

**中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2014年半年度报告**

**2014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：中国邮政储蓄银行股份有限公司**

**送出日期：2014年8月27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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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2014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	9
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47

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 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	50
§11	备查文件目录 .....	51
11.1	备查文件目录 .....	51
11.2	存放地点 .....	52
11.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	中欧中小盘股票（LOF）
场内简称	中欧小盘
基金主代码	166006
交易代码	166006
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2009年12月30日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,237,345,723.97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年3月26日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业，特别是处于加速成长期的中小型企业，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金将结合"自上而下"的资产配置策略和"自下而上"的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司。同时，结合盈利预测动态调整策略和动量策略，动态调整股票持仓结构。
业绩比较基准	$40\% \times \text{天相中盘指数收益率} + 40\% \times \text{天相小盘指数收益率} + 20\% \times \text{中信标普全债指数收益率}$
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。

## 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	胡涛
	联系电话	021-68609600	010-68858112
	电子邮箱	liyihai@lcfunds.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95580
传真		021-33830351	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		窦玉明	李国华

## 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.lcfunds.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（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	-101,897,828.22
本期利润	5,095,805.80
加权平均基金份额本期利润	0.0092
本期加权平均净值利润率	1.34%
本期基金份额净值增长率	-4.29%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-391,888,022.60
期末可供分配基金份额利润	-0.3167
期末基金资产净值	868,950,450.55
期末基金份额净值	0.7023
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-26.52%

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.上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

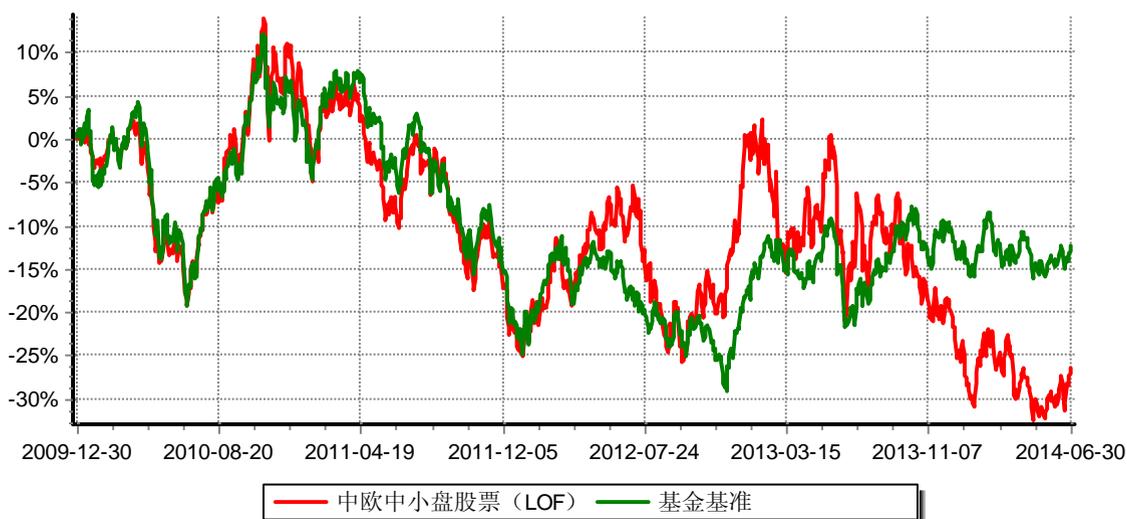
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.39%	1.40%	2.01%	0.72%	3.38%	0.68%
过去三个月	4.93%	1.11%	2.48%	0.76%	2.45%	0.35%
过去六个月	-4.29%	1.35%	-0.13%	0.90%	-4.16%	0.45%
过去一年	-13.81%	1.52%	11.20%	0.97%	-25.01%	0.55%

过去三年	-23.21%	1.60%	-11.43%	1.09%	-11.78%	0.51%
自基金合同生效起至今	-26.52%	1.51%	-12.31%	1.15%	-14.21%	0.36%

注：本基金大类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，债券、货币市场工具、权证、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占基金资产的5%-40%，其中现金及投资于到期日在一年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即股票资产和债券资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上，我们选择具有较强代表性的天相中盘指数、天相小盘指数和中信标普全债指数作为两个大类资产的标的指数。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分80%（天相中盘指数和天相小盘指数各占40%），债券部分20%。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

