

中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金2016年半年度报告

2016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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年8月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月22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2016年1月1日起至2016年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 .....	5
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合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
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 .....	11
§5 托管人报告 .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见 .....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
§7 投资组合报告 .....	39
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	55
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 .....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	56
§8 基金份额持有人信息 .....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	57
§9 开放式基金份额变动 .....	58
§10 重大事件揭示 .....	58
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4	基金投资策略的改变 .....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8	其他重大事件 .....	62
§11	备查文件目录 .....	64
11.1	备查文件目录 .....	64
11.2	存放地点 .....	65
11.3	查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金
基金简称	中欧时代先锋股票
基金主代码	001938
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2015年11月3日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	46,579,235.38份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于“时代先锋相关股票”，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。本基金为股票型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，进行短期的战术避险选择。
业绩比较基准	90%×中证500指数收益率+10%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金，属于高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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	黎忆海	洪渊

露负责人	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	易会满

## 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	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层

## § 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	1,753,349.55
本期利润	3,295,123.23

加权平均基金份额本期利润	0.1297
本期加权平均净值利润率	13.05%
本期基金份额净值增长率	9.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	1,436,199.03
期末可供分配基金份额利润	0.0308
期末基金资产净值	51,462,181.52
期末基金份额净值	1.105
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.42%

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2015年11月3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	10.43%	1.61%	2.75%	1.40%	7.68%	0.21%
过去三个月	15.27%	1.57%	-0.36%	1.49%	15.63%	0.08%
过去六个月	9.80%	2.15%	-17.41%	2.30%	27.21%	-0.15%
自基金合同生效日起至今	24.42%	1.94%	-9.96%	2.14%	34.38%	-0.20%

注：本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率\*90%+中证综合债券指数收益率\*10%，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

中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015年11月03日-2016年6月30日)



注：本基金基金合同生效日为2015年11月3日，自基金合同生效日至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，建仓期结束时各项资产配置比例已达成基金合同约定。

## § 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、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富管理（上海）有限公司。截至2016年6月30日，本基金管理人共管理40只开放式基金。

#### 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		
周应波	基金经理	2015年11月3日	—	6年	历任平安证券有限责任公司研究员，华夏基金管理有限公司研究员。2014年10月加入中欧基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理助理、投资经理，现任中欧时代先锋股票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。

#### 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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，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

2016年上半年的A股市场基本可分为两个阶段：第一阶段是1-2月份，在成长股估值压力、汇率市场波动和股市熔断机制催化下，市场大幅调整，各主要指数跌幅均超过了15%，此后供给侧改革推动煤炭、钢铁周期股强劲反弹。第二阶段是3-6月份，外部宏观、汇率等环境企稳，内部市场监管也以稳为主，指数在10-15%的范围内震荡，这个阶段结构性的投资机会较多。

二季度前半段，国家宏观经济政策出现调整，强调供给侧改革、结构转型升级，弱化经济刺激，3月份的经济弱复苏也阶段性结束，市场相应出现一波调整。二季度后半段，市场对国家宏观政策、宏观经济走势的预期逐步稳定，市场关注度集中到景气度高、业绩增长确定性强的细分行业上，新能源汽车、小家电、白酒、养殖等子行业的结构性机会表现突出。同时，贯穿二季度乃至上半年，黄金、白银等贵金属为代表的部分有色金属商品期货价格不断上涨，大类资产配置的角度，反映了世界范围内信用货币的贬值，这样的背景推动了有色金属成为二季度表现最突出的大行业板块。

本基金在一季度秉承“更审慎，更聚焦，更独立”的基础上，二季度坚持“淡化仓位，审慎选股”的投资策略，总体上坚持保持中等偏上仓位，以积极心态寻找结构性机会。结合国家政策、产业链跟踪、个股调研，我们重点在新能源汽车、半导体与硬件创新两大方向进行了全产业链布局，取得了较好效果。

### 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9.80%，同期业绩比较基准增长率为-17.41%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们的总体思路是“精选个股、兼顾防守”。一方面，从外部条件来看，国内宏观经济整体上依然疲弱，货币与财政政策预计可能将倾向于托底而不是刺激，国际上的不确定因素也依然存在；另一方面，从资本市场自身情况看，5-6月份的细分行业成长股行情较强、个股分化较大，也在局部制造了估值泡沫，总体上7-8月份的结构性机会将更稀缺、更聚焦。因此，综合这些情况，三季度我们依然将把握结构性行业、个股的投资机会作为工作重点，但也将开始关注风险防范问题。

国内宏观经济层面，我们认为在地产销售增速逐步下滑、民间投资意愿持续收缩、宏观政策博弈的背景下，三季度经济可能面临较大的下行压力。第一，地产销售持续下行，房价上涨过快的地区开始出台调控政策，新开工不可避免会受到影响，相关产业链的复苏不会很强。第二，持续的疲弱环境，政府投资的挤出效应，使得民间投资意愿在二季度末下滑较大，三季度民营经济的扩张意愿很低。第三，宏观经济政策处于博弈期，

可预见性较差，地方政府、企业家的扩张动力都未恢复。

国际经济政治环境来看，第三季度的不确定因素在增多，一是如英国“脱欧”带来的连环格局变化，短、中、长期都带来冲击，二是全球范围内货币政策的不协调，三是各地区军事对抗频发，政治格局也在快速演变中。

