

中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| §7 投资组合报告 | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 49 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 51 |
| §8 基金份额持有人信息 | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 8.3 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 | 53 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 53 |
| §9 开放式基金份额变动 | 53 |
| §10 重大事件揭示 | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 54 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 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 | 54 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 54 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 54 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 54 |
| 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 | 54 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 55 |
| §11 | 备查文件目录 | 56 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 56 |
| 11.2 | 存放地点 | 57 |
| 11.3 | 查阅方式 | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 中欧睿达定期开放混合 |
| 基金主代码 | 000894 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2014年12月1日 |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,816,583,895.53份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超额收益。 |
| 投资策略 | 本基金以36个月为一个运作周期，本基金在每个运作周期前确定大类资产初始配比，并在招募说明书中列示，每个运作周期的前3个月为建仓期，力争在建仓期结束前达到大类资产初始配比目标，达到初始配比目标后除证券价格波动等客观因素影响大类资产配置，不做频繁的主动大类资产配置调整。通过上述投资方法，一方面使得本基金投资组合的风险收益特征较为明晰，另一方面通过期初较大比例投资于债券类资产为权益投资的波动提供安全垫，以争取为组合实现本金安全，同时以有限比例投资于权益类资产而保有对股票市场一定的暴露度，以争取为组合创造超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。 |

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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 黎忆海 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-68609600 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 021-68609700、400-700-9700 | 95555 |
| 传真 | | 021-33830351 | 0755-83195201 |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | | 窦玉明 | 李建红 |

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

| | |
|----------------------|---------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2015年1月1日至2015年6月30日） |
| 本期已实现收益 | 271,636,248.15 |
| 本期利润 | 271,195,934.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1063 |
| 本期加权平均净值利润率 | 10.09% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.91% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 160,433,539.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0883 |
| 期末基金资产净值 | 1,977,017,434.77 |
| 期末基金份额净值 | 1.088 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.80% |

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。

4、本基金合同于2014年12月1日生效。

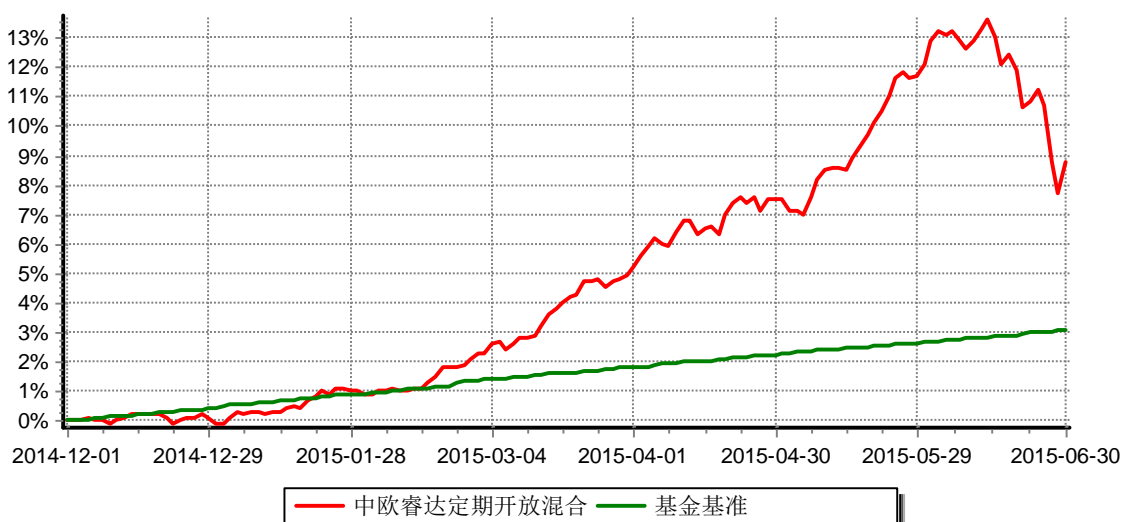
3.2 基金净值表现

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 | -2.60% | 0.66% | 0.43% | 0.01% | -3.03% | 0.65% |
| 过去三个月 | 3.72% | 0.46% | 1.25% | 0.01% | 2.47% | 0.45% |
| 过去六个月 | 8.91% | 0.35% | 2.59% | 0.02% | 6.32% | 0.33% |
| 自基金合同生效日起至今 | 8.80% | 0.32% | 3.07% | 0.02% | 5.73% | 0.30% |

注：本基金大类资产的投资比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的50%，但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日，到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制；本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%。在开放期，每个交易日日终在扣除股指期货期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制；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，同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%成为资产的标的指数。