中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2009年12月30日-2014年6月30日）



注：本基金合同生效日为2009年12月30日，建仓期为2009年12月30日至2010年6月29日，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 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2014年6月30日，本基金管理人共管理16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）、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、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、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和中欧纯债添利分级债券型证券投资基金。

### 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		
王海	本基金基金经理	2012年1月18日	2014年1月10日	11年	工商管理学硕士。历任通用技术集团投资管理有限公司（原上海中技投资顾问有限公司）项目经理、高级研究员、投资部副总经理，中海基金管理有限公司专户投资经理助理、专户投资经理。2009年3月加入中欧基金管理有限公司。
魏博	本基金基金经理，中欧盛世成长分级	2014年1月10日	—	7年	区域经济学专业硕士。历任中原证券股份有限公司研究员，东方证券股份有限公司研究员。2009年11月加入中欧基金管理有限

	股票型证券投资基金基金经理。				公司，历任中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理兼研究员、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理；现任中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理、中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理。
刘伟伟	本基金基金经理助理	2014年5月13日	—	1年	国民经济专业硕士。历任农银汇理基金管理有限公司研究员。2014年5月加入中欧基金管理有限公司，现任中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理兼研究员。

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、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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

#### 1、市场：

二季度前半段，市场出现明显回调。一方面，人民币汇率从单边升值转为双向波动，外汇占款增速呈现下降趋势，对流动性造成负面影响。另外，4、5月份在房地产销量大幅下降的情况下，市场对经济加速下滑十分担忧。

5月份后，宏观经济层面发生变化。第一，流动性逐渐宽松。央行定向降准、公开市场操作净投放、存贷比调整等措施使得短端利率和长端利率均呈现下行态势。第二，从经济面看，微刺激政策不断加码，效果逐步显现。第三，欧美经济企稳向好，外需有好转。上述因素使得经济加速下滑的势头得以遏制，市场信息逐步恢复。

#### 2、操作：

由于大的宏观背景依然是经济转型，传统周期性行业的去产能过程还未结束，因此我们的投资重点是符合经济转型方向的成长性行业，如消费、科技、装备制造、新能源等行业。

### 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-4.29%，同期业绩比较基准增长率为-0.13%，基金投资收益低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

我们预期流动性将继续宽松，经济将在底部盘整，并且经济体制改革预期逐渐浓厚。经济体制改革最核心的是财税体制改革和国企改革。在财税体制改革方面，近日政治局会议审议通过了《深化财税体制改革总体方案》，并设定明确时间表，2016年基本完成深化财税体制改革的重点工作和任务，2020年基本建立现代财政制度。国企改革方面，中石化销售业务重组引人关注。这些对市场都是实质性利好，我们将密切观察国企改革对市场信心增强的效应，并积极参与这一投资主题。同时，我们将继续坚持重点投资偏成长行业，精选估值与业绩增速相匹配的个股。

## 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历。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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### § 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

基金托管人依据本基金基金合同和托管协议，自2009年12月30日起托管本基金的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、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

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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：中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	107,469,398.75	27,902,974.01
结算备付金		4,209,977.35	225,577.24
存出保证金		1,156,776.17	273,022.09
交易性金融资产	6.4.7.2	716,043,645.35	375,294,448.40
其中：股票投资		716,043,645.35	375,294,448.40
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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	—	50,000,010.90
应收证券清算款		—	2,016,043.72
应收利息	6.4.7.5	20,436.28	11,314.86
应收股利		—	—
应收申购款		55,048,936.12	156,798.46
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	30,247.08	—
资产总计		883,979,417.10	455,880,189.68

负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<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		10,137,585.63	6,905.99
应付赎回款		1,824,079.57	842,940.79
应付管理人报酬		861,208.74	684,274.73
应付托管费		143,534.78	114,045.80
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,370,324.07	248,285.46
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	692,233.76	740,396.05
负债合计		15,028,966.55	2,636,848.82
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,237,345,723.97	617,630,898.42
未分配利润	6.4.7.10	-368,395,273.42	-164,387,557.56
所有者权益合计		868,950,450.55	453,243,340.86
负债和所有者权益总计		883,979,417.10	455,880,189.68

