

中欧沪深300指数增强型证券投资基金 LOF

中欧价值发现股票型证券投资基金

<div>基金管理人:中欧基金管理有限公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一二年七月十九日</div> <div>基金管理人及董事承诺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责任。 基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容存在虚假记载、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。 本报告自2012年4月1日起至6月30日止。</div>		<div>基金管理人:中欧基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一二年七月十九日</div> <div>基金管理人及董事承诺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责任。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容存在虚假记载、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。 本报告自2012年4月1日起至6月30日止。</div>																																																																																																																																	
<div>基金简称中欧沪深300指数增强(LOF)(场内简称:中欧300)</div> <div>基金主代码166007</div> <div>交易代码166007</div> <div>基金运作方式契约型上市开放式(LOF)</div> <div>基金合同生效日2010年6月24日</div> <div>报告期末基金份额总额235,153,293.64份</div>		<div>基金简称中欧价值发现股票</div> <div>基金主代码166005</div> <div>交易代码166005</div> <div>基金运作方式契约型开放式</div> <div>基金合同生效日2009年7月24日</div> <div>报告期末基金份额总额1,221,970,567.28份</div>																																																																																																																																	
<div>投资目标本基金以沪深300指数作为基金投资组合跟踪的标的指数,在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均误差率不超过0.5%,年化跟踪误差率不超过7.5%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</div> <div>投资策略本基金结合深入的基本面研究和数量化投资技术,在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整,在控制与业绩比较基准跟踪风险的前提下,力求取得超越标的指数的投资收益。</div> <div>业绩比较基准95%×沪深300指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)</div> <div>风险收益特征本基金是一只股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</div> <div>基金管理人中欧基金管理有限公司</div> <div>基金托管人兴业银行股份有限公司</div>		<div>投资目标本基金通过适当的资产配置策略和积极的股票选择策略,以合理价格买入并持有具备估值优势、较强盈利能力和良好业绩持续成长性的价值型优秀企业,在注重风险控制的原则下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定资本增值。</div> <div>投资策略本基金投资策略的核心在于通过积极的股票选择,关注具备估值优势,并具备较强盈利能力和业绩可持续成长的价值型优秀企业,采取以合理价格买入并持有的仓位方式,实现基金资产的长期稳定资本增值。作为一种典型的价值股投资策略,本基金投资策略的特点在于在吸收和借鉴国内较为成熟的价值股投资经验,根据中国股票市场的特点引入相对对成熟的概念,并以此为依据通过多种市场客观标准进行股票选择和投资组合构建,从而在降低风险的同时,提高本基金投资组合的长期超额回报。</div> <div>业绩比较基准80%×沪深300指数+20%×上证国债指数</div> <div>风险收益特征本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于较高风险、较高收益、追求长期稳定资本增值的股票型证券投资基金</div> <div>基金管理人中欧基金管理有限公司</div> <div>基金托管人中国建设银行股份有限公司</div>																																																																																																																																	
<div>3.1 主要财务指标</div> <div>单位:人民币元</div> <table><tr><th>主要财务指标</th><th>报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)</th></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>-2,490,561.41</td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>2,820,836.84</td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>0.0118</td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>191,850,688.92</td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>0.8159</td></tr></table> <div>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.所述基金业绩指标不包括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。</div> <div>3.2 基金净值表现</div> <div>3.2.1 本报告期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</div> <table><tr><th>阶段</th><th>净值增长率①</th><th>净值增长率基准差②</th><th>业绩比较基准收益率③</th><th>业绩比较基准差④</th><th>①-③</th><th>②-④</th></tr><tr><td>过去三个月</td><td>1.34%</td><td>1.06%</td><td>0.28%</td><td>1.07%</td><td>1.06%</td><td>-0.01%</td></tr></table> <div>3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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</div> <div>中欧沪深300指数增强型证券投资基金 LOF 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 2010年6月24日至2012年6月30日</div>		主要财务指标	报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)	1.本期已实现收益	-2,490,561.41	2.本期利润	2,820,836.84	3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	4.期末基金资产净值	191,850,688.92	5.期末基金份额净值	0.8159	阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④	过去三个月	1.34%	1.06%	0.28%	1.07%	1.06%	-0.01%	<div>3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的股票投资组合</div> <div>3.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细</div> <table><tr><th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</th><th>数量(股)</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr><tr><td>1</td><td>600016</td><td>民生银行</td><td>935,768</td><td>5,605,250.32</td><td>2.92</td></tr><tr><td>2</td><td>601318</td><td>中国平安</td><td>117,850</td><td>5,390,459.20</td><td>2.81</td></tr><tr><td>3</td><td>600036</td><td>招商银行</td><td>399,528</td><td>4,297,325.76</td><td>2.24</td></tr><tr><td>4</td><td>601328</td><td>交通银行</td><td>793,655</td><td>3,585,033.70</td><td>1.87</td></tr><tr><td>5</td><td>600519</td><td>贵州茅台</td><td>13,724</td><td>3,282,094.60</td><td>1.71</td></tr><tr><td>6</td><td>600000</td><td>浦发银行</td><td>367,968</td><td>2,991,579.84</td><td>1.56</td></tr><tr><td>7</td><td>700002</td><td>万科A</td><td>327,188</td><td>2,915,245.48</td><td>1.52</td></tr><tr><td>8</td><td>600030</td><td>中信证券</td><td>229,687</td><td>2,900,946.81</td><td>1.51</td></tr><tr><td>9</td><td>600837</td><td>海通证券</td><td>285,456</td><td>2,748,941.28</td><td>1.43</td></tr><tr><td>10</td><td>601088</td><td>中国神华</td><td>119,992</td><td>2,697,420.26</td><td>1.41</td></tr></table> <div>3.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资组合</div> <table><tr><th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</th><th>数量(股)</th><th>公允价值(元)</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr><tr><td>1</td><td>600199</td><td>金种子酒</td><td>64,500</td><td>1,611,210.00</td><td>0.84</td></tr><tr><td>2</td><td>600066</td><td>宇通客车</td><td>49,500</td><td>1,111,770.00</td><td>0.58</td></tr><tr><td>3</td><td>002311</td><td>海大集团</td><td>46,410</td><td>828,882.60</td><td>0.43</td></tr><tr><td>4</td><td>600837</td><td>海通证券</td><td>82,000</td><td>789,660.00</td><td>0.41</td></tr><tr><td>5</td><td>002157</td><td>正邦科技</td><td>73,000</td><td>769,420.00</td><td>0.40</td></tr></table> <div>5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合</div> <div>5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细</div> <div>5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.3 其他债券资产构成</div> <div>5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资组合</div> <div>5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.77 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.81 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.83 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.87 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.89 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.90 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.93 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.94 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.95 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.96 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.98 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.99 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>5.100 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div>		序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1	600016	民生银行	935,768	5,605,250.32	2.92	2	601318	中国平安	117,850	5,390,459.20	2.81	3	600036	招商银行	399,528	4,297,325.76	2.24	4	601328	交通银行	793,655	3,585,033.70	1.87	5	600519	贵州茅台	13,724	3,282,094.60	1.71	6	600000	浦发银行	367,968	2,991,579.84	1.56	7	700002	万科A	327,188	2,915,245.48	1.52	8	600030	中信证券	229,687	2,900,946.81	1.51	9	600837	海通证券	285,456	2,748,941.28	1.43	10	601088	中国神华	119,992	2,697,420.26	1.41	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	600199	金种子酒	64,500	1,611,210.00	0.84	2	600066	宇通客车	49,500	1,111,770.00	0.58	3	002311	海大集团	46,410	828,882.60	0.43	4	600837	海通证券	82,000	789,660.00	0.41	5	002157	正邦科技	73,000	769,420.00	0.40