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



注：本基金基金合同生效日期为2014年12月1日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。

§ 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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 孙甜 | 本基金基金经理, 中欧货币市场基金, 中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理, 中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧 | 2014年12月1日 | — | 5年 | 历任长江养老保险股份有限公司投资助理、上海烟草（年金计划）平衡配置组合投资经理, 上海海通证券资产管理有限公司海通季季红、海通海蓝宝益、海通海蓝宝银、海通月月鑫、海通季季鑫、海通半年鑫、海通年年鑫投资经理。2014年8月加入中欧基金管理有限公司, 曾任投资经理, 现任中欧货币市场基金基金经理、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理, 中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理, 中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基</p> | | | | <p>纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理, 中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理, 中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理, 中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|---|----------------|----------------|----|---|
| | 金经理， 中欧琪 和灵活 配置混 合型证 券投资 基金基 金基金 经理 | | | | |
| 苟开红 | 无，已于 2015-5- 29离职 | 2014年12月 1日 | 2015年5月 29日 | 9年 | 历任深圳华为技术有限公司市场财经部高级业务经理、上海荣正投资咨询有限公司总经理助理、上海亚商企业咨询有限公司投资银行部业务经理、华泰资产管理公司高级投资经理、研究部副总经理。2009年7月加入中欧基金管理有限公司，曾任总经理助理、权益投资部总监、投资总监、事业部负责人、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、中欧价值发现股票型证券投资基金基金经理、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基金经理、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

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

债券部分：

上半年，实体经济持续低迷，代表中小企业景气程度的汇丰PMI始终运行在50的荣枯水平之下。期间，人民银行适时实施了偏积极的货币政策，多次调降存贷款利率存款准备金率。受到宽松货币政策的影响，货币市场持续走松，银行间隔夜回购利率最低降至0.92%，创5年以来的新低。另外一方面，3月末房地产新政推出，加之2季度股市持续上涨带来的财富效应，全国房地产市场销售情况大幅好转。虽然房地产投资增速并没有迅速随之回升，但是二线以上各大城市的存货去化均出现了转好的迹象，部分龙头房地产企业的资产负债表质量有所好转。

尽管短端下行幅度较大，但是受到地方政府债供给和银行投资盘缺位的影响，整个2季度10年期国债利率始终维持在3.4%以上的较高位置，利率曲线斜率极大，长短端利差攀升至180bp以上的历史高点。

有鉴于此，我们在上半年的操作中仍然有意识地控制着组合久期，尽量享受中短端曲线下行带来的骑乘效应；同时主动提高了整个组合的杠杆，放大偏宽松的货币环境带来的套息效应。

股票部分：

2015年上半年,A股市场在气势如虹地上涨五个多月之后,于六月中旬开始了一波剧烈调整。在市场在持续上涨九个月之后,估值水平已经处于高位,一次较为充分的调整本属正常,但本轮调整由证监会加大杠杆资金入市的查处力度引发的调整,却逐渐演变成为一场流动性危机。上证指数在三个星期的时间里下跌30%以上,大量中小市值个股跌幅超过60%。为防止流动性危机进一步蔓延影响金融体系的稳定,六月底,证监会、央行等监管部门开始采取各类措施稳定股市,但投资者去杠杆的负向循环尚未打破,市场仍处于继续探底的过程中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内,基金净值增长率为8.91%,业绩比较基准收益率为2.59%,基金净值收益率高于业绩比较基准收益率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券部分：

展望未来一个季度,组合投资策略的重点将是调整结构、预防风险。第二,预防流动性风险。股票市场风险急剧爆发,去杠杆行为和较大的财富损失直接导致恐慌情绪升温和市场风险偏好的转向,这将导致金融市场的局部流动性紧张,我们的债券投资也将积极防御可能出现的流动性风险,主动降低组合杠杆和缩短久期,提升高资质和高质押比例债券的占比,在组合层面确保良好的流动性。第三,排查和降低信用风险暴露。由于IPO和再融资的暂停,金融体系反哺实体经济的一个关键通道也受到遏制,经济下行压力继续增加。金融风险蔓延至实体经济将可能导致部分债券的信用风险实质性上升,因此,我们将加大力度进行信用风险排查,在信用债的行业配置上,减少大宗周期品相关行业的持仓比例,规避黑色金属和煤炭产业链的所有个券,均衡持有与消费端较近的行业,继续规避城投类信用品。利率品方面,受制于人民币贬值的压力和未来大量的供给,趋势性机会尚不明确,资本利得空间有限,波段操作难度较大,因此仍持谨慎态度。

股票部分：

展望三季度,我们对市场较为二季度变得更为乐观。对于A股市场而言,我们认为政府的一系列救市措施将有效控制住危机的继续蔓延,而且目前市场的整体估值水平已经回到一个较为合理的水平,在恐慌性情绪消退之后,那些估值合理,未来成长性较好的个股已经具备较高的投资价值,我们将择机买入这些调整到位的好品种。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申