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.7023元，基金份额总额1,237,345,723.97份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2014年1月1日	上年度可比期间
-----	-----	-------------	---------

		至2014年6月30日	2013年1月1日-2013年 6月30日
<b>一、收入</b>		12,274,839.14	-60,251,895.50
1.利息收入		450,896.24	204,001.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	281,414.46	154,973.07
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		169,481.78	49,028.60
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-95,447,475.57	9,715,664.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-96,785,674.18	2,742,622.42
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
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	1,338,198.61	6,973,041.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	106,993,634.02	-70,532,806.50
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	277,784.45	361,245.00
<b>减：二、费用</b>		7,179,033.34	5,031,270.48
1. 管理人报酬		2,831,086.79	3,630,821.14
2. 托管费		471,847.78	605,136.83
3. 销售服务费		—	—

4. 交易费用	6.4.7.18	3,663,327.36	573,913.94
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	212,771.41	221,398.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,095,805.80	-65,283,165.98
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,095,805.80	-65,283,165.98

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 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)	617,630,898.42	-164,387,557.56	453,243,340.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	5,095,805.80	5,095,805.80
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)	619,714,825.55	-209,103,521.66	410,611,303.89
其中：1.基金申购款	956,106,951.59	-310,317,681.92	645,789,269.67
2.基金赎回款	-336,392,126.04	101,214,160.26	-235,177,965.78
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）	1,237,345,723.97	-368,395,273.42	868,950,450.55

项目	上年度可比期间 2013年1月1日-2013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)	338,979,901.58	-17,677,328.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-65,283,165.98	-65,283,165.98
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)	287,068,447.62	-32,972,947.00	254,095,500.62
其中：1.基金申购款	639,159,284.35	-71,738,269.34	567,421,015.01
2.基金赎回款	-352,090,836.73	38,765,322.34	-313,325,514.39
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)	626,048,349.20	-115,933,441.00	510,114,908.20

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

黄峰

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

中欧中小盘股票型证券投资基金(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[2009]第1192号《关于核准中欧中小盘股票型证券投资基金(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《中欧中小盘股票型证券投资基金(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1,476,942,362.32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

(2009)第292号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2009年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,477,643,035.66份基金份额,其中认购资金利息折合700,673.34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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第95号文审核同意,本基金39,505,449份基金份额于2010年3月26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《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证、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占基金资产的5%-40%,其中现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:40%×天相中盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率。

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2014年8月27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》、《中欧中小盘股票型证券投资基金(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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日半年度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、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 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

无。

### 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，应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。自2013年1月1日起，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 2014年6月30日
活期存款	107,469,398.75
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	107,469,398.75

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	663,591,117.16	716,043,645.35	52,452,528.19
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	663,591,117.16	716,043,645.35	52,452,528.19

#### 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 2014年6月30日
应收活期存款利息	14,660.07
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,706.69
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	3,600.98
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	468.54
合计	20,436.28

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	—
待摊费用	30,247.08
合计	30,247.08

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,370,324.07
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,370,324.07

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	6,094.98
其他	7,442.26
审计费	29,752.78
信息披露费	148,765.71
应付转换费	178.03
合计	692,233.76

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	617,630,898.42	617,630,898.42
本期申购	956,106,951.59	956,106,951.59
本期赎回（以“-”号填列）	-336,392,126.04	-336,392,126.04
本期末	1,237,345,723.97	1,237,345,723.97

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2014年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为7,559,536.00份(2013年6月30日：

8,318,403.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为1,229,786,187.97份(2013年6月30日：

617,729,946.20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	-79,585,835.69	-84,801,721.87	-164,387,557.56
本期利润	-101,897,828.22	106,993,634.02	5,095,805.80
本期基金份额交易产生的变动数	-210,404,358.69	1,300,837.03	-209,103,521.66
其中：基金申购款	-293,037,764.77	-17,279,917.15	-310,317,681.92

基金赎回款	82,633,406.08	18,580,754.18	101,214,160.26
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-391,888,022.60	23,492,749.18	-368,395,273.42