主要财务指标	报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)																																																																																																																																		
1.本期已实现收益	-2,490,561.41																																																																																																																																		
2.本期利润	2,820,836.84																																																																																																																																		
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118																																																																																																																																		
4.期末基金资产净值	191,850,688.92																																																																																																																																		
5.期末基金份额净值	0.8159																																																																																																																																		
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④																																																																																																																													
过去三个月	1.34%	1.06%	0.28%	1.07%	1.06%	-0.01%																																																																																																																													
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)																																																																																																																														
1	600016	民生银行	935,768	5,605,250.32	2.92																																																																																																																														
2	601318	中国平安	117,850	5,390,459.20	2.81																																																																																																																														
3	600036	招商银行	399,528	4,297,325.76	2.24																																																																																																																														
4	601328	交通银行	793,655	3,585,033.70	1.87																																																																																																																														
5	600519	贵州茅台	13,724	3,282,094.60	1.71																																																																																																																														
6	600000	浦发银行	367,968	2,991,579.84	1.56																																																																																																																														
7	700002	万科A	327,188	2,915,245.48	1.52																																																																																																																														
8	600030	中信证券	229,687	2,900,946.81	1.51																																																																																																																														
9	600837	海通证券	285,456	2,748,941.28	1.43																																																																																																																														
10	601088	中国神华	119,992	2,697,420.26	1.41																																																																																																																														
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	600199	金种子酒	64,500	1,611,210.00	0.84																																																																																																																														
2	600066	宇通客车	49,500	1,111,770.00	0.58																																																																																																																														
3	002311	海大集团	46,410	828,882.60	0.43																																																																																																																														
4	600837	海通证券	82,000	789,660.00	0.41																																																																																																																														
5	002157	正邦科技	73,000	769,420.00	0.40																																																																																																																														
<div>3.4 公平交易与异常交易情况</div> <div>3.4.1 公平交易制度执行情况</div> <div>3.4.2 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.3 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.4 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.5 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.6 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.7 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.8 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.9 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.10 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.11 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.12 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.13 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.14 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.15 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.16 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.17 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.18 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.19 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.20 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.21 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.22 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.23 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.24 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.25 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.26 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.27 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.28 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.29 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.30 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.31 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.32 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.33 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.34 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.35 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.36 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.37 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.38 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.39 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.40 