但我们仍要看到积极的方面，中国经济持续的正在进行结构转型升级，一是体现为GDP中消费占比、服务业占比持续提升，二是体现为新兴行业中，中国企业不断崛起、获得产业链优势，近两年来的代表是消费电子、移动互联网、新能源汽车等。同时，财税改革、国企改革等各项改革措施，也在稳步推进中，未来仍有较大的制度红利释放潜力。

未来，我们将继续关注三维度的“新”投资机会：第一维度是人口结构变化、技术升级带来的“新消费”，包括IP消费、个性消费、休闲消费。第二维度是“新科技”，主要是新材料、新能源、新工艺带来的机会。第三维度是“新制度”，核心是供给侧改革、国企改革，部分周期性、产能过剩行业，可能在一轮较为彻底出清之后，迎来重生机会。

#### 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

本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。权益登记日为2016年6月21日，每10份基金份额派发红利0.500元，合计发放红利1,794,063.89元，其中现金分红

为1,288,903.81元。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对中欧时代先锋股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，中欧时代先锋股票型证券投资基金的管理人--中欧基金管理有限公司在中欧时代先锋股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。权益登记日为2016年6月21日，每10份基金份额派发红利0.500元，合计发放红利1,794,063.89元，其中现金分红为1,288,903.81元。

#### 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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧时代先锋股票型证券投资基金2016年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 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：中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2016年6月30日	2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,305,383.60	1,641,599.16
结算备付金		473,547.21	1,316,183.39
存出保证金		73,620.63	11,239.43
交易性金融资产	6.4.7.2	43,526,156.81	15,505,627.96
其中：股票投资		43,526,156.81	15,505,627.96
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	1,000,000.00	7,500,000.00
应收证券清算款		2,709,522.18	1,872,892.07
应收利息	6.4.7.5	1,807.80	1,463.49
应收股利		—	—
应收申购款		1,997,944.63	712,576.77
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		57,087,982.86	28,561,582.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		4,074,235.32	944,746.92
应付赎回款		1,017,191.90	—
应付管理人报酬		43,535.52	30,955.85
应付托管费		7,255.89	5,159.32

应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	256,723.92	173,615.22
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	226,858.79	69,717.89
负债合计		5,625,801.34	1,224,195.20
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	46,579,235.38	25,964,720.22
未分配利润	6.4.7.10	4,882,946.14	1,372,666.85
所有者权益合计		51,462,181.52	27,337,387.07
负债和所有者权益总计		57,087,982.86	28,561,582.27

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.105元，基金份额总额46,579,235.38份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日
<b>一、收入</b>		4,563,095.19
1. 利息收入		38,325.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,750.79
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		22,574.36
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,870,622.61

其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,790,652.34
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	79,970.27
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.16	1,541,773.68
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	112,373.75
<b>减：二、费用</b>		1,267,971.96
1. 管理人报酬		187,400.65
2. 托管费		31,233.44
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	891,585.86
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	157,752.01
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		3,295,123.23
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		3,295,123.23

注：本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	25,964,720.22	1,372,666.85	27,337,387.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,295,123.23	3,295,123.23
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)	20,614,515.16	2,009,219.95	22,623,735.11
其中：1. 基金申购款	41,245,545.09	2,662,072.93	43,907,618.02
2. 基金赎回款	-20,631,029.93	-652,852.98	-21,283,882.91
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)	—	-1,794,063.89	-1,794,063.89
五、期末所有者权益(基金净值)	46,579,235.38	4,882,946.14	51,462,181.52

注：本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

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

杨毅

王音然

-----  
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

中欧时代先锋股票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[2015]2245号《关于准予中欧时代先锋股票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《中欧时代先锋股票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，《中欧时



代先锋股票型发起式证券投资基金基金合同》于2015年11月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为20,855,594.79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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。发起资金认购金额为中欧基金管理有限公司和本基金基金经理认购中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金份额而投入的人民币10,001,396.26元，折合为10,001,396.26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《中欧时代先锋股票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、可交换债券、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、国债期货、股票期权等）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：股票投资占基金资产的比例为80%-95%，其中投资于“时代先锋相关股票”的比例不低于非现金基金资产的80%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证500指数收益率} + 10\% \times \text{中证综合债券指数收益率}$

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2016年8月24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》、《中欧时代先锋股票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2016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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016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2016年1月1日至2016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

同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，但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。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的初始投资成本，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的初始投资成本，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

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。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
	2016年6月30日
活期存款	7,305,383.60
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	7,305,383.60

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,334,115.17	43,526,156.81	2,192,041.64
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	41,334,115.17	43,526,156.81	2,192,041.64

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	—

合计	1,000,000.00	—
----	--------------	---

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,559.59
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	213.10
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	1.91
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	33.20
合计	1,807.80

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	256,723.92
银行间市场应付交易费用	—
合计	256,723.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	47.89
预提信息披露费	187,115.79
预提审计费	39,695.11
合计	226,858.79

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,964,720.22	25,964,720.22
本期申购	41,245,545.09	41,245,545.09
本期赎回（以“-”号填列）	-20,631,029.93	-20,631,029.93
本期末	46,579,235.38	46,579,235.38

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2015年10月26日至2015年10月30日止期间公开发售，共募集有效净认购金额20,853,961.42元。根据《中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入1,633.37元在本基金成立后，折算为1,633.37份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》的相关规定、本基金于2015年11月3日至2015年12月2日期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务自2015年12月3日起开始办理，赎回业务和转换业务自2015年12月3日起开始办理。