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	234,652.42
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	22,528.92
其他	24,233.12
合计	281,414.46

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	1,090,988,453.13
减：卖出股票成本总额	1,187,774,127.31
买卖股票差价收入	-96,785,674.18

#### 6.4.7.13 债券投资收益

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 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,338,198.61
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,338,198.61

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	106,993,634.02
——股票投资	106,993,634.02
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	106,993,634.02

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	164,425.86
转换费收入	113,358.59
合计	277,784.45

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 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	3,663,327.36
银行间市场交易费用	—
合计	3,663,327.36

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	—
上市费	29,752.92
持有人大会费	—
开户费	—
银行间回购交易费用	—
交易所回购手续费用	—
账户维护费用	4,500.00
银行间交易手续费	—
其他费用	—
合计	212,771.41

### 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

本报告期内，经公司股东会及第三届董事会2014年第一次定期会议审议通过，由国都证券有限责任公司和北京百骏投资有限公司分别将其持有的公司各10%的股权转让给股东以外的自然人窦玉明先生、刘建平先生、周蔚文先生、许欣先生和陆文俊先生。股权转让后公司注册资本保持不变，仍为人民币1.88亿元，公司股权结构调整为：

意大利意联银行股份合作公司（Unione di Banche Italiane S.c.p.a.）出资人民币65,800,000元，占公司注册资本的35%；

国都证券有限责任公司出资人民币37,600,000元，占公司注册资本的20%；

北京百骏投资有限公司出资人民币37,600,000元，占公司注册资本的20%；

万盛基业投资有限公司出资人民币9,400,000元，占公司注册资本的5%；

窦玉明出资人民币9,212,000元，占公司注册资本的4.9%；

刘建平出资人民币9,212,000元，占公司注册资本的4.9%；

周蔚文出资人民币7,708,000元，占公司注册资本的4.1%；

许欣出资人民币7,708,000元，占公司注册资本的4.1%；

陆文俊出资人民币3,760,000元，占公司注册资本的2%。上述事项的工商变更登记手续现已办理完毕并已报中国证券监督管理委员会备案，并已于2014年4月25日在指定媒介进行了信息披露。

### 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	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司("中国邮政储蓄银行")	基金托管人、基金代销机构
国都证券有限责任公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日-2013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	1,269,109,022.16	50.56%	15,517,726.14	3.39%

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间2013年1月1日-2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	31,000,000.00	2.71%	—	—

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,155,399.80	50.56%	834,093.47	60.87%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日-2013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	14,127.32	3.42%	14,127.32	10.55%
------	-----------	-------	-----------	--------

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、经手费后的净额列示。

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。

## 6.4.10.2 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 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,831,086.79	3,630,821.14
其中：支付销售机构的客户维护费	480,146.40	561,479.49

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	471,847.78	605,136.83

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日-2013年6月30日
报告期初持有的基金份额	3,524,551.25	—
报告期间申购/买入总份额	—	3,524,551.25
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	3,524,551.25	3,524,551.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	0.56%

注：报告期内，基金管理人未使用风险准备金投资本基金。

##### 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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日-2013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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	107,469,398.75	234,652.42	32,988,387.47	135,786.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

无。

### 6.4.12 期末（2014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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
300043	互动娱乐	2014-04-08	2015-04-09	非公开发行	14.40	15.30	181,760	2,617,344.00	2,780,928.00

#### 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
601012	隆基股份	2014-06-19	筹划重大事项	15.50	2014-07-01	15.60	399,960	5,333,952.15	6,199,380.00
002551	尚荣医疗	2014-06-12	筹划重大事项	34.01	-	-	599,894	20,196,667.32	20,402,394.94
300253	卫宁软件	2014-05-28	筹划重大事项	40.53	2014-08-01	37.50	100,000	3,628,110.00	4,053,000.00
300271	华宇软件	2014-06-27	筹划重大事项	40.30	-	-	499,960	18,885,687.17	20,148,388.00
300295	三六五网	2014-04-11	筹划重大事项	96.81	2014-07-08	105.00	38,000	3,093,277.76	3,678,780.00