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.41 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.42 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.43 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.44 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.45 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.46 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.47 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.48 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.49 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.50 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.51 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.52 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.53 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.54 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.55 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.56 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.57 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.58 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.59 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.60 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.61 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.62 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.63 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.64 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.65 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.66 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.67 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.68 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.69 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.70 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.71 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.72 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.73 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.74 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.75 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.76 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.77 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.78 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.79 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.80 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.81 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.82 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.83 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.84 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.85 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.86 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.87 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.88 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.89 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.90 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.91 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.92 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.93 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.94 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.95 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.96 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.97 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.98 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.4.99 异常交易行为的专项说明</div> <div>3.5 投资组合报告</div> <div>3.5.1 报告期末基金资产组合情况</div> <div>3.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合</div> <div>3.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.77 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.81 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.83 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.87 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.89 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.90 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.93 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.94 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.95 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.96 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.98 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.99 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.6 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.7 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.8 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.9 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.10 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.11 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.12 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.13 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.14 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.15 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.16 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.17 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.18 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.19 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.20 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.21 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.22 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.23 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.24 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.25 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.26 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.27 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.28 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.29 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.30 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.31 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.32 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.33 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.34 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.35 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.36 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.37 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.38 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.39 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.40 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.41 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.42 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.43 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.44 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.45 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.46 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.47 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.48 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.49 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.50 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.51 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.52 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.53 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.54 