购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金

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 |
|-------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 151,247,037.37 | 739,891,800.60 |
| 结算备付金 | | 6,605,622.72 | — |
| 存出保证金 | | 392,917.35 | — |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,226,094,854.20 | 721,906,335.53 |
| 其中：股票投资 | | 339,073,392.04 | 171,685,440.24 |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 1,654,433,664.57 | 452,102,209.48 |
| 资产支持证券投资 | | 232,587,797.59 | 98,118,685.81 |
| 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 | — | 1,134,900,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 58,940,338.49 | 108,424,719.58 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 43,616,319.85 | 9,284,579.43 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | — | — |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | — | — |
| 资产总计 | | 2,486,897,089.98 | 2,714,407,435.14 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | 441,632,543.80 | — |
| 应付证券清算款 | | 64,282,822.88 | 27,797,613.08 |
| 应付赎回款 | | — | — |
| 应付管理人报酬 | | 2,091,659.20 | 2,650,154.55 |
| 应付托管费 | | 348,609.90 | 441,692.44 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,094,286.52 | 173,432.84 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | 251,828.81 | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 177,904.10 | 8,611.18 |
| 负债合计 | | 509,879,655.21 | 31,071,504.09 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,816,583,895.53 | 2,684,766,516.69 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 160,433,539.24 | -1,430,585.64 |
| 所有者权益合计 | | 1,977,017,434.77 | 2,683,335,931.05 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,486,897,089.98 | 2,714,407,435.14 |

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.088元，基金份额总额1,816,583,895.53份。

6.2 利润表

会计主体：中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金

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 |
|-----------------------|----------|------------------------|
| 一、收入 | | 293,968,228.80 |
| 1.利息收入 | | 56,483,139.99 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 9,730,736.62 |
| 债券利息收入 | | 36,832,429.71 |
| 资产支持证券利息收入 | | 4,199,413.50 |
| 买入返售金融资产收入 | | 5,720,560.16 |
| 其他利息收入 | | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 232,156,679.79 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 226,165,088.52 |
| 基金投资收益 | | — |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 4,794,157.51 |
| 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 | 1,197,433.76 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -440,313.52 |
| 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 | 5,768,722.54 |
| 减：二、费用 | | 22,772,294.17 |
| 1. 管理人报酬 | | 15,983,313.41 |
| 2. 托管费 | | 2,663,885.61 |

| | | |
|---------------------|----------|----------------|
| 3. 销售服务费 | | — |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 2,338,764.34 |
| 5. 利息支出 | | 1,595,041.01 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 1,595,041.01 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 191,289.80 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 271,195,934.63 |
| 减: 所得税费用 | | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 271,195,934.63 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金

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) | 2,684,766,516.69 | -1,430,585.64 | 2,683,335,931.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 271,195,934.63 | 271,195,934.63 |
| 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) | -868,182,621.16 | -109,331,809.75 | -977,514,430.91 |
| 其中: 1.基金申购款 | 7,649,723.94 | 968,803.21 | 8,618,527.15 |
| 2.基金赎回款 | -875,832,345.10 | -110,300,612.96 | -986,132,958.06 |
| 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 | 1,816,583,895.5 | 160,433,539.24 | 1,977,017,434.77 |

| | | | |
|----|---|--|--|
| 值) | 3 | | |
|----|---|--|--|

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

中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2014]1175号《关于准予中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》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《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2014年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,684,766,516.69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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。发起资金认购金额均为中欧基金管理有限公司认购中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金份额而投入的人民币10,000,000.00元(含认购费人民币1,000.00元),折合为9,999,000.00份基金份额,承诺持有期限为3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中:债券的比例不低于基金资产的50%,但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%。在开放期,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的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%,在封闭期,本基金不受前述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。。

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》、《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年1月1日至2015年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 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 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

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,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。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 | 151,247,037.37 |
| 定期存款 | — |
| 其中:存款期限1-3个月 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 151,247,037.37 |

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 | 365,041,381.37 | 339,073,392.04 | -25,967,989.33 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — | |
| 债券 | 交易所市场 | 1,406,848,069.22 | 1,423,876,664.57 | 17,028,595.35 |
| | 银行间市场 | 229,853,194.24 | 230,557,000.00 | 703,805.76 |

| | | | | |
|--------|----|------------------|------------------|---------------|
| | 合计 | 1,636,701,263.46 | 1,654,433,664.57 | 17,732,401.11 |
| 资产支持证券 | | 232,587,797.59 | 232,587,797.59 | — |
| 基金 | | — | — | — |
| 其他 | | — | — | — |
| | 合计 | 2,234,330,442.42 | 2,226,094,854.20 | -8,235,588.22 |

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 | 35,892.86 |
| 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 | 2,972.50 |
| 应收债券利息 | 39,668,680.60 |
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | — |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | 3,908,773.89 |
| 合计 | 43,616,319.85 |