注：本基金截至2014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

本基金为股票型基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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。本基金主要通过投资于具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业，特别是处于加速成长期的中小型企业，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增长。

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中国邮政储蓄银行，与该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。

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2014年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2013年12月31日：同)。

#### 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证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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2014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计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，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和结算备付金等。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

金额单位：人民币元

本期末 2014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	107,469,398.75	—	—	—	107,469,398.75
结算备付金	4,209,977.35	—	—	—	4,209,977.35
存出保证金	1,156,776.17	—	—	—	1,156,776.17
交易性金融资产	—	—	—	716,043,645.35	716,043,645.35
应收利息	—	—	—	20,436.28	20,436.28
应收申购款	54,997,407.55	—	—	51,528.57	55,048,936.12
其他资产	—	—	—	30,247.08	30,247.08
资产总计	167,833,559.82	—	—	716,145,857.28	883,979,417.10
负债					
应付证券清算款	—	—	—	10,137,585.63	10,137,585.63
应付赎回款	—	—	—	1,824,079.57	1,824,079.57
应付管理人报酬	—	—	—	861,208.74	861,208.74
应付托管费	—	—	—	143,534.78	143,534.78
应付交易费用	—	—	—	1,370,324.07	1,370,324.07
其他负债	—	—	—	692,233.76	692,233.76
负债总计	—	—	—	15,028,966.55	15,028,966.55
利率敏感度缺口	167,833,559.82	—	—	701,116,890.73	868,950,450.55
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2013年12月31日					
资产					
银行存款	27,902,974.01	—	—	—	27,902,974.01
结算备付金	225,577.24	—	—	—	225,577.24
存出保证金	273,022.09	—	—	—	273,022.09
交易性金融资产	—	—	—	375,294,448.40	375,294,448.40
买入返售金融资产	50,000,010.90	—	—	—	50,000,010.90
应收证券清算款	—	—	—	2,016,043.72	2,016,043.72
应收利息	—	—	—	11,314.86	11,314.86
应收申购款	497.02	—	—	156,301.44	156,798.46
资产总计	78,402,081.26	—	—	377,478,108.42	455,880,189.68
负债					
应付证券清算款	—	—	—	6,905.99	6,905.99
应付赎回款	—	—	—	842,940.79	842,940.79
应付管理人报酬	—	—	—	684,274.73	684,274.73
应付托管费	—	—	—	114,045.80	114,045.80
应付交易费用	—	—	—	248,285.46	248,285.46
其他负债	—	—	—	740,396.05	740,396.05
负债总计	—	—	—	2,636,848.82	2,636,848.82
利率敏感度缺口	78,402,081.26	—	—	374,841,259.60	453,243,340.86

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2014年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2013年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；债券、货币市场工具、权证、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占基金资产的5%-40%，其中现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 2014年6月30日		上年度末 2013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	716,043,645.35	82.40	375,294,448.40	82.80
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	716,043,645.35	82.40	375,294,448.40	82.80

#### 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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	1.业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	5,068.96	2,855.42
	2.业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-5,068.96	-2,855.42

#### 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)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。

##### (b)以公允价值计量的金融工具

##### (i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一

层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为658,780,774.41元，属于第二层级的余额为57,262,870.94元，

无属于第三层级的余额(2013年12月31日：第一层级的余额为375,294,448.40元，无属于第二、第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间将相关股票的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	716,043,645.35	81.00
	其中：股票	716,043,645.35	81.00
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	111,679,376.10	12.63
7	其他各项资产	56,256,395.65	6.36
8	合计	883,979,417.10	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,659,905.00	1.57
B	采矿业	63,997,794.48	7.36
C	制造业	364,048,094.42	41.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	7,728,000.00	0.89
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	198,499,643.93	22.84
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	22,114,675.16	2.54
M	科学研究和技术服务业	20,439,749.76	2.35
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	25,555,782.60	2.94
S	综合	—	—
	合计	716,043,645.35	82.40

