

中欧沪深300指数增强

2015 年

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
一、收入	42,491,177.39	-4,538,706.90			
1.利息收入	100,319.66	80,948.48			
其中:存款利息收入	99,157.78	80,024.17			
债券利息收入	3.19	—			
资产支持证券利息收入	—	—			
买入返售金融资产收入	1,158.69	924.31			
其他利息收入	—	—			
2.投资收益(损失以“-”号填列)	62,566,566.98	-1,689,036.36			
其中:股票投资收益	61,643,416.65	-1,178,781.27			
基金投资收益	—	—			
债券投资收益	10,799.71	—			
资产支持证券投资	—	—			
衍生工具投资收益	—	—			
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	912,350.72	1,489,744.91			
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-20,453,304.65	-2,935,671.04			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,934,685.65	5,052.02			
减:费用	1,928,226.40	1,169,347.26			
1. 管理人报酬	864,121.14	677,325.88			
2. 托管费	129,129.31	101,596.86			
3. 销售服务费	—	—			
4. 交易费用	628,012.01	83,768.46			
5. 利息支出	—	—			
其中:卖出回购的金融资产支出	—	—			
6. 其他费用	312,142.24	306,654.06			
利润总额(亏损总额以“-”号填列)	40,566,478.74	-5,708,054.16			
减:所得税费用	—	—			
净利润(净亏损以“-”号填列)	40,566,478.74	-5,708,054.16			
附注:根据《基金法》和《基金合同》约定,本基金按照以下方法计提基金费用(LOP)					
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			上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
一、期初所有者权益(基金净值)	285,269,910.52	51,696,909.23	316,966,820.15	—	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	40,566,478.74	40,566,478.74	—	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-186,569,740.81	-49,710,264.70	-236,279,005.51	—	
其中:1.基金申购款	43,883,218.93	17,795,064.11	61,658,277.07	—	
2.基金赎回款	-230,422,959.74	-67,505,328.84	-297,928,282.58	—	
四、本期基金份额持有人的分配款项	—	—	—	—	
其中:1.基金赎回款	—	—	—	—	
五、期末所有者权益(基金净值)	78,710,170.11	42,543,123.27	121,253,293.38	—	
单位:人民币元					
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
一、期初所有者权益(基金净值)	186,708,873.97	-39,420,426.24	147,288,447.73	—	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-5,708,054.16	-5,708,054.16	—	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-17,455,946.39	4,195,046.33	-13,260,800.06	—	
其中:1.基金申购款	6,656,093.92	1,621,061.05	5,135,042.23	—	
2.基金赎回款	-24,111,940.36	-5,716,088.77	-18,386,042.29	—	
四、本期基金份额持有人的分配款项	—	—	—	—	
其中:1.基金赎回款	—	—	—	—	
五、期末所有者权益(基金净值)	169,253,027.58	-40,303,423.07	128,919,594.51	—	
附注:财务报表附注的说明					
附注1.6.4财务报表由下列各方签署:					
刘建荣	曾志斌	郭朝晖			
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人			
基金管理人					
基金管理人中欧基金管理有限公司(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会于2014年12月16日在深证交易所《关于核准中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)募集注册》,由中欧基金管理有限公司(中华人民共和国境内)和中国国际金融有限公司(以下简称“中金国际”,注册地为中国香港)共同发起设立。中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同于2015年1月1日正式生效。本基金为上市型开放式基金,基金类型为股票型基金,基金运作方式为契约型。本基金的投资范围为:国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证、资产支持证券、股指期货、期权、权证、货币市场工具、金融衍生品等。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%,其中投资于沪深300指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的中高风险品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、保本混合基金等证券投资基金。本基金的风险收益特征为:本基金属于证券投资基金中的					

基金投资组合公告									
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 持仓总额	期末 估值总额
000024	招商地产	2015-09-03	筹划重大事项	3164		-	15,357	266,018.53	485,895.40
000563	粤电力A	2015-06-08	筹划重大事项	1194	2015-07-21	10.75	101,800	97,711.50	128,952.00
000564	皖能电力	2015-06-12	筹划重大事项	2136	2015-07-14	19.22	14,400	260,361.00	307,584.00
000070	深圳燃气	2015-03-09	筹划重大事项	844		-	25,293	247,154.72	213,245.04
000703	河北钢铁	2015-06-30	筹划重大事项	7.00		-	38,128	146,074.44	274,596.00
000707	新兴铸管	2015-06-18	筹划重大事项	1296		-	16,894	91,747.58	218,946.24
000709	华闻传媒	2015-06-26	筹划重大事项	20.75		-	14,406	176,634.06	288,024.50
000710	中广核电力	2015-06-29	筹划重大事项	23.57		-	8,651	110,026.01	263,904.07
000878	云南铜业	2015-06-08	筹划重大事项	2450		-	5,944	129,366.75	335,700.00
00091	电广传媒	2015-06-26	筹划重大事项	42.89		-	7,827	126,369.15	335,700.03
00096	华东医药	2015-06-26	筹划重大事项	71.48		-	1,981	58,732.76	141,601.88
002001	新和成	2015-06-30	筹划重大事项	1709	2015-07-13	18.80	5,045	81,225.99	86,219.05
002209	英飞腾	2015-06-26	筹划重大事项	37.85		-	1,988	81,210.50	188,796.80
002230	中航科技	2015-06-02	筹划重大事项	33.29	2015-07-21	30.05	4,311.25	50,085.00	50,085.00
00231	东方财富	2015-05-27	筹划重大事项	38.30		-	4,638	74,022.08	177,636.40
00235	大康国际	2015-06-27	筹划重大事项	44.35		-	5,789	166,880.91	256,742.15
00237	亚夏股份	2015-06-17	筹划重大事项	29.21	2015-07-20	26.29	4,802	63,046.58	140,266.42
002471	爱施德	2015-06-06	筹划重大事项	20.99	2015-07-21	18.60	2,719	36,810.52	57,077.81
00256	浩吉电力	2015-06-29	筹划重大事项	16.38		-	1,900	41,002.00	31,122.00
30009	国联水产	2015-06-29	筹划重大事项	31.14		-	11	391.42	342.54
60015	建设股份	2015-06-30	筹划重大事项	17.51		-	15,741	147,436.46	275,624.91
60027	亿阳信通	2015-06-01	筹划重大事项	14.62		-	8,600	73,080.73	125,732.00
60038	蓝盾股份	2015-06-09	筹划重大事项	15.71		-	5,139	74,997.11	80,732.69
60389	国投电力	2015-06-27	筹划重大事项	14.87		-	35,267	328,882.62	525,862.68
60090	长江电力	2015-06-15	筹划重大事项	12.38		-	48,284	428,162.85	587,755.92
60102	春秋航空	2015-06-27	筹划重大事项	126.09	2015-07-21	130.14	1,100	146,042.22	138,699.00
60111	中国国旅	2015-06-30	筹划重大事项	15.36	2015-07-29	14.50	23,600	55,872.21	362,588.16
60121	内蒙电力	2015-06-29	筹划重大事项	24.07	2015-07-02	21.65	6,606	56,644.74	136,717.60
60163	长城汽车	2015-06-19	筹划重大事项	36.69	2015-07-13	44.89	4,658	142,224.14	170,902.02

