

2015 半年度报告摘要

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	占基金资产净值比例
						(%)
	1	000882	嘉善堂	1,402,925	78,498,317.90	0.75
	2	000420	现代制药	1,269,161	54,803,952.50	0.56
	3	601916	中国铝业	3,431,003	44,843,200.21	0.46
	4	600000	海信电器	1,283,707	31,560,363.13	0.32
	5	000681	视觉中国	599,911	24,632,346.66	0.25
	6	002650	加加食品	160,000	9,496,550.00	0.10
	7	000948	承德露露	449,160	8,139,090.00	0.08
	8	300213	佳讯飞鸿	200,000	8,158,000.00	0.08
	9	002535	华信股份	489,377	7,504,635.46	0.08
	10	002878	顺鑫农业	750,000	7,526,000.00	0.08

注：投资者对基金投资前基金资产净值的所有变动明细，均应当登录于www.zotfund.com 网站的半年度报告全文。

7.4 报告期内买入卖出股票及债券的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	600000	海信电器	89,323,568.40	0.90	
2	000462	嘉善堂	76,471,688.03	0.77	
3	600420	现代制药	58,887,121.03	0.56	
4	004958	烽火通信	38,175,480.15	0.39	
5	600681	视觉中国	37,985,348.08	0.39	
6	601916	中国铝业	32,649,100.17	0.33	
7	600887	伊利股份	28,166,887.89	0.29	
8	002516	江苏舜耕	23,206,630.39	0.25	
9	601311	皖能股份	22,812,440.00	0.23	
10	000332	白云山	19,911,918.81	0.20	
11	300086	康芝药业	17,939,647.64	0.18	
12	002953	德科利	17,470,598.63	0.18	
13	600658	天力	17,135,380.88	0.17	
14	601218	中国平安	16,964,420.61	0.17	
15	000968	北京三友	16,639,706.76	0.17	
16	600694	达信股份	13,261,728.02	0.13	
17	002035	华帝股份	10,925,967.80	0.11	
18	002650	加加食品	10,865,751.00	0.11	
19	000848	承德露露	10,460,938.75	0.11	
20	002005	华信股份	10,347,770.00	0.10	

注：买入金额指买入成交金额(成交买入金额以成交数量乘以成交均价计算，不含相关交易费用)。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	601916	中国铝业	79,171,988.00	0.80	
2	600000	海信电器	47,587,025.63	0.46	
3	600499	烽火通信	36,115,122.70	0.36	
4	600887	伊利股份	27,994,883.69	0.26	
5	601311	皖能股份	26,367,200.11	0.26	

6	600332	白云山	19,038,694.36		0.19
7	601318	中国平安	17,716,630.86		0.18
8	300086	康芝药业	16,668,363.62		0.17
9	600625	天士力	16,454,969.93		0.17
10	000958	东方能源	16,412,093.00		0.16
11	002953	海康科	15,477,472.38		0.16
12	000916	江苏洋行	14,268,881.05		0.14
13	002462	康泰生物	14,118,480.00		0.14
14	600594	舒神制药	13,954,232.70		0.14
15	000951	格力电器	9,922,136.68		0.10
16	000860	顺鑫农业	7,619,630.13		0.08
17	603718	寿力生物	2,883,424.16		0.03
18	603885	吉祥航空	2,561,260.00		0.01
19	300468	金宇科技	2,444,950.16		0.02
20	002766	永兴特钢	1,934,963.34		0.02

注：1. 金额均按公允价值或金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
74.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

	金额单位：人民币元
买入股票成本（成交）总额	653,864,882.70
卖出股票收入（成交）总额	410,289,679.50

注：1. 买入股票成本、卖出股票收入均按公允价值或金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
75 期末按投资品种分类的投资资产组合

	金额单位：人民币元		
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国债债券	501,071,000.00	5.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	569,993,000.00	5.72
3.1	其中：政策性金融债	50,383,000.00	0.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	496,690,000.00	4.99
7	可转债	842,708.00	0.01
8	其他	1,121,000.00	0.01
9	合计	1,569,627,708.00	15.76

注：1. 其他债券品种中包含可交换债券。
76 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

	金额单位：人民币元				
序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	09140208	14中国石化债02	5,000,000	519,450,000.00	5.22
2	19102008	19中煤集团MTN22	4,000,000	398,520,000.00	4.00
3	0203076	华林转债01	1,400,000	137,760,000.00	1.38
4	150009	15华昌集团09	1,200,000	120,960,000.00	1.21
5	1082107	10中石油MTN33	1,000,000	88,170,000.00	0.89