#### 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	594,238.67	778,428.18	1,372,666.85
本期利润	1,753,349.55	1,541,773.68	3,295,123.23
本期基金份额交易产生的变动数	882,674.70	1,126,545.25	2,009,219.95
其中：基金申购款	839,794.91	1,822,278.02	2,662,072.93

基金赎回款	42,879.79	-695,732.77	-652,852.98
本期已分配利润	-1,794,063.89	—	-1,794,063.89
本期末	1,436,199.03	3,446,747.11	4,882,946.14

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	8,391.68
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	6,890.61
其他	468.50
合计	15,750.79

#### 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2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,790,652.34
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	2,790,652.34

##### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	285,343,651.83
减：卖出股票成本总额	282,552,999.49
买卖股票差价收入	2,790,652.34

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无余额。

6.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	79,970.27
基金投资产生的股利收益	—
合计	79,970.27

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,541,773.68
——股票投资	1,541,773.68
——债券投资	—
——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	1,541,773.68

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日

基金赎回费收入	112,068.88
转换费收入	304.87
合计	112,373.75

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	891,585.86
银行间市场交易费用	—
合计	891,585.86

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,977.22
信息披露费	127,115.79
开户费	400.00
汇划手续费	259.00
合计	157,752.01

#### 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

本基金的基金管理人于2016年8月22日宣告2016年度第2次分红，向截至2016年8月24日止在本基金份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.420元。

#### 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、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	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.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙) (“上海睦亿合伙”)	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 (“中欧盛世资管”)	基金管理人的控股子公司
钱滚滚财富管理(上海)有限公司 (“钱滚滚财富”)	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 2016年1月1日至2016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	248,635,211.91	41.83%

注：本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

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 2016年1月1日至2016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	231,554.97	41.83%	72,986.71	28.43%

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。

3. 本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.4 债券交易

无。

### 6.4.10.1.5 债券回购交易

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	187,400.65
其中：支付销售机构的客户维护费	5,638.93

注：1、支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2、本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,233.44

注：1、支付基金托管人 中国工商银行 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。

2、本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2015年11月3日）持有的基金份额	3,000,136.08
报告期初持有的基金份额	3,227,204.09
报告期间申购/买入总份额	151,511.92
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	3,378,716.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.25%

##### 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,305,383.60	8,391.68

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于2015年11月3日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形式 发放总额	利润分 配 合计	备注
1	2016-06-21	2016-6-21(场外)	0.500	1,288,903.81	505,160.08	1,794,063.89	
合计			0.500	1,288,903.81	505,160.08	1,794,063.89	

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量 (单 位:股)	期末 成本总额	期末 估值总额
601611	中国核建	2016-06-30	股价异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	1,000	3,470.00	20,920.00



600203	福日电子	2016-06-30	重要事项未公告	13.80	2016-07-01	13.25	261,800	3,204,624.65	3,612,840.00
002452	长高集团	2016-06-14	临时停牌	12.02	2016-07-12	10.82	59,100	717,279.08	710,382.00

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金，属于高预期收益风险水平的投资品种。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、风险管理部、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。

#### 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发行的证券不得超过该证券的10%。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，本基金所持大部分资产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2016年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同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，因此账面余额约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、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,305,383.60	—	—	—	7,305,383.60
结算备付金	473,547.21	—	—	—	473,547.21
存出保证金	73,620.63	—	—	—	73,620.63
交易性金融资产	—	—	—	43,526,156.81	43,526,156.81
买入返售金融资产	1,000,000.00	—	—	—	1,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	2,709,522.18	2,709,522.18
应收利息	—	—	—	1,807.80	1,807.80
应收申购款	7,604.37			1,990,340.26	1,997,944.63
资产总计	8,860,155.81	—	—	48,227,827.05	57,087,982.86
负债					
应付证券清算	—	—	—	4,074,235.	4,074,235.

款				32	32
应付赎回款	—	—	—	1,017,191.90	1,017,191.90
应付管理人报酬	—	—	—	43,535.52	43,535.52
应付托管费	—	—	—	7,255.89	7,255.89
应付交易费用	—	—	—	256,723.92	256,723.92
其他负债	—	—	—	226,858.79	226,858.79
负债总计	—	—	—	5,625,801.34	5,625,801.34
利率敏感度缺口	8,860,155.81	—	—	42,602,025.71	51,462,181.52
上年度末 2015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	1,641,599.16	—	—	—	1,641,599.16
结算备付金	1,316,183.39	—	—	—	1,316,183.39
存出保证金	11,239.43	—	—	—	11,239.43
交易性金融资产	—	—	—	15,505,627.96	15,505,627.96
买入返售金融资产	7,500,000.00	—	—	—	7,500,000.00
应收证券清算款	—	—	—	1,872,892.07	1,872,892.07
应收利息	—	—	—	1,463.49	1,463.49
应收申购款	—	—	—	712,576.77	712,576.77
资产总计	10,469,021.98	—	—	18,092,560.29	28,561,582.27
负债					

应付证券清算款	—	—	—	944,746.92	944,746.92
应付管理人报酬	—	—	—	30,955.85	30,955.85
应付托管费	—	—	—	5,159.32	5,159.32
应付交易费用	—	—	—	173,615.22	173,615.22
其他负债	—	—	—	69,717.89	69,717.89
负债总计	—	—	—	1,224,195.20	1,224,195.20
利率敏感度缺口	10,469,021.98	—	—	16,868,365.09	27,337,387.07

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2016年6月30日，本基金未持有交易性债券资产（2015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（2015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。