6.4.7.6 其他资产

无。

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 | 1,089,112.47 |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,174.05 |
| 合计 | 1,094,286.52 |

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 | — |
| 审计费 | 58,889.36 |
| 信息披露费 | 119,014.74 |
| 应付转换费 | — |
| 合计 | 177,904.10 |

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 | 2,684,766,516.69 | 2,684,766,516.69 |
| 本期申购 | 7,649,723.94 | 7,649,723.94 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -875,832,345.10 | -875,832,345.10 |
| 本期末 | 1,816,583,895.53 | 1,816,583,895.53 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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 | 6,364,689.06 | -7,795,274.70 | -1,430,585.64 |
| 本期利润 | 271,636,248.15 | -440,313.52 | 271,195,934.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -84,963,399.53 | -24,368,410.22 | -109,331,809.75 |
| 其中：基金申购款 | 750,750.55 | 218,052.66 | 968,803.21 |
| 基金赎回款 | -85,714,150.08 | -24,586,462.88 | -110,300,612.96 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 193,037,537.68 | -32,603,998.44 | 160,433,539.24 |

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 | 1,039,769.82 |
| 定期存款利息收入 | 8,467,300.24 |
| 其他存款利息收入 | — |
| 结算备付金利息收入 | 220,662.32 |
| 其他 | 3,004.24 |
| 合计 | 9,730,736.62 |

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 | 226,165,088.52 |
| 股票投资收益——赎回差价 收入 | — |
| 合计 | 226,165,088.52 |

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 | 773,478,922.41 |
| 减：卖出股票成本总额 | 547,313,833.89 |
| 买卖股票差价收入 | 226,165,088.52 |

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 | 4,794,157.51 |
| 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 | 4,794,157.51 |

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 | 800,907,230.76 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 775,798,551.91 |
| 减：应收利息总额 | 20,314,521.34 |
| 买卖债券差价收入 | 4,794,157.51 |

6.4.7.14 衍生工具收益

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 | 1,197,433.76 |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 1,197,433.76 |

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 | -440,313.52 |
| ——股票投资 | -18,001,704.00 |
| ——债券投资 | 17,561,390.48 |
| ——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 | -440,313.52 |

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 | 5,618,403.59 |
| 转换费收入 | 100,102.45 |
| 其它 | 50,216.50 |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 5,768,722.54 |
|----|--------------|

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 | 2,334,839.34 |
| 银行间市场交易费用 | 3,925.00 |
| 合计 | 2,338,764.34 |

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 | 50,278.18 |
| 信息披露费 | 119,014.74 |
| 银行汇划费用 | 20,496.88 |
| 上市费 | — |
| 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 | 1,500.00 |
| 银行间交易手续费 | — |
| 其他费用 | — |
| 合计 | 191,289.80 |

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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 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 |
| 竦玉明、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 | |
|-------|----------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国都证券 | 1,505,757,542.10 | 100.00% |

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 | 1,370,841.86 | 100.00% | 1,089,112.47 | 100.00% |

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 | |
|-------|------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国都证券 | 1,950,493,089.92 | 100.00% |

6.4.10.1.5 债券回购交易

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 | |
|-------|------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国都证券 | 21,282,078,000.00 | 100.00% |

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 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 15,983,313.41 |
| 其中：支付销售机构的客户维 | 9,321,969.72 | |

| | |
|----|--|
| 护费 | |
|----|--|

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1.20%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 × 1.20% / 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,663,885.61 |

注：支付基金托管人 招商银行 的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 |
| 基金合同生效日（2014年12月1日）持有的基金份额 | 9,999,900.00 |
| 期初持有的基金份额 | 9,999,900.00 |
| 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 | — |
| 期末持有的基金份额 | 9,999,900.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.55% |

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 | |
|------------|----------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行股份有限公司 | 151,247,037.37 | 1,039,769.82 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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（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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：可交换公司债券 | | | | | | | | | |
|---------------------------|---------|------------|------------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|
| 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 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
| 132002 | 15天集EB | 2015-06-11 | 2015-07-02 | 未上市 | 100 | 100 | 11,210 | 1,121,000 | 1,121,000 |
| 112253 | 15荣盛01 | 2015-06-26 | 2015-07-23 | 未上市 | 100 | 99.96 | 200,000 | 19,992,398.9 | 19,992,398.9 |
| 112249 | 15博彦债 | 2015-05-27 | 2015-07-29 | 未上市 | 100 | 99.97 | 50,000 | 4,998,575.34 | 4,998,575.34 |
| 123706 | 15环球1A2 | 2015-05-25 | 2015-08-11 | 未上市 | 100 | 100 | 100,000 | 10,000,000 | 10,000,000 |
| 123708 | 15环球1B | 2015-05-25 | 2015-08-11 | 未上市 | 100 | 100 | 100,000 | 10,000,000 | 10,000,000 |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或

