基信息	1,100	142,989.00	0.12
236	002038	双鹭药业	2,503	141,794.95	0.12
237	000963	华东医药	1,981	141,601.88	0.12
238	002375	亚厦股份	4,802	140,266.42	0.12
239	000400	许继电气	5,562	139,939.92	0.12
240	601021	春秋航空	1,100	138,699.00	0.11
241	000983	西山煤电	14,576	138,180.48	0.11
242	000831	五矿稀土	5,386	137,773.88	0.11
243	600316	洪都航空	3,961	136,971.38	0.11
244	601216	内蒙君正	5,680	136,717.60	0.11
245	600038	中直股份	2,200	136,290.00	0.11
246	000738	中航动控	4,100	135,956.00	0.11
247	600166	福田汽车	15,362	135,646.46	0.11
248	000729	燕京啤酒	12,967	134,856.80	0.11
249	600497	驰宏锌锗	9,242	134,840.78	0.11
250	002422	科伦药业	3,342	133,813.68	0.11
251	600597	光明乳业	5,632	129,536.00	0.11
252	000539	粤电力A	10,800	128,952.00	0.11
253	000960	锡业股份	6,339	127,730.85	0.11
254	600008	首创股份	8,900	127,715.00	0.11
255	002470	金正大	5,800	125,918.00	0.10
256	600277	亿利能源	8,600	125,732.00	0.10
257	000898	鞍钢股份	17,000	124,100.00	0.10
258	000027	深圳能源	9,950	122,882.50	0.10
259	600373	中文传媒	5,100	122,196.00	0.10

260	603000	人民网	2,340	121,984.20	0.10
261	601929	吉视传媒	8,000	120,960.00	0.10
262	002007	华兰生物	2,680	118,697.20	0.10
263	300015	爱尔眼科	3,649	117,716.74	0.10
264	601928	凤凰传媒	6,824	116,690.40	0.10
265	600717	天津港	7,700	115,423.00	0.10
266	600578	京能电力	12,800	114,304.00	0.09
267	600348	阳泉煤业	11,076	113,529.00	0.09
268	600516	方大炭素	9,529	113,490.39	0.09
269	000999	华润三九	3,660	111,227.40	0.09
270	600317	营口港	17,600	110,880.00	0.09
271	601992	金隅股份	9,064	108,314.80	0.09
272	600633	浙报传媒	5,500	107,800.00	0.09
273	601118	海南橡胶	10,930	106,895.40	0.09
274	601699	潞安环能	11,027	106,631.09	0.09
275	002051	中工国际	3,574	106,433.72	0.09
276	300146	汤臣倍健	2,700	106,056.00	0.09
277	600783	鲁信创投	2,737	102,582.76	0.08
278	002344	海宁皮城	5,180	101,683.40	0.08
279	600549	厦门钨业	4,017	101,469.42	0.08
280	300251	光线传媒	4,000	99,600.00	0.08
281	601958	金钼股份	8,305	97,832.90	0.08
282	300133	华策影视	3,600	97,200.00	0.08
283	002570	贝因美	4,695	91,129.95	0.08
284	600648	XD外高桥	2,583	90,611.64	0.07
285	002001	新 和 成	5,045	86,219.05	0.07
286	002294	信立泰	2,898	82,882.80	0.07
287	600395	盘江股份	5,139	80,733.69	0.07
288	000937	冀中能源	9,811	78,684.22	0.06
289	002399	海普瑞	2,218	75,389.82	0.06

290	600998	九州通	3,069	68,622.84	0.06
291	600809	山西汾酒	2,383	67,295.92	0.06
292	603288	海天味业	1,973	63,017.62	0.05
293	601158	重庆水务	5,341	57,362.34	0.05
294	002416	爱施德	2,719	57,071.81	0.05
295	600485	信威集团	1,300	57,057.00	0.05
296	002653	海思科	1,979	53,433.00	0.04
297	600188	兖州煤业	3,572	49,115.00	0.04
298	000156	华数传媒	1,195	42,757.10	0.04
299	601231	环旭电子	2,038	34,666.38	0.03
300	603993	洛阳钼业	2,801	34,620.36	0.03
301	601969	海南矿业	600	10,938.00	0.01
302	600267	海正药业	12	225.48	—