## 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

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	300274	阳光电源	3,106,484	51,288,050.84	5.90
2	300157	恒泰艾普	3,434,172	44,438,185.68	5.11
3	002153	石基信息	788,698	40,460,207.40	4.66
4	300075	数字政通	1,099,861	35,558,506.13	4.09
5	600420	现代制药	1,799,924	33,388,590.20	3.84
6	300020	银江股份	1,082,706	33,130,803.60	3.81
7	600587	新华医疗	419,929	31,305,706.95	3.60
8	601231	环旭电子	909,919	28,061,901.96	3.23
9	300133	华策影视	799,868	25,555,782.60	2.94
10	300096	易联众	909,756	22,152,558.60	2.55
11	002400	省广股份	899,702	22,114,675.16	2.54
12	002178	延华智能	2,113,728	20,439,749.76	2.35
13	002551	尚荣医疗	599,894	20,402,394.94	2.35
14	601222	林洋电子	899,807	20,326,640.13	2.34
15	300271	华宇软件	499,960	20,148,388.00	2.32
16	300164	通源石油	1,199,976	19,559,608.80	2.25
17	600580	卧龙电气	2,396,924	18,384,407.08	2.12
18	300037	新宙邦	491,954	17,857,930.20	2.06
19	300255	常山药业	629,958	17,758,516.02	2.04
20	002191	劲嘉股份	1,299,912	17,288,829.60	1.99
21	300367	东方网力	199,827	16,905,364.20	1.95
22	600761	安徽合力	1,599,896	15,742,976.64	1.81
23	002714	牧原股份	310,100	13,659,905.00	1.57
24	300073	当升科技	699,836	13,156,916.80	1.51
25	002202	金风科技	1,299,920	12,336,240.80	1.42
26	002410	广联达	419,881	11,101,653.64	1.28
27	600529	山东药玻	999,816	11,007,974.16	1.27
28	300315	掌趣科技	559,856	9,999,028.16	1.15

29	002373	联信永益	399,980	9,439,528.00	1.09
30	002022	科华生物	399,853	9,216,611.65	1.06
31	300104	乐视网	199,936	8,777,190.40	1.01
32	002060	粤水电	1,600,000	7,728,000.00	0.89
33	000541	佛山照明	695,100	6,923,196.00	0.80
34	300236	上海新阳	199,959	6,348,698.25	0.73
35	601012	隆基股份	399,960	6,199,380.00	0.71
36	300307	慈星股份	400,000	4,240,000.00	0.49
37	300253	卫宁软件	100,000	4,053,000.00	0.47
38	300295	三六五网	38,000	3,678,780.00	0.42
39	300115	长盈精密	142,000	3,126,840.00	0.36
40	300043	互动娱乐	181,760	2,780,928.00	0.32

## 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	601318	中国平安	55,742,403.45	12.30
2	300157	恒泰艾普	45,853,230.34	10.12
3	300274	阳光电源	45,012,293.95	9.93
4	002153	石基信息	37,626,912.45	8.30
5	300020	银江股份	33,015,880.56	7.28
6	600420	现代制药	31,939,211.28	7.05
7	300075	数字政通	30,787,528.51	6.79
8	600587	新华医疗	29,691,733.06	6.55
9	002174	游族网络	26,134,507.58	5.77
10	002202	金风科技	26,095,837.79	5.76
11	601231	环旭电子	25,145,644.55	5.55
12	300133	华策影视	22,883,151.37	5.05
13	002604	龙力生物	22,542,586.51	4.97

14	002699	美盛文化	22,079,739.73	4.87
15	002400	省广股份	20,612,434.08	4.55
16	002223	鱼跃医疗	20,518,009.21	4.53
17	002551	尚荣医疗	20,196,667.32	4.46
18	300096	易联众	19,496,876.17	4.30
19	600261	阳光照明	19,478,999.05	4.30
20	002178	延华智能	19,413,104.02	4.28
21	601222	林洋电子	19,101,511.06	4.21
22	002191	劲嘉股份	18,995,368.70	4.19
23	300271	华宇软件	18,885,687.17	4.17
24	600661	新南洋	18,817,101.89	4.15
25	300164	通源石油	18,556,287.08	4.09
26	300295	三六五网	18,472,810.58	4.08
27	600580	卧龙电气	18,014,724.08	3.97
28	002390	信邦制药	16,824,045.40	3.71
29	600761	安徽合力	16,095,331.26	3.55
30	600416	湘电股份	15,252,445.13	3.37
31	300255	常山药业	15,201,236.24	3.35
32	300037	新宙邦	15,135,935.30	3.34
33	600649	城投控股	15,063,441.08	3.32
34	601515	东风股份	14,669,480.11	3.24
35	300002	神州泰岳	14,552,375.18	3.21
36	300367	东方网力	13,396,391.70	2.96
37	000712	锦龙股份	13,246,765.93	2.92
38	000812	陕西金叶	13,111,277.77	2.89
39	300145	南方泵业	12,418,795.14	2.74
40	000541	佛山照明	12,400,105.83	2.74
41	300266	兴源过滤	12,243,234.58	2.70
42	000553	沙隆达 A	12,066,344.50	2.66
43	600594	益佰制药	12,034,155.95	2.66