战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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 |
|--------|------|------------|---------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|
| 002413 | 常发股份 | 2015-06-29 | 筹划重大事项 | 52.02 | | — | 81,600 | 4,997,192.00 | 4,244,832.00 |
| 600643 | 爱建股份 | 2015-06-30 | 筹划重大事项 | 16.73 | | — | 787,540 | 14,987,179.54 | 13,175,544.20 |
| 002388 | 新亚制程 | 2015-05-20 | 筹划非公开发行 | 28.59 | 2015-08-20 | 12.87 | 50 | 877.49 | 1,429.50 |
| 000526 | 银润投资 | 2015-02-09 | 筹划非公开发行 | 33.78 | 2015-08-10 | 24.53 | 350,000 | 6,472,398.00 | 11,823,000.00 |
| 300008 | 上海佳豪 | 2015-03-24 | 重大资产重组 | 22.67 | | — | 290,000 | 4,182,403.60 | 6,574,300.00 |
| 300113 | 顺网科技 | 2015-05-05 | 筹划重大事项 | 53.60 | 2015-08-06 | 51.93 | 229,914 | 5,189,825.56 | 12,323,390.40 |

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

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额58,799,711.80元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|-------------|------------|--------|---------|---------------|
| 041559017 | 15万丰奥特CP001 | 2015-07-01 | 100.58 | 200,000 | 20,116,000.00 |
| 101452019 | 14红狮MTN002 | 2015-07-01 | 103.32 | 200,000 | 20,664,000.00 |
| 101559027 | 15万丰 | 2015-07-01 | 100.19 | 200,000 | 20,038,000.00 |

| | | | | | |
|----|------------------|--|--|---------|---------------|
| | 奥特 MTN00 1 | | | | |
| 合计 | | | | 600,000 | 60,818,000.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额382,832,832.00元，分别于2015年7月1日，2015年7月2日，2015年7月6日，2015年7月7日，2015年7月8日，2015年7月9日先后到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于风险中等，追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金通过主要投资于未来持续成长能力强的潜力公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。

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 中国招商银行，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，本基金持有的资产支持证券余额为182,587,797.59元，其中长期信用评级 AAA 级的证券余额为62,702,836.49元，长期信用评级 AAA 以下的证券余额为109,884,961.10元，短期信用评级 AA+的证券余额为10,000,000.00元 (2014年12月31日：本基金持有的资产支持证券余额为58,118,685.81元，其中长期信用评级 AAA 级的证券余额为28,237,836.49元，长期信用评级 AAA 以下的证券余额为29,880,849.32元)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 20,116,000.00 | — |
| A-1以下 | — | — |
| 未评级 | 10,042,000.00 | — |
| 合计 | 30,158,000.00 | — |

6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 105,973,948.30 | 15,860,700.49 |
| AAA以下 | 1,377,010,716.27 | 356,200,684.33 |
| 未评级 | 141,291,000.00 | 80,040,824.66 |

| | | |
|----|------------------|----------------|
| 合计 | 1,624,275,664.57 | 452,102,209.48 |
|----|------------------|----------------|

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上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证券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，其余亦可在银行间同业市场交易，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，除卖出回购金融资产余额441,632,543.80元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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 | 151,247,037.37 | — | — | — | 151,247,037.37 |
| 结算备付金 | 6,605,622.72 | — | — | — | 6,605,622.72 |
| 存出保证金 | 392,917.35 | | | | 392,917.35 |
| 交易性金融资产 | 541,568,562.46 | 1,345,452,899.70 | — | 339,073,392.04 | 2,226,094,854.20 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | 58,940,338.49 | 58,940,338.49 |
| 应收利息 | — | — | — | 43,616,319.85 | 43,616,319.85 |
| 资产总计 | 699,814,139.90 | 1,345,452,899.70 | — | 441,630,050.38 | 2,486,897,089.98 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 441,632,543.80 | — | — | — | 441,632,543.80 |
| 应付证券清算款 | — | — | — | 64,282,822.88 | 64,282,822.88 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | 2,091,659.20 | 2,091,659.20 |
| 应付托管费 | — | — | — | 348,609.90 | 348,609.90 |
| 应付交易费用 | — | — | — | 1,094,286.52 | 1,094,286.52 |
| 应付利息 | — | — | — | 251,828.81 | 251,828.81 |
| 其他负债 | — | — | — | 177,904.10 | 177,904.10 |
| 负债总计 | 441,632,543.80 | — | — | 68,247,111.41 | 509,879,655.21 |
| 利率敏感度缺 | 258,181,596 | 1,345,452,8 | — | 373,382,938 | 1,977,017,4 |