#### 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 2016年6月30日		上年度末 2015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	43,526,156.81	84.58	15,505,627.96	56.72
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	43,526,156.81	84.58	15,505,627.96	56.72

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	226.18	72.31
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-226.18	-72.31

#### 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2016年06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39,182,014.81元，属于第二层次的余额为4,344,142.00元，无属于第三层次的余额。

(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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年06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。

(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	43,526,156.81	76.24
	其中：股票	43,526,156.81	76.24
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	1,000,000.00	1.75
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	7,778,930.81	13.63
7	其他各项资产	4,782,895.24	8.38
8	合计	57,087,982.86	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	6,926,395.00	13.46
C	制造业	27,816,086.40	54.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	20,920.00	0.04
F	批发和零售业	3,612,840.00	7.02
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	4,354,515.41	8.46
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—



Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	795,400.00	1.55
S	综合	—	—
	合计	43,526,156.81	84.58

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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	600406	国电南瑞	325,693	4,354,515.41	8.46
2	002456	欧菲光	128,063	3,777,858.50	7.34
3	600203	福日电子	261,800	3,612,840.00	7.02
4	600028	中国石化	563,600	2,660,192.00	5.17
5	000957	中通客车	50,300	2,283,620.00	4.44
6	603818	曲美家居	111,600	1,785,600.00	3.47
7	600188	兖州煤业	162,000	1,772,280.00	3.44
8	000985	大庆华科	65,432	1,618,133.36	3.14
9	002664	信质电机	46,045	1,566,450.90	3.04
10	600688	上海石化	254,500	1,552,450.00	3.02
11	601225	陕西煤业	292,900	1,514,293.00	2.94
12	600960	渤海活塞	150,000	1,506,000.00	2.93
13	600309	万华化学	86,900	1,503,370.00	2.92
14	000059	华锦股份	155,800	1,448,940.00	2.82
15	002138	顺络电子	73,100	1,325,303.00	2.58
16	002594	比亚迪	19,200	1,171,392.00	2.28
17	300316	晶盛机电	80,359	1,052,702.90	2.05
18	300019	硅宝科技	57,600	1,036,224.00	2.01
19	000021	深科技	93,279	1,027,001.79	2.00

20	000983	西山煤电	120,200	979,630.00	1.90
21	603806	福斯特	18,500	965,515.00	1.88
22	002343	慈文传媒	16,400	795,400.00	1.55
23	600651	飞乐音响	59,500	753,270.00	1.46
24	002452	长高集团	59,100	710,382.00	1.38
25	300156	神雾环保	26,050	536,109.00	1.04
26	603688	石英股份	25,400	528,828.00	1.03
27	300346	南大光电	11,400	509,922.00	0.99
28	002121	科陆电子	39,860	468,355.00	0.91
29	300161	华中数控	14,223	435,934.95	0.85
30	002422	科伦药业	16,400	252,724.00	0.49
31	601611	中国核建	1,000	20,920.00	0.04

#### 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	600028	中国石化	7,851,796.51	28.72
2	002090	金智科技	5,259,732.79	19.24
3	300274	阳光电源	5,168,750.04	18.91
4	600406	国电南瑞	4,944,255.75	18.09
5	002456	欧菲光	4,475,894.88	16.37
6	000049	德赛电池	4,152,189.01	15.19
7	600303	曙光股份	3,805,120.50	13.92
8	002235	安妮股份	3,798,033.00	13.89
9	300346	南大光电	3,752,458.50	13.73
10	002121	科陆电子	3,705,013.00	13.55
11	002594	比亚迪	3,563,647.20	13.04
12	000807	云铝股份	3,477,497.00	12.72
13	000059	华锦股份	3,380,114.22	12.36

14	300048	合康变频	3,317,760.30	12.14
15	600203	福日电子	3,204,624.65	11.72
16	300073	当升科技	3,202,177.00	11.71
17	002664	信质电机	3,156,337.74	11.55
18	000401	冀东水泥	3,075,559.00	11.25
19	002452	长高集团	2,945,339.08	10.77
20	600688	上海石化	2,923,373.59	10.69
21	002070	众和股份	2,856,326.00	10.45
22	600115	东方航空	2,851,827.00	10.43
23	002113	天润控股	2,806,803.34	10.27
24	600219	南山铝业	2,763,873.00	10.11
25	600884	杉杉股份	2,439,489.62	8.92
26	000957	中通客车	2,438,792.00	8.92
27	002586	围海股份	2,359,896.19	8.63
28	000983	西山煤电	2,350,981.44	8.60
29	600048	XD保利地	2,307,139.56	8.44
30	002343	慈文传媒	2,242,376.48	8.20
31	000733	振华科技	2,235,935.36	8.18
32	600060	海信电器	2,142,331.80	7.84
33	000898	鞍钢股份	2,121,126.95	7.76
34	002110	三钢闽光	2,005,328.00	7.34
35	603885	吉祥航空	1,944,513.00	7.11
36	000421	南京中北	1,943,059.00	7.11
37	600826	兰生股份	1,934,411.00	7.08
38	002425	凯撒股份	1,905,303.00	6.97
39	000985	大庆华科	1,901,126.00	6.95
40	600720	祁连山	1,885,790.00	6.90
41	000973	佛塑科技	1,791,932.06	6.55
42	000858	五粮液	1,762,675.02	6.45
43	000021	深科技	1,756,709.75	6.43
44	603818	曲美家居	1,754,407.40	6.42