1. 本基金截至2015年6月30日持有的以上因公司停牌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解除后,经交易场所恢复复牌。

2. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

3. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

4. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

5. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

6. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

7. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

8. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

9. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

10. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

11. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

12. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

13. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

14. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

15. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

16. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

17. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

18. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

19. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

20. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

21. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

22. 前次停牌期间,本基金持有上述停牌股票期间作为停牌期间。

23. 前次停牌

基金投资组合报告				
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	002222	鱼跃医疗	4,689,692.02	1.48
2	603288	海天味业	4,511,289.02	1.42
3	600676	洛阳玻璃	2,785,442.00	0.88
4	600016	民生银行	2,759,570.00	0.87
5	000065	天福基建	2,136,276.00	0.67
6	000526	福耀股份	1,401,483.00	0.44
7	000009	陕钢新钢	1,374,284.00	0.43
8	600057	信达地产	1,370,244.00	0.43
9	601318	中国平安	1,322,957.00	0.42
10	601988	中国银行	1,072,056.00	0.34
11	600005	武钢股份	1,042,719.00	0.32
12	002736	国信证券	1,013,516.00	0.33
13	601766	中国铝业	945,747.91	0.30
14	601677	明泰铝业	926,687.00	0.29
15	300659	东方财富	836,367.00	0.26
16	600525	华发股份	707,824.00	0.22
17	600064	南京高科	690,772.00	0.22
18	002013	中航机电	690,720.00	0.22
19	300348	新广宇	643,713.24	0.20
20	000087	毅昌股份	640,455.00	0.20
注:买入金额和卖出成交金额(成交金额)以成交数量(股数)填列,不考虑相关交易费用。				
A2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细				
金额单位:人民币元				
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	14,046,399.90	4.43
2	601318	中国平安	10,639,230.71	3.36
3	600036	招商银行	6,961,204.66	2.20
4	002222	鱼跃医疗	4,466,336.56	2.03
5	600030	海通证券	6,378,177.00	2.01
6	603288	海天味业	5,769,019.88	1.82
7	600637	海通证券	4,916,294.00	1.55
8	600000	浦发银行	4,685,213.00	1.48
9	000002	万科A	4,383,223.00	1.39
10	601328	交通银行	2,943,223.00	0.93
11	000051	格力电器	2,899,652.46	0.91
12	000519	贵州茅台	2,886,383.89	0.91
13	001068	中国铝业	2,826,151.97	0.89
14	601011	中国太保	2,777,127.00	0.88
15	601766	中国铝业	2,768,887.00	0.87
16	600076	洛阳玻璃	2,636,041.56	0.83
17	601288	农业银行	2,519,215.00	0.79
18	000001	平安银行	2,482,971.68	0.78
19	601818	光大银行	2,176,002.00	0.78
20	600048	保利地产	2,467,830.00	0.78
注:卖出金额均按买入成交金额(成交金额)以成交数量(股数)填列,不考虑相关交易费用。				
A3 买入股票的成本/成交金额和卖出股票的收入/成交金额				
买入股票的成本(成交)总额			60,604,861.23	
卖出股票的收入(成交)总额			279,683,271.39	
注:买入股票成本、卖出股票收入均按买入成交金额(成交金额)以成交数量(股数)填列,不考虑相关交易费用。				
期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
A 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
B 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
C 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
D 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
E 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
F 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
G 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
H 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
I 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
J 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
K 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
L 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
M 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
N 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
O 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
P 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
Q 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
R 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
S 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
T 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
U 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
V 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
W 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
X 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
Y 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
Z 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AA 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AB 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AC 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AD 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AE 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AF 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AG 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AH 期末基金资产净值及基金份额持有人数量				
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。				
AI 期末基金资产净值及				