| 口 | .10 | 99.70 | | .97 | 34.77 |
|-------------------------|----------------------|--------------------|------|--------------------|----------------------|
| 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 | 739,891,800 .60 | — | — | — | 739,891,800 .60 |
| 交易性金融资 产 | 117,390,412 .95 | 432,830,482 .34 | — | 171,685,440 .24 | 721,906,335 .53 |
| 买入返售金融 资产 | 1,134,900,0 00.00 | — | — | — | 1,134,900,0 00.00 |
| 应收证券清算 款 | — | — | — | 108,424,719 .58 | 108,424,719 .58 |
| 应收利息 | — | — | — | 9,284,579.4 3 | 9,284,579.4 3 |
| 资产总计 | 1,992,182,2 13.55 | 432,830,482 .34 | — | 289,394,739 .25 | 2,714,407,4 35.14 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算 款 | — | — | — | 27,797,613. 08 | 27,797,613. 08 |
| 应付管理人报 酬 | — | — | — | 2,650,154.5 5 | 2,650,154.5 5 |
| 应付托管费 | — | — | — | 441,692.44 | 441,692.44 |
| 应付交易费用 | — | — | — | 173,432.84 | 173,432.84 |
| 其他负债 | — | — | — | 8,611.18 | 8,611.18 |
| 负债总计 | — | — | — | 31,071,504. 09 | 31,071,504. 09 |
| 利率敏感度缺 口 | 1,992,182,2 13.55 | 432,830,482 .34 | — | 258,323,235 .16 | 2,683,335,9 31.05 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其它市场变量保持不变 | |
|----|--------------------|----------------|
| 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 |
| | 市场利率下降25个基点 | 1,307.00 | — |
| | 市场利率上升25个基点 | -1,304.45 | — |

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的50%，而投资于股票的比例不高于50%。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 | 339,073,392.04 | 17.15 | 171,685,440.24 | 6.40 |
| 衍生金融资产-权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 339,073,392.04 | 17.15 | 171,685,440.24 | 6.40 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为17.15%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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290,930,895.94元，属于第二层次的余额为1,702,576,160.67元，属于第三层次的余额为232,587,797.59元。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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具232,587,797.59元(2014年12月31日：本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具)。本基金本期净转入第三层次的金额为232,587,797.59元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为零元(2014年度：净转入/(转出)第三层次零元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动零元)。

(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 | 339,073,392.04 | 13.63 |
| | 其中：股票 | 339,073,392.04 | 13.63 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,887,021,462.16 | 75.88 |
| | 其中：债券 | 1,654,433,664.57 | 66.53 |
| | 资产支持证券 | 232,587,797.59 | 9.35 |
| 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 | 157,852,660.09 | 6.35 |
| 7 | 其他各项资产 | 102,949,575.69 | 4.14 |
| 8 | 合计 | 2,486,897,089.98 | 100.00 |

7.2 报告期末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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 10,127,020.80 | 0.51 |
| B | 采矿业 | 11,231,895.00 | 0.57 |
| C | 制造业 | 228,482,520.00 | 11.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 12,007,685.24 | 0.61 |
| 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 | 12,323,390.40 | 0.62 |
| J | 金融业 | 28,519,420.60 | 1.44 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 29,807,160.00 | 1.51 |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,574,300.00 | 0.33 |
| 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 | — | — |
| | 合计 | 339,073,392.04 | 17.15 |

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 | 002508 | 老板电器 | 1,184,802 | 45,449,004.72 | 2.30 |
| 2 | 002054 | 德美化工 | 3,060,653 | 34,830,231.14 | 1.76 |
| 3 | 002038 | 双鹭药业 | 581,897 | 32,964,465.05 | 1.67 |
| 4 | 600566 | 济川药业 | 931,442 | 27,458,910.16 | 1.39 |
| 5 | 600325 | 华发股份 | 993,600 | 17,984,160.00 | 0.91 |
| 6 | 600521 | 华海药业 | 573,871 | 17,933,468.75 | 0.91 |
| 7 | 002014 | 永新股份 | 683,337 | 16,550,422.14 | 0.84 |
| 8 | 600109 | 国金证券 | 616,181 | 15,034,816.40 | 0.76 |
| 9 | 300210 | 森远股份 | 715,802 | 13,958,139.00 | 0.71 |
| 10 | 600643 | 爱建股份 | 787,540 | 13,175,544.20 | 0.67 |
| 11 | 002037 | 久联发展 | 379,200 | 12,763,872.00 | 0.65 |
| 12 | 300113 | 顺网科技 | 229,914 | 12,323,390.40 | 0.62 |
| 13 | 000526 | 银润投资 | 350,000 | 11,823,000.00 | 0.60 |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 538,700 | 11,231,895.00 | 0.57 |
| 15 | 002477 | 雏鹰农牧 | 527,449 | 10,127,020.80 | 0.51 |
| 16 | 600150 | 中国船舶 | 189,800 | 9,774,700.00 | 0.49 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 17 | 600694 | 大商股份 | 141,183 | 7,804,596.24 | 0.39 |
| 18 | 600060 | 海信电器 | 301,406 | 7,411,573.54 | 0.37 |
| 19 | 300008 | 上海佳豪 | 290,000 | 6,574,300.00 | 0.33 |
| 20 | 000915 | 山大华特 | 91,812 | 5,141,472.00 | 0.26 |
| 21 | 002413 | 常发股份 | 81,600 | 4,244,832.00 | 0.21 |
| 22 | 600546 | 山煤国际 | 493,900 | 4,203,089.00 | 0.21 |
| 23 | 601211 | 国泰君安 | 9,000 | 309,060.00 | 0.02 |
| 24 | 002388 | 新亚制程 | 50 | 1,429.50 | — |