45	000725	京东方 A	1,709,700.00	6.25
46	600188	兖州煤业	1,699,214.81	6.22
47	300207	欣旺达	1,680,973.00	6.15
48	600198	大唐电信	1,672,695.00	6.12
49	600386	北巴传媒	1,664,565.00	6.09
50	600290	XD华仪电	1,662,914.75	6.08
51	000783	长江证券	1,610,889.47	5.89
52	601555	东吴证券	1,574,116.00	5.76
53	002350	北京科锐	1,561,688.80	5.71
54	300019	硅宝科技	1,540,905.54	5.64
55	002587	奥拓电子	1,494,528.00	5.47
56	601225	陕西煤业	1,482,640.00	5.42
57	000709	河钢股份	1,462,514.00	5.35
58	300316	晶盛机电	1,454,527.00	5.32
59	300136	信维通信	1,439,335.50	5.27
60	002321	华英农业	1,437,209.00	5.26
61	000959	首钢股份	1,426,115.26	5.22
62	601005	重庆钢铁	1,413,205.00	5.17
63	600309	万华化学	1,408,352.00	5.15
64	300032	金龙机电	1,379,945.75	5.05
65	600730	中国高科	1,370,134.00	5.01
66	002354	天神娱乐	1,366,284.00	5.00
67	002635	安洁科技	1,357,833.38	4.97
68	002285	世联行	1,337,481.00	4.89
69	000333	美的集团	1,337,341.00	4.89
70	600893	中航动力	1,327,617.60	4.86
71	300008	上海佳豪	1,326,555.00	4.85
72	002440	闰土股份	1,326,431.00	4.85
73	601616	广电电气	1,325,656.80	4.85
74	600960	渤海活塞	1,322,775.54	4.84
75	300033	同花顺	1,294,745.00	4.74

76	000060	中金岭南	1,268,079.80	4.64
77	002138	顺络电子	1,263,707.00	4.62
78	002624	完美环球	1,257,613.00	4.60
79	600497	驰宏锌锗	1,229,179.98	4.50
80	300431	暴风科技	1,219,571.00	4.46
81	000050	深天马 A	1,217,300.00	4.45
82	300499	高澜股份	1,208,035.00	4.42
83	002335	科华恒盛	1,206,059.00	4.41
84	600449	宁夏建材	1,204,317.00	4.41
85	600801	华新水泥	1,194,014.68	4.37
86	002256	彩虹精化	1,191,925.00	4.36
87	600711	盛屯矿业	1,127,778.00	4.13
88	002668	奥马电器	1,094,310.00	4.00
89	300185	通裕重工	1,068,488.00	3.91
90	600622	嘉宝集团	1,067,980.00	3.91
91	300161	华中数控	1,020,367.00	3.73
92	002371	七星电子	1,019,821.00	3.73
93	600562	国睿科技	1,015,438.00	3.71
94	002061	*ST江化	999,198.00	3.66
95	300198	纳川股份	998,192.00	3.65
96	600019	宝钢股份	997,518.00	3.65
97	000915	山大华特	991,077.00	3.63
98	603020	爱普股份	988,274.00	3.62
99	600525	长园集团	978,506.00	3.58
100	300236	上海新阳	975,463.00	3.57
101	603806	福斯特	964,649.00	3.53
102	000831	*ST五稀	957,759.00	3.50
103	300406	九强生物	948,810.00	3.47
104	600050	中国联通	939,643.00	3.44
105	000932	华菱钢铁	937,888.00	3.43
106	300317	珈伟股份	937,241.00	3.43

107	601607	上海医药	927,773.00	3.39
108	002155	湖南黄金	916,463.00	3.35
109	000538	云南白药	908,877.00	3.32
110	000671	阳光城	907,264.00	3.32
111	002534	杭锅股份	899,089.00	3.29
112	600185	格力地产	898,720.00	3.29
113	600006	东风汽车	895,082.00	3.27
114	002108	沧州明珠	892,791.00	3.27
115	600343	航天动力	889,007.46	3.25
116	300418	昆仑万维	876,662.00	3.21
117	600552	凯盛科技	875,589.00	3.20
118	601388	怡球资源	843,380.00	3.09
119	002024	苏宁云商	817,331.00	2.99
120	300390	天华超净	815,628.44	2.98
121	600099	林海股份	815,461.00	2.98
122	600547	山东黄金	807,930.00	2.96
123	600419	天润乳业	807,049.00	2.95
124	002400	省广股份	805,010.19	2.94
125	300364	中文在线	803,821.00	2.94
126	002165	红宝丽	803,131.00	2.94
127	002494	华斯股份	792,417.00	2.90
128	600376	首开股份	785,805.00	2.87
129	300263	隆华节能	783,036.00	2.86
130	600489	中金黄金	778,437.00	2.85
131	002504	弘高创意	777,288.00	2.84
132	002714	牧原股份	775,818.00	2.84
133	000700	模塑科技	768,162.98	2.81
134	300059	东方财富	760,627.00	2.78
135	300109	新开源	758,789.00	2.78
136	000536	华映科技	752,168.00	2.75
137	002286	保龄宝	749,000.00	2.74