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000926	福星股份	72,300	1,020,153.00	0.84
2	000965	天保基建	76,500	829,260.00	0.68
3	600005	武钢股份	116,000	815,480.00	0.67
4	600657	信达地产	96,700	796,808.00	0.66
5	002736	国信证券	24,100	604,669.00	0.50
6	600397	安源煤业	57,700	557,959.00	0.46
7	002013	中航机电	19,900	554,215.00	0.46
8	600064	南京高科	23,100	450,450.00	0.37
9	000543	皖能电力	14,400	307,584.00	0.25
10	600500	中化国际	15,700	274,436.00	0.23
11	000900	现代投资	19,500	200,070.00	0.17
12	600269	赣粤高速	27,600	187,680.00	0.15
13	600811	东方集团	6,900	85,077.00	0.07

14	600717	天津港	4,400	65,956.00	0.05
15	002309	中利科技	1,500	50,085.00	0.04
16	600122	宏图高科	2,800	45,976.00	0.04
17	600123	兰花科创	3,800	44,688.00	0.04
18	000933	神火股份	4,500	42,390.00	0.03
19	600859	王府井	1,300	40,950.00	0.03
20	600823	世茂股份	2,850	37,135.50	0.03
21	600062	华润双鹤	1,300	33,852.00	0.03
22	600858	银座股份	2,400	32,928.00	0.03
23	002557	洽洽食品	1,900	31,122.00	0.03
24	000501	鄂武商A	1,400	28,700.00	0.02
25	600026	中海发展	2,100	26,964.00	0.02
26	600219	南山铝业	2,000	20,180.00	0.02
27	601677	明泰铝业	1,200	19,644.00	0.02
28	000488	晨鸣纸业	2,100	18,837.00	0.02
29	600805	XD悦达投	1,200	18,756.00	0.02
30	600216	浙江医药	1,400	18,592.00	0.02
31	000726	鲁泰A	1,300	18,070.00	0.01
32	601233	桐昆股份	700	13,972.00	0.01
33	000703	恒逸石化	900	11,484.00	0.01
34	300094	国联水产	11	342.54	0.00
35	600016	民生银行	1	9.94	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002223	鱼跃医疗	4,689,602.97	1.48
2	603288	海天味业	4,511,249.02	1.42
3	600876	洛阳玻璃	2,785,442.00	0.88

4	600016	民生银行	2,759,570.00	0.87
5	000965	天保基建	2,136,275.00	0.67
6	000926	福星股份	1,401,483.00	0.44
7	000809	铁岭新城	1,374,249.00	0.43
8	600657	信达地产	1,370,224.00	0.43
9	601318	中国平安	1,322,957.00	0.42
10	601988	中国银行	1,072,050.00	0.34
11	600005	武钢股份	1,042,719.00	0.33
12	002736	国信证券	1,013,518.00	0.32
13	601766	中国中车	945,747.91	0.30
14	601677	明泰铝业	926,687.00	0.29
15	300059	东方财富	836,367.00	0.26
16	600325	华发股份	707,824.00	0.22
17	600064	南京高科	690,773.00	0.22
18	002013	中航机电	690,720.00	0.22
19	300248	新开普	643,713.74	0.20
20	600397	安源煤业	640,455.00	0.20

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	14,046,399.90	4.43
2	601318	中国平安	10,639,230.71	3.36
3	600036	招商银行	6,961,204.66	2.20
4	002223	鱼跃医疗	6,446,326.56	2.03
5	600030	中信证券	6,378,177.00	2.01
6	603288	海天味业	5,769,019.88	1.82
7	600837	海通证券	4,916,294.00	1.55
8	600000	浦发银行	4,685,218.00	1.48

9	000002	万科A	4,393,923.00	1.39
10	601328	交通银行	2,943,223.00	0.93
11	000651	格力电器	2,899,692.45	0.91
12	600519	贵州茅台	2,885,383.99	0.91
13	601668	中国建筑	2,825,151.97	0.89
14	601601	中国太保	2,777,123.00	0.88
15	601766	中国中车	2,768,887.00	0.87
16	600876	洛阳玻璃	2,638,641.56	0.83
17	601288	农业银行	2,519,215.00	0.79
18	000001	平安银行	2,482,971.68	0.78
19	601818	光大银行	2,478,602.00	0.78
20	600048	保利地产	2,467,830.00	0.78