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 | 601166 | 兴业银行 | 49,979,065.31 | 1.86 |
| 2 | 002508 | 老板电器 | 49,975,457.66 | 1.86 |
| 3 | 002054 | 德美化工 | 39,980,660.55 | 1.49 |
| 4 | 600566 | 济川药业 | 39,973,190.12 | 1.49 |
| 5 | 002038 | 双鹭药业 | 39,708,361.88 | 1.48 |
| 6 | 000157 | 中联重科 | 29,989,995.80 | 1.12 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 29,899,640.35 | 1.11 |
| 8 | 600325 | 华发股份 | 19,997,577.00 | 0.75 |
| 9 | 600109 | 国金证券 | 19,997,358.41 | 0.75 |
| 10 | 002037 | 久联发展 | 19,985,652.00 | 0.74 |
| 11 | 300210 | 森远股份 | 19,985,281.66 | 0.74 |
| 12 | 000776 | 广发证券 | 16,628,104.00 | 0.62 |
| 13 | 002014 | 永新股份 | 15,756,542.80 | 0.59 |
| 14 | 601169 | 北京银行 | 14,994,176.00 | 0.56 |
| 15 | 600643 | 爱建股份 | 14,987,179.54 | 0.56 |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 11,996,678.00 | 0.45 |
| 17 | 600150 | 中国船舶 | 11,989,203.44 | 0.45 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 600060 | 海信电器 | 9,998,409.70 | 0.37 |
| 19 | 600521 | 华海药业 | 9,998,160.86 | 0.37 |
| 20 | 002477 | 雏鹰农牧 | 9,996,191.75 | 0.37 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 48,632,772.85 | 1.81 |
| 2 | 000157 | 中联重科 | 36,421,882.40 | 1.36 |
| 3 | 601988 | 中国银行 | 28,057,310.00 | 1.05 |
| 4 | 002231 | 奥维通信 | 25,131,184.38 | 0.94 |
| 5 | 002201 | 九鼎新材 | 19,456,681.90 | 0.73 |
| 6 | 000776 | 广发证券 | 18,665,265.71 | 0.70 |
| 7 | 300043 | 互动娱乐 | 14,842,130.28 | 0.55 |
| 8 | 002118 | 紫鑫药业 | 14,484,056.99 | 0.54 |
| 9 | 601169 | 北京银行 | 13,927,355.00 | 0.52 |
| 10 | 600839 | 四川长虹 | 13,881,810.91 | 0.52 |
| 11 | 300198 | 纳川股份 | 13,537,157.00 | 0.50 |
| 12 | 300212 | 易华录 | 13,252,277.80 | 0.49 |
| 13 | 300220 | 金运激光 | 13,101,336.73 | 0.49 |
| 14 | 002566 | 益盛药业 | 12,824,286.00 | 0.48 |
| 15 | 300221 | 银禧科技 | 12,764,253.55 | 0.48 |
| 16 | 600778 | 友好集团 | 12,756,595.20 | 0.48 |
| 17 | 002274 | 华昌化工 | 12,685,230.92 | 0.47 |
| 18 | 600112 | 天成控股 | 12,364,131.00 | 0.46 |
| 19 | 601369 | 陕鼓动力 | 11,940,813.47 | 0.44 |
| 20 | 000661 | 长春高新 | 11,482,418.93 | 0.43 |

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 | 732,703,489.69 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 773,478,922.41 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | — | — |
| | 其中：政策性金融债 | — | — |
| 4 | 企业债券 | 1,422,755,664.57 | 71.96 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,158,000.00 | 1.53 |
| 6 | 中期票据 | 200,399,000.00 | 10.14 |
| 7 | 可转债 | — | — |
| 8 | 其他 | 1,121,000.00 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 1,654,433,664.57 | 83.68 |