138	603012	创力集团	748,903.34	2.74
139	300232	洲明科技	745,387.00	2.73
140	002077	大港股份	737,068.58	2.70
141	603993	洛阳钼业	733,522.00	2.68
142	002422	科伦药业	731,723.65	2.68
143	600104	上汽集团	723,975.00	2.65
144	000856	*ST冀装	716,856.00	2.62
145	002185	华天科技	714,286.00	2.61
146	000877	天山股份	710,752.00	2.60
147	002620	瑞和股份	707,195.00	2.59
148	300141	和顺电气	704,439.00	2.58
149	300450	先导智能	697,870.00	2.55
150	000603	盛达矿业	697,530.00	2.55
151	000150	宜华健康	696,880.00	2.55
152	300223	北京君正	689,765.00	2.52
153	000423	东阿阿胶	688,212.00	2.52
154	600576	万家文化	688,103.68	2.52
155	000678	襄阳轴承	687,385.00	2.51
156	000887	中鼎股份	687,165.00	2.51
157	600521	华海药业	685,849.00	2.51
158	002407	多氟多	685,671.00	2.51
159	002169	智光电气	685,510.55	2.51
160	300294	博雅生物	683,642.00	2.50
161	600651	飞乐音响	678,911.65	2.48
162	600595	中孚实业	678,272.00	2.48
163	600322	天房发展	674,417.00	2.47
164	600777	新潮实业	674,095.00	2.47
165	300313	天山生物	672,979.00	2.46
166	002081	金螳螂	672,755.00	2.46
167	002179	中航光电	671,772.01	2.46
168	601009	南京银行	668,683.00	2.45

169	601888	中国国旅	668,593.00	2.45
170	600216	浙江医药	668,149.00	2.44
171	600872	中炬高新	664,537.68	2.43
172	000869	张裕A	664,436.00	2.43
173	002385	大北农	659,971.00	2.41
174	300067	安诺其	659,514.00	2.41
175	600089	特变电工	659,395.15	2.41
176	000559	万向钱潮	659,347.00	2.41
177	000400	许继电气	658,108.00	2.41
178	002271	东方雨虹	656,683.00	2.40
179	002519	银河电子	656,443.00	2.40
180	600563	法拉电子	653,086.00	2.39
181	600073	上海梅林	652,900.00	2.39
182	600458	时代新材	652,482.00	2.39
183	603799	华友钴业	639,046.00	2.34
184	002500	山西证券	618,828.00	2.26
185	603308	应流股份	607,320.00	2.22
186	601901	方正证券	598,920.00	2.19
187	601233	桐昆股份	598,444.00	2.19
188	601118	海南橡胶	587,424.69	2.15
189	600108	亚盛集团	585,886.00	2.14
190	600598	北大荒	585,874.40	2.14
191	600703	三安光电	579,190.76	2.12
192	600997	开滦股份	548,264.00	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	002090	金智科技	5,660,427.31	20.71



2	300274	阳光电源	5,313,931.10	19.44
3	600028	中国石化	5,257,504.22	19.23
4	000049	德赛电池	4,258,156.42	15.58
5	002235	安妮股份	3,886,574.99	14.22
6	600303	曙光股份	3,833,823.60	14.02
7	300073	当升科技	3,801,125.58	13.90
8	300346	南大光电	3,776,095.88	13.81
9	000807	云铝股份	3,513,142.16	12.85
10	300048	合康变频	3,390,873.54	12.40
11	002121	科陆电子	3,349,369.15	12.25
12	002070	众和股份	3,158,766.07	11.55
13	000401	冀东水泥	3,132,040.00	11.46
14	002113	天润控股	2,876,586.59	10.52
15	002664	信质电机	2,838,534.95	10.38
16	600115	东方航空	2,804,077.37	10.26
17	600219	南山铝业	2,736,364.46	10.01
18	600406	国电南瑞	2,565,300.87	9.38
19	002586	围海股份	2,448,309.16	8.96
20	600884	杉杉股份	2,446,091.50	8.95
21	002594	比亚迪	2,418,513.52	8.85
22	600060	海信电器	2,288,108.98	8.37
23	600048	XD保利地	2,260,295.00	8.27
24	000733	振华科技	2,172,496.00	7.95
25	002452	长高集团	2,115,679.78	7.74
26	000898	鞍钢股份	2,096,228.00	7.67
27	000421	南京中北	2,037,813.25	7.45
28	002425	凯撒股份	2,030,833.92	7.43
29	000059	华锦股份	2,011,941.95	7.36
30	000973	佛塑科技	1,934,709.56	7.08
31	603885	吉祥航空	1,889,354.46	6.91
32	600198	大唐电信	1,884,114.66	6.89

33	002110	三钢闽光	1,866,750.24	6.83
34	600826	兰生股份	1,851,046.56	6.77
35	600720	祁连山	1,841,994.00	6.74
36	600386	北巴传媒	1,814,269.38	6.64
37	000858	五 粮 液	1,786,205.80	6.53
38	002321	华英农业	1,763,259.46	6.45
39	002350	北京科锐	1,756,996.53	6.43
40	600422	昆药集团	1,734,978.04	6.35
41	601616	广电电气	1,720,208.00	6.29
42	000725	京东方 A	1,674,198.00	6.12
43	000783	长江证券	1,645,410.00	6.02
44	300207	欣旺达	1,617,327.92	5.92
45	601555	东吴证券	1,606,344.10	5.88
46	002587	奥拓电子	1,599,461.50	5.85
47	002635	安洁科技	1,542,142.40	5.64
48	600290	XD华仪电	1,535,457.00	5.62
49	002343	慈文传媒	1,505,989.00	5.51
50	300136	信维通信	1,503,214.00	5.50
51	000709	河钢股份	1,463,146.00	5.35
52	002335	科华恒盛	1,450,378.64	5.31
53	000959	首钢股份	1,425,493.00	5.21
54	002354	天神娱乐	1,417,523.00	5.19
55	300032	金龙机电	1,415,405.68	5.18
56	002440	闰土股份	1,413,762.00	5.17
57	601005	重庆钢铁	1,371,223.00	5.02
58	600730	中国高科	1,371,191.00	5.02
59	000983	西山煤电	1,361,513.08	4.98
60	002624	完美环球	1,336,561.36	4.89
61	600893	中航动力	1,334,107.92	4.88
62	000333	美的集团	1,318,965.00	4.82
63	600688	上海石化	1,307,120.00	4.78