注：：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	60,604,861.23
卖出股票的收入（成交）总额	279,683,271.39

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	173,376.58
2	应收证券清算款	2,562,072.85
3	应收股利	—
4	应收利息	3,142.35
5	应收申购款	525,122.21
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,263,713.99

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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。

##### 7.12.5.2 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
3,762	20,922.43	3,765,880.54	4.78%	74,944,289.57	95.22%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李坚	200,006.00	13.52%
2	周德	100,000.00	6.76%
3	陆春荣	62,300.00	4.21%
4	徐立新	49,400.00	3.34%

5	汪秀娣	48,705.00	3.29%
6	章幼玲	44,100.00	2.98%
7	孙立荣	43,300.00	2.93%
8	许传凤	42,211.00	2.85%
9	赵开洪	40,001.00	2.70%
10	乔爱科	39,300.00	2.66%

注：以上均为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	841.55	0.0011%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年6月24日)基金份额总额	1,202,197,493.33
本报告期期初基金份额总额	265,269,910.92
本报告期基金总申购份额	43,863,218.93
减：本报告期基金总赎回份额	230,422,959.74
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	78,710,170.11

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2015年5月20日发布公告，袁争光先生自2015年5月18日起不再担任本基金基金经理一职，曲径女士自2015年5月18日起担任本基金基金经理职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

本报告期内，基金管理人于2015年6月20日发布公告，卢纯青女士自2015年6月18日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务，周蔚文先生不再担任副总经理一职。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国金证券	1	119,452,042.51	35.1%	108,749.41	35.1%	0.351
长江证券	1	66,199,602.74	19.45%	60,268.15	19.45%	0.1945
华泰证券	1	49,350,305.52	14.5%	44,928.82	14.5%	0.145
光大证券	1	36,388,629.65	10.69%	33,128.67	10.69%	0.1069
国海证券	1	28,517,283.66	8.38%	25,962.68	8.38%	0.0838
东方证券	1	14,156,080.81	4.16%	12,887.8	4.16%	0.0416
国都证券	1	9,712,600.43	2.85%	8,842.36	2.85%	0.0285
瑞银证券	1	6,729,543.72	1.98%	6,126.54	1.98%	0.0198
招商证券	1	6,144,193.58	1.81%	5,593.75	1.81%	0.0181
中信证券	1	3,637,850	1.07%	3,311.92	1.07%	0.0107
申银万国	1	—	—	—	—	0
招商证券	1	—	—	—	—	
海通证券	1	—	—	—	—	
西部证券	1	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	
中金公司	1	—	—	—	—	

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2、本报告期内新增中信证券深圳交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金	占当期债券	成交金	占当期债券	成交	占当期权证

	额	成交总额比例	额	回购成交总 额比例	金额	成交总额比 例
国金证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	300,000	6.12%	—	—
光大证券	—	—	4,600,000	93.88%	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	35,008.2	100%	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下基金2014年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	公司网站	2015-01-01
2	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2014年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-01-20
3	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通定期定额投资业务的	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-01-27

	公告		
4	中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2015年第1号)	公司网站	2015-02-06
5	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(2015年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-02-06
6	中欧基金管理有限公司关于新增中国国际金融有限公司为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-19
7	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-20
8	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（正文）	公司网站	2015-03-27
9	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-27
10	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-28
11	关于调整旗下部分基金持有“海虹控股”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-04-08
12	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）2015年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-04-22
13	中欧基金管理有限公司关于开展官方淘宝店基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-05-12
14	中欧基金管理有限公司关于调整旗下基金单笔最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2015-05-12

	告	公司网站	
15	中欧基金管理有限公司关于开展官网支付宝客户费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-05-15
16	中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-05-20
17	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中国南车”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-05-22
18	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-06-10
19	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-06-10
20	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长城汽车”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-06-27
21	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长江电力”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-06-30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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

## 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

## 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.zofund.com](http://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

二〇一五年八月二十六日