7.7 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。
7.8 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。

9. 期末按公允价值计量基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资说明

本基金截至报告期末未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的股指期货投资交易情况说明

10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

10.3 本期股指期货投资交易情况说明

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10.1.2 报告期末本基金的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10.1.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10.2 投资组合报告附注

10.2.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期均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。

10.2.2 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。

10.2.3 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	157,910.06
2	应收证券清算款	66,511.45
3	应收利息	—
4	应收股利	12,049,084.69
5	应收申购款	496,560.32
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,730,067.32

11.2.4 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。

11.2.5 前十名“名称”中不存在通过港股通交易的投资标的

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

11.2.6 报告期末报告附注的其他事项描述

本报告中国债五五久期、股指期货持仓合约公允价值占净资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金申购费率与赎回费率

8.1 期末基金申购费率与赎回费率与结构

份额类别	持有人数 (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
收益和固定 收益类	20,904	467,271.27	1,198,568, 341.92	73.70%	2,569,290, 290.13	26.30%
收益和固定 收益类	236	42,701.70	—	—	10,077,601.09	100.00%
合计	21,140	462,531.52	1,198,568, 341.92	73.62%	2,579,367, 891.22	26.38%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额类别	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开 放式基金	中收收益和灵活配置混 合A	—	—
	中收收益和灵活配置混 合	—	—

8. 期末基金管理人及从业人员持有本开放式基金份额总额占基金总份额的情况					
项目	持有基金份额总额占基金总份额比例(%)—A股	持有基金份额总额占基金总份额比例(%)—C类	持有基金份额总额占基金总份额比例(%)—合计	持有基金份额总额占基金总份额比例(%)—合计	
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员/自然人持有本开放式基金	0	0	0	0	
本基金基金经理持有本开放式基金	0	0	0	0	

§ 9 开放式基金份额变动

	中欧收益和迈达富资管A	中欧收益和迈达富资管C
基金合同生效日至2015年04月15日基金份额总额	3,877,094,034.96	3,023,967.81
基金合同生效日至报告期期末基金份额总额	6,760,746,562.70	11,277,065.81
基金合同生效日至报告期期末基金份额净变动	869,888,968.01	4,221,772.13
基金合同生效日至报告期期末基金份额净变动份额		
本报告期期末基金份额总额	9,787,838,626.06	10,077,601.69

注：1. 申购份额扣除红利再投、转换转入、赎回份额的余额转换转出后。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金管理人持有大会决议
报告期内本基金持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人履行《基金托管协议》的重大事项
报告期内，基金管理人于2015年01月28日发布公告，吴自松先生自2015年01月28日起担任本基金基金经理职务，相关事项经中国证监会、基金业协会备案并公告并向中国证监会、上海证监局报备。

10.3 基金管理人、基金托管人于2015年01月28日发布公告，卢伟刚女士自2015年01月18日起担任中欧基金资产管理公司副经理，周麗文女士不再担任副总经理一职，相关变更事项已按规定向中国证监会的备案办理相关手续并向中国证监会上海证监局报备。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动
报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 基金管理人、基金托管人、基金托管人、基金托管人的诉讼
本报告期间，不涉及基金管理人、基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的重大变化
报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况
本基金自合同生效之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监管部门稽查或处罚等情况
报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金采用证券交易单元的交易情况

券商名称	交易单元数量	股票交易	债券交易	债券回购交易	权证交易	股指期货交易	融资融券业务	备注
		成交金额	占期末资产净值比例	成交金额	占期末资产净值比例	成交金额	占期末资产净值比例	
申银万国	1	283,446,534.61	29.03%	-	-	-	-	258,047.96 28.03%
中信证券	1	239,436.38	2.43%	-	-	210,000.00	5.33%	- 217.21
国信证券	2	192,096.20	19.02%	257,681,800.00	100.0%	3,489,700.00	88.80%	- 175,116.11
国信证券	1	120,136.28	11.86%	-	-	231,000.00	5.87%	- 110,143.83
兴业证券	1	115,452.81	11.42%	-	-	-	-	- 109,124.67
安信证券	1	60,497.22	5.94%	-	-	-	-	- 64,666.48

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考虑各证券经营机构的财务状况、经营状况、研究实力等因素的基础上，选择基金交易席位商，并由证监会备案我司股票账户。2. 本报告期间，中信证券、国信证券、兴业证券、安信证券、中信证券上海单元以及国信证券、申银万国、安信证券深圳交易单元。

金单位：元

中欧基金资产管理有