中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧纯债添利分级债券(场内简称:中欧添利)
基金主代码	166021
基金运作方式	契约型,添利A在添利B的每个封闭运作期内每满半年开放一次,接受申购与赎回申请;添利B根据基金合同的约定定期开放,接受申购与赎回申请,其余时间封闭运作。本基金在添利B的两个封闭运作期之间设置过渡期,办理添利A与添利B的赎回、折算以及申购等事宜。基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,本基金添利B份额申请上市与交易。
基金合同生效日	2013年11月28日
报告期末基金份额总额	889,505,091.05份
投资目标	在严格控制风险的基础上,为投资者谋求稳健的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等,在严格的风险控制基础上,力求实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合(总价)指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	中欧纯债添利分级债券A	中欧纯债添利分级债券B
下属两级基金的交易代码	166022	150159
报告期末下属两级基金的份额总额	484,099,141.05份	405,405,950.00份
下属两级基金的风险收益特征	添利A将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	添利B将表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	21,573,103.58
2.本期利润	22,917,543.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0258
4.期末基金资产净值	958,370,344.16
5.期末基金份额净值	1.077

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。

3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.38%	0.06%	0.70%	0.07%	1.68%	-0.01%

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

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金
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
(2013年11月28日-2014年9月30日)

注:1.本基金基金合同生效日为2013年11月28日,建仓期为2013年11月28日至2014年5月27日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定;

2.截至本报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期末(2014年9月30日)
添利A与添利B基金份额配比	3.58:3
期末添利A份额参考净值	1.017
期末添利A份额累计参考净值	1.041
期末添利B份额参考净值	1.150
期末添利B份额累计参考净值	1.150
添利A的预计年收益率	4.9%

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚文辉	本基金基金经理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理	2013年11月28日	-	7年	应用经济学专业硕士。历任金元证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理。2011年8月加入中欧基金管理有限公司,历任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理;现任中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理、中欧纯债添利分级债券型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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在参与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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增速继续下滑,货币政策宽松预期再次升温,随着央行结构性量化宽松政策的陆续出台,特别是公开市场操作指导利率的下降,债券市场先跌后涨,整体行情依然延续今年以来的上升态势。中欧纯债添利三季度保持平稳操作,以票息收益作为投资收益的主要来源,规避了市场的价格波动风险,为投资者带来稳健收益。

4.5 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2.38%,同期业绩比较基准增长率