64	300008	上海佳豪	1,306,748.00	4.78
65	002256	彩虹精化	1,293,298.11	4.73
66	300033	同花顺	1,290,058.00	4.72
67	002285	世联行	1,287,203.00	4.71
68	000678	襄阳轴承	1,270,325.00	4.65
69	000050	深天马 A	1,259,119.16	4.61
70	300499	高澜股份	1,235,165.53	4.52
71	000060	中金岭南	1,223,904.13	4.48
72	002371	七星电子	1,204,007.24	4.40
73	002668	奥马电器	1,181,664.00	4.32
74	600711	盛屯矿业	1,171,032.00	4.28
75	600497	驰宏锌锗	1,166,936.00	4.27
76	600449	宁夏建材	1,153,782.00	4.22
77	002488	金固股份	1,152,252.54	4.21
78	600801	华新水泥	1,127,513.00	4.12
79	300185	通裕重工	1,105,568.00	4.04
80	002456	欧菲光	1,100,914.47	4.03
81	000890	法尔胜	1,091,606.00	3.99
82	300198	纳川股份	1,091,076.00	3.99
83	600622	嘉宝集团	1,088,047.00	3.98
84	600562	国睿科技	1,055,499.00	3.86
85	002061	*ST江化	1,050,577.77	3.84
86	002155	湖南黄金	1,039,991.30	3.80
87	600419	天润乳业	1,029,461.51	3.77
88	603020	爱普股份	1,027,815.00	3.76
89	600006	东风汽车	1,009,038.88	3.69
90	300236	上海新阳	1,002,584.00	3.67
91	600019	宝钢股份	1,000,214.00	3.66
92	300431	暴风科技	999,289.00	3.66
93	000915	山大华特	993,816.90	3.64
94	600525	长园集团	983,994.04	3.60

95	000909	数源科技	979,627.00	3.58
96	000831	*ST五稀	952,664.45	3.48
97	300317	珈伟股份	949,766.25	3.47
98	600050	中国联通	940,280.00	3.44
99	000538	云南白药	940,210.06	3.44
100	300406	九强生物	935,431.19	3.42
101	601607	上海医药	930,123.00	3.40
102	600343	航天动力	929,274.00	3.40
103	000932	华菱钢铁	921,386.00	3.37
104	600185	格力地产	911,961.00	3.34
105	002108	沧州明珠	907,592.00	3.32
106	600552	凯盛科技	902,130.36	3.30
107	300418	昆仑万维	896,106.00	3.28
108	000671	阳光城	890,664.67	3.26
109	000536	华映科技	890,382.00	3.26
110	002714	牧原股份	885,873.00	3.24
111	002534	杭锅股份	885,600.00	3.24
112	600547	山东黄金	880,691.00	3.22
113	000021	深科技	857,458.82	3.14
114	300263	隆华节能	856,923.65	3.13
115	300390	天华超净	848,335.60	3.10
116	002024	苏宁云商	845,115.00	3.09
117	600099	林海股份	838,898.00	3.07
118	300100	双林股份	834,917.12	3.05
119	002165	红宝丽	826,607.62	3.02
120	300364	中文在线	808,725.05	2.96
121	002400	省广股份	805,403.00	2.95
122	600489	中金黄金	801,504.00	2.93
123	002134	天津普林	788,992.40	2.89
124	300059	东方财富	782,737.00	2.86
125	000700	模塑科技	769,920.00	2.82

126	002494	华斯股份	759,993.00	2.78
127	300109	新开源	758,564.00	2.77
128	002185	华天科技	755,083.00	2.76
129	603012	创力集团	752,383.00	2.75
130	300294	博雅生物	745,064.00	2.73
131	300232	洲明科技	741,883.50	2.71
132	002077	大港股份	732,657.00	2.68
133	002286	保龄宝	729,004.00	2.67
134	000887	中鼎股份	722,890.00	2.64
135	600458	时代新材	721,634.00	2.64
136	300019	硅宝科技	719,149.00	2.63
137	002407	多氟多	717,781.19	2.63
138	600521	华海药业	714,870.00	2.61
139	600104	上汽集团	714,226.00	2.61
140	600376	首开股份	713,230.00	2.61
141	600216	浙江医药	710,858.00	2.60
142	600563	法拉电子	709,603.00	2.60
143	300450	先导智能	707,643.00	2.59
144	002179	中航光电	704,388.02	2.58
145	600576	万家文化	700,919.80	2.56
146	300161	华中数控	700,541.30	2.56
147	300067	安诺其	698,388.00	2.55
148	600073	上海梅林	694,511.00	2.54
149	002169	智光电气	692,566.00	2.53
150	000150	宜华健康	691,456.00	2.53
151	000423	东阿阿胶	688,598.00	2.52
152	002385	大北农	684,838.00	2.51
153	603799	华友钴业	681,990.00	2.49
154	000400	许继电气	681,221.40	2.49
155	600089	特变电工	675,324.00	2.47
156	603993	洛阳钼业	675,070.00	2.47