44	000625	长安汽车	11,760,221.70	2.59
45	002022	科华生物	11,610,616.75	2.56
46	002185	华天科技	11,592,978.37	2.56
47	300043	互动娱乐	11,506,161.12	2.54
48	300129	泰胜风能	11,456,892.22	2.53
49	300005	探路者	11,438,003.85	2.52
50	600566	洪城股份	11,338,703.31	2.50
51	600529	山东药玻	11,192,646.10	2.47
52	600122	宏图高科	11,131,540.00	2.46
53	002672	东江环保	10,919,642.90	2.41
54	002381	双箭股份	10,716,586.42	2.36
55	600030	中信证券	10,669,145.13	2.35
56	300232	洲明科技	10,445,896.40	2.30
57	600196	复星医药	10,153,043.57	2.24
58	002714	牧原股份	10,150,021.24	2.24
59	002410	广联达	10,116,314.98	2.23
60	000651	格力电器	10,074,654.32	2.22
61	600887	伊利股份	10,039,974.52	2.22
62	000895	双汇发展	10,005,518.34	2.21
63	000002	万 科 A	9,643,644.53	2.13
64	300073	当升科技	9,546,585.06	2.11
65	300315	掌趣科技	9,536,372.25	2.10
66	000525	红 太 阳	9,235,252.00	2.04
67	000063	中兴通讯	9,181,991.50	2.03
68	002236	大华股份	9,109,071.41	2.01

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	601318	中国平安	55,325,161.59	12.21
2	000002	万 科 A	42,347,048.57	9.34
3	600266	北京城建	32,209,897.91	7.11
4	600383	金地集团	28,448,010.08	6.28
5	000024	招商地产	27,842,459.64	6.14
6	600048	保利地产	27,541,916.33	6.08
7	002146	荣盛发展	27,477,985.10	6.06
8	600067	冠城大通	25,998,240.01	5.74
9	002174	游族网络	25,466,573.07	5.62
10	000926	福星股份	24,764,160.20	5.46
11	600661	新南洋	22,320,634.61	4.92
12	600416	湘电股份	22,290,808.24	4.92
13	002699	美盛文化	21,387,471.73	4.72
14	002244	滨江集团	21,320,800.71	4.70
15	002285	世联行	21,246,234.50	4.69
16	002604	龙力生物	21,061,185.07	4.65
17	300295	三六五网	19,979,775.18	4.41
18	002223	鱼跃医疗	19,828,312.22	4.37
19	000069	华侨城 A	19,410,341.52	4.28
20	000712	锦龙股份	17,715,015.52	3.91
21	600261	阳光照明	16,933,586.06	3.74
22	002390	信邦制药	16,800,006.72	3.71
23	600376	首开股份	15,728,566.86	3.47
24	000402	金 融 街	14,452,675.33	3.19
25	600649	城投控股	14,231,971.40	3.14
26	000625	长安汽车	14,082,116.63	3.11
27	601515	东风股份	13,868,325.33	3.06
28	002202	金风科技	13,634,588.60	3.01
29	300005	探路者	13,251,941.33	2.92
30	000553	沙隆达 A	12,978,101.61	2.86