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.55 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.56 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.57 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.58 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.59 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.60 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.61 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.62 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.63 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.64 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.65 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.66 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.67 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.68 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.69 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.70 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.71 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.72 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.73 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.74 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.75 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.76 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.77 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.78 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.79 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.80 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.81 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.82 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.83 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.84 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.85 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.86 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.87 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.88 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.89 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.90 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.91 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.92 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.93 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.94 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.95 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.96 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.97 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.98 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.99 基金管理人、基金托管人的办公场所</div> <div>3.100 基金管理人、基金托管人的办公场所</div>																																																																																																																																			
<div>3.5 投资组合报告</div> <div>3.5.1 报告期末基金资产组合情况</div> <div>3.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合</div> <div>3.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div> <div>3.5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细</div>																																																																																																																																			

基金管理人:中欧基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一二年七月十九日		4 买入返售金融资产		100,000,000.00	8.03
重要提示		其中:买断式回购的买入返售金融资产		-	-
基金管理人及基金托管人承诺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责任。		5 银行存款和结算备付金合计		24,447,277.18	1.96
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。		6 其他各项资产		111,484,164.84	8.95
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。		7 合计		1,245,345,269.27	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合					
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
A	农、林、牧、渔业	11,853,793.88	1.00		
B	采矿业	48,092,808.39	4.06		
C	制造业	492,308,730.49	41.56		
CO	食品、饮料	152,665,637.60	12.89		
C1	纺织、服装、皮毛	23,747,439.88	2.00		
C2	木材、家具	-	-		
C3	造纸、印刷	6,748,514.35	0.57		
C4	石油、化学、塑胶、塑料	58,860,341.81	4.97		
C5	电子	33,656,705.20	2.84		
C6	金属、非金属	24,892,396.94	2.10		
C7	机械、设备、仪表	170,181,044.71	14.37		
C8	医药、生物制品	21,556,650.00	1.82		
C99	其他制造业	-	-		
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,511,824.40	0.30		
E	建筑业	25,139,817.66	2.12		
F	交通运输、仓储业	19,325,609.30	1.63		
G	信息技术业	52,029,607.80	4.39		
H	批发和零售贸易	62,523,495.70	5.28		
I	金融、保险业	146,454,071.63	12.36		
J	房地产业	17,949,893.80	1.52		
K	社会服务业	42,587,388.00	3.60		
L	传播与文化产业	24,421,786.00	2.06		
M	综合类	2,799,000.00	0.24		
	合计	948,997,827.25	80.12		
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	7,530,000	45,504,700.00	3.81
2	002304	洋河股份	303,198	40,795,200.00	3.44
3	600199	金种子酒	1,518,391	37,929,407.18	3.20
4	601166	兴业银行	2,650,000	34,397,000.00	2.90
5	600036	招商银行	3,010,230	32,871,710.60	2.78
6	600030	中信证券	1,429,981	18,060,660.03	1.52
7	000517	中联重科	1,757,917	16,373,907.51	1.40
8	600818	康美药业	1,130,000	17,424,600.00	1.47
9	000058	五 粮 液	530,000	17,362,800.00	1.47
10	002385	大北农	892,000	17,304,800.00	1.46
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合					
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	国家债券	-	-		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	60,416,000.00	5.10		
4	其中:政策性金融债	60,416,000.00	5.10		
4	企业债券	-	-		
5	企业短期融资券	-	-		
6	中期票据	-	-		
7	可转债	-	-		
8	其他	-	-		
9	合计	60,416,000.00	5.10		
5.5 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债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0302020	03国债02	200,000	20,190,000.00	1.70
2	110303	11进出03	200,000	20,112,000.00	1.70
3	110408	11农发08	100,000	10,067,000.00	0.85
4	120405	12农发05	100,000	10,047,000.00	0.85
5	-	-	-	-	-
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。					
5.7 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权证投资明细					
本基金本报告期末未持有权证。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 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、处罚的情况。					
5.8.2 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。					
5.8.3 其他各项资产构成					
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金	-			
2	应收证券清算款	85,805,180.91			
3	应收股利	30,584.70			
4	应收利息	618,363.14			
5	应收申购款	25,030,036.05			
6	其他应收款	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	111,484,164.84			
5.8.4 报告期内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。					
5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000157	中联重科	17,631,907.51	1.49	召开股东大会
5.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分					
本报告因四舍五入原因,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误差。					
6 开放式基金业绩变动					
单位:元					
本报告期初基金份额总额		761,739,650.54			
本报告期基金总申购份额		478,628,644.96			
减:本报告期基金总赎回份额		18,397,728.22			
本报告期基金净申购/赎回份额		-			
本报告期末基金份额总额		1,221,970,567.28			
7 备查文件目录					
7.1 备查文件目录					
1、中欧价值发现股票型证券投资基金相关批准文件					
2、《中欧价值发现股票型证券投资基金基金合同》					
3、《中欧价值发现股票型证券投资基金招募说明书》					
4、《中欧价值发现股票型证券投资基金托管协议》					
5、基金管理人业务资格批件、营业执照					
7.2 备查文件目录					
6、本报告期在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告					
7.3 查阅方式					
投资者可登录基金管理人网站(www.leifunds.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查阅。					
投资者对本报告如有疑问,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 二〇一二年七月十九日					