157	002519	银河电子	669,693.00	2.45
158	000877	天山股份	669,553.00	2.45
159	000559	万向钱潮	668,928.00	2.45
160	300141	和顺电气	667,536.00	2.44
161	300313	天山生物	665,201.00	2.43
162	600595	中孚实业	664,684.32	2.43
163	000869	张裕A	661,225.00	2.42
164	300223	北京君正	654,377.00	2.39
165	002504	弘高创意	650,634.00	2.38
166	002599	盛通股份	647,501.50	2.37
167	601388	怡球资源	647,500.00	2.37
168	600322	天房发展	645,863.00	2.36
169	002081	金螳螂	645,018.00	2.36
170	600777	新潮实业	644,800.00	2.36
171	000856	*ST冀装	643,089.86	2.35
172	601009	南京银行	638,356.00	2.34
173	000603	盛达矿业	635,533.10	2.32
174	601888	中国国旅	627,392.89	2.29
175	002271	东方雨虹	623,290.00	2.28
176	603308	应流股份	623,230.00	2.28
177	600872	中炬高新	623,028.50	2.28
178	601233	桐昆股份	611,755.04	2.24
179	002500	山西证券	607,775.00	2.22
180	600598	北大荒	607,200.00	2.22
181	600108	亚盛集团	596,939.00	2.18
182	601118	海南橡胶	593,388.00	2.17
183	600703	三安光电	583,793.92	2.14
184	002620	瑞和股份	568,372.00	2.08
185	300316	晶盛机电	565,924.33	2.07
186	601901	方正证券	562,463.25	2.06
187	600997	开滦股份	556,007.92	2.03

188	002439	启明星辰	551,545.00	2.02
-----	--------	------	------------	------

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	309,031,754.66
卖出股票的收入（成交）总额	285,343,651.83

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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。

### 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	73,620.63
2	应收证券清算款	2,709,522.18
3	应收股利	—
4	应收利息	1,807.80
5	应收申购款	1,997,944.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,782,895.24

### 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	600203	福日电子	3,612,840.00	7.02	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
5,576	8,353.52	3,378,716.01	7.25%	43,200,519.37	92.75%

### 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	7,381,940.63	15.85%

### 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	>100

### 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	3,378,716.01	7.25%	3,000,136.08	6.44%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	7,001,260.18	15.03%	7,001,260.18	15.03%	三年
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,379,976.19	22.28%	10,001,396.26	21.47%	三年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年11月3日)基金份额总额	20,855,594.79
本报告期期初基金份额总额	25,964,720.22
本报告期基金总申购份额	41,245,545.09
减：本报告期基金总赎回份额	20,631,029.93
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	46,579,235.38

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

本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2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。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的重大人事变动

本报告期内，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	248,635,211.91	41.83%	231,554.97	41.83%	—
广发证券	2	162,982,785.1	27.42%	151,784.36	27.42%	—
申银万国	1	133,788,676.46	22.51%	124,597.39	22.51%	—
国信证券	1	26,213,049.77	4.41%	24,412.28	4.41%	—

中信证券	1	22,730,488.25	3.82%	21,168.79	3.82%	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	1	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
广州证券	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. 本基2015年新增国都证券的，东方证券，广发证券，国信证券，兴业证券，中信证券上海交易单元；国都证券，安信证券，广发证券，国金证券，国泰君安，海通证券，申万宏源西部证券，申银万国，光大证券，华泰证券，东北证券，中信建投，中投证券，东吴证券，西南证券，平安证券深圳的交易单元。本报告期内，本基金新增广州证券，东兴证券深圳交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	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	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	172,500,000	58.99%	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	72,500,000	24.79%	—	—
中信证券	—	—	47,400,000	16.21%	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—
中投证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
广州证券	—	—	—	—	—	—

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. 本基2015年新增国都证券的，东方证券，广发证券，国信证券，兴业证券，中信证券上海交易单元；国都证券，安信证券，广发证券，国金证券，国泰君安，海通证券，申万宏源西部证券，申银万国，光大证券，华泰证券，东北证券，中信建投，中投证券，东吴证券，西南证券，平安证券深圳的交易单元。本报告期内，本基金新增广州证券，东兴证券深圳交易单元。

### 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关于旗下基金2015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	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“创意信息”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“数源科技”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
5	中欧基金管理有限公司督察长离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
6	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“信质电机”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-06
7	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
8	中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金恢复大额申购、转换转入的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-08
9	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“三钢闽光”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
10	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-20
11	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开通部	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-22

	分基金定投业务的公告		
12	中欧基金管理有限公司关于在旗下理财交易及客户服务平台开展定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-03
13	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“众和股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-17
14	中欧基金管理有限公司代行督察长公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-19
15	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“盛通股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-23
16	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优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-25
17	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开通部分基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-08
18	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开展转换交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-12
19	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
20	中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-21
21	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-27
22	中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-07

23	中欧基金管理有限公司关于新增金牛理财为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-16
24	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-30
25	中欧时代先锋股票型发起式基金更新招募说明书（2016年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-16
26	中欧时代先锋股票型发起式基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-16
27	中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-17
28	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-17
29	中欧基金管理有限公司关于新增招商银行为中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金代销机构同步开通转换、定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-18

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧时代先锋股票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](http://www.zofund.com))查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日