31	300266	兴源过滤	12,883,816.80	2.84
32	300002	神州泰岳	12,833,305.42	2.83
33	000812	陕西金叶	12,729,248.59	2.81
34	600122	宏图高科	11,913,529.77	2.63
35	600594	益佰制药	11,678,387.58	2.58
36	002185	华天科技	11,666,604.26	2.57
37	300232	洲明科技	11,267,946.20	2.49
38	300145	南方泵业	11,175,214.91	2.47
39	600030	中信证券	10,974,936.94	2.42
40	300129	泰胜风能	10,885,596.05	2.40
41	002672	东江环保	10,453,730.62	2.31
42	002381	双箭股份	10,226,510.04	2.26
43	300338	开元仪器	9,977,362.23	2.20
44	600823	世茂股份	9,941,179.72	2.19
45	600196	复星医药	9,587,744.53	2.12
46	600566	洪城股份	9,583,208.99	2.11
47	000651	格力电器	9,509,683.69	2.10

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,421,529,690.24
卖出股票的收入（成交）总额	1,090,988,453.13

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未超出基金合同规定的备选股票库。

**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	1,156,776.17
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—

4	应收利息	20,436.28
5	应收申购款	55,048,936.12
6	其他应收款	—
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	—
9	合计	56,256,395.65

#### 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

本基金本报告期末前十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
21,991	56,266.01	896,517,629.74	72.45%	340,828,094.23	27.55%

#### 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	华燕	494,746.00	6.54%
2	徐振兴	457,000.00	6.05%
3	司家民	300,015.00	3.97%

4	王寿英	220,000.00	2.91%
5	赵彦詠	203,400.00	2.69%
6	何高林	196,370.00	2.60%
7	周志洁	161,526.00	2.14%
8	徐印海	150,001.00	1.98%
9	王中南	128,468.00	1.70%
10	吴素秀	105,901.00	1.40%

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	111,855.87	0.01%

### 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(2009年12月30日)基金份额总额	1,477,643,035.66
本报告期期初基金份额总额	617,630,898.42
本报告期基金总申购份额	956,106,951.59
减：本报告期基金总赎回份额	336,392,126.04
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,237,345,723.97

## § 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2014年2月20日发布公告，许欣先生自2014年2月12日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。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2014年1月11日发布公告，王海先生自2014年1月10日起不再担任本基金基金经理职务，魏博先生自2014年1月10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。

### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国都证券	1	1,269,109,022.16	50.56%	1,155,399.80	50.56%	
招商证券	1	350,412,416.06	13.96%	319,017.78	13.96%	
宏源证券	1	335,667,140.27	13.37%	305,591.41	13.37%	
民生证券	1	204,708,620.88	8.16%	186,367.13	8.16%	
申银万国	1	190,954,477.77	7.61%	173,845.83	7.61%	
中信证券	1	96,035,219.47	3.83%	87,430.02	3.83%	
国泰君安	1	63,003,302.76	2.51%	57,357.92	2.51%	
方正证券	1	—	—	—	—	
安信证券	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，新增方正证券深圳交易席位，宏源证券上海交易席位。

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国都证券	—	—	31,000,000.00	2.71%	—	—
招商证券	—	—	719,000,000.00	62.90%	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	20,000,000.00	1.75%	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—

中信证券	—	—	178,000,000.00	15.57%	—	—
国泰君安	—	—	195,000,000.00	17.06%	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—

### 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2013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	2014-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于公司从业人员在深圳中欧盛世资本管理有限公司兼职情况的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-01-04
3	中欧中小盘股票型证券投资基金（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	2014-01-11
4	中欧中小盘证券投资基金（LOF）2013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	2014-01-21
5	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2014年第1号）	公司网站	2014-02-12
6	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2014年第1号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-02-12
7	中欧基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-02-20
8	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2013年年度报告（正文）	公司网站	2014-03-28

9	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2013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	2014-03-28
10	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“互动娱乐”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	2014-03-28
11	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-04-10
12	中欧基金管理有限公司关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与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	2014-04-15
13	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2014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	2014-04-19
14	中欧基金管理有限公司关于公司股权转让及股东变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-04-25
15	中欧基金管理有限公司关于子公司名称变更等事项的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-05-15
16	中欧基金管理有限公司关于旗下基金在招商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-06-09

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、《中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中欧中小盘股票型证券投资基金（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.lcfunds.com](http://www.lcfunds.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

二〇一四年八月二十七日