注：注：其他债券品种中包含可交换债券。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|----------------|--------------|
| 1 | 127016 | 14忠旺债 | 990,000 | 100,336,500.00 | 5.08 |
| 2 | 122337 | 13魏桥02 | 900,000 | 91,098,000.00 | 4.61 |
| 3 | 112227 | 14利源债 | 861,650 | 90,085,507.50 | 4.56 |
| 4 | 122059 | 10重钢债 | 754,720 | 75,705,963.20 | 3.83 |
| 5 | 112142 | 12格林债 | 705,924 | 74,242,027.08 | 3.76 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 119119 | 14中和1A | 400,000 | 40,000,000.00 | 2.02 |
| 2 | 119163 | 15中和1A | 300,000 | 30,000,000.00 | 1.52 |
| 3 | 123542 | 14航租优 | 300,000 | 22,702,836.49 | 1.15 |
| 4 | 123591 | 禾燃气05 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.01 |
| 5 | 119112 | 徐新盛04 | 200,000 | 19,865,336.99 | 1.00 |
| 6 | 123590 | 禾燃气04 | 190,000 | 19,000,000.00 | 0.96 |
| 7 | 123589 | 禾燃气03 | 180,000 | 18,000,000.00 | 0.91 |
| 8 | 123612 | 吉林水务03 | 110,000 | 11,000,000.00 | 0.56 |
| 9 | 119113 | 徐新盛05 | 100,000 | 10,015,512.33 | 0.51 |
| 10 | 123587 | 禾燃气01 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.51 |
| 11 | 123588 | 禾燃气02 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.51 |
| 12 | 123708 | 15环球B | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.51 |
| 13 | 123706 | 15环球A2 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.51 |
| 14 | 119164 | 15中和1B | 20,000 | 2,004,111.78 | 0.10 |

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

本基金未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本基金本报告期内未投资股指期货。

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 本基金投资的四川科伦药业股份有限公司受到的行政处罚，系针对该公司未按规定披露在2012、2013年发生的关联交易行为，现已处罚完毕。该项处罚并未对公司的正常经营活动造成实质性负面影响，而将进一步规范发行人的经营和信息披露行为。除受到证监会调查、处罚的事件之外，没有公开信息显示公司存在其他类似交易行为，且过去的数年中，科伦药业的营业收入中关联交易的占比有所下降，处于正常范围以内。公司属于医药制造行业，主要从事注射剂生产，是中国输液行业中品种最为齐全、包装形式最为完备的医药企业。同时，从事抗生素中间体、原料药、医药包材、医疗器械等产品的研发、生产和销售，是产业链较为完善的大型医药集团之一。我们认为，公司所属行业前景较好，持续经营能力较强，行政处罚不会导致公司正常经营状况恶化，不影响其债券的投资价值。

其余八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 | 392,917.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | 58,940,338.49 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 43,616,319.85 |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 102,949,575.69 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1 | 600643 | 爱建股份 | 13,175,544.20 | 0.67 | 停牌 |

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 |
| 9,752 | 186,278.09 | 10,148,441.85 | 0.56% | 1,806,435,453.68 | 99.44% |

8.2 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 | — | — |
|------------------|---|---|

8.3 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 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总 数 | 持有份 额占基 金总份 额比例 | 发起份额总 数 | 发起份额占 基金总份额 比例 | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|------------------|--------------------------|------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资 金 | 9,999,900.0 0 | 0.55% | 9,999,900.0 0 | 0.55% | 3年 |
| 基金管理人高级管 理人员 | — | — | — | — | |
| 基金经理等人员 | — | — | — | — | |
| 基金管理人股东 | — | — | — | — | |
| 其他 | — | — | — | — | |
| 合计 | 9,999,900.0 0 | 0.55% | 9,999,900.0 0 | 0.55% | 3年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2014年12月1日)基金份额总额 | 2,684,766,516.69 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,684,766,516.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,649,723.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 875,832,345.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,816,583,895.53 |

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29日发布公告，苟开红女士自2015年5月29日起不再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例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国都证券 | 2 | 1,505,757,542.10 | 100% | 1,370,841.86 | 100% | — |

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，本基金新增国都证券上海和深圳的交易单元。

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 | |
|------|------------------|-------------|----------------|---------------|------|-------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 国都证券 | 1,950,493,089.92 | 100% | 21,282,078,000 | 100% | — | — |

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 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中元华电”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 | 2015-03-17 |
| 3 | 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 |
| 4 | 关于调整旗下部分基金持有“银润投资”股票估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 | 2015-04-14 |

| | | 公司网站 | |
|----|---------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 5 | 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金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 |
| 6 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“奥维通信”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 | 2015-05-09 |
| 7 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“顺网科技”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 | 2015-05-12 |
| 8 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“航天机电”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 | 2015-05-21 |
| 9 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“上海佳豪”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 | 2015-05-23 |
| 10 | 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回、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 | 2015-05-28 |
| 11 | 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站 | 2015-05-29 |
| 12 | 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“华海药业”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 | 2015-06-03 |
| 13 | 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 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金相关批准文件

- 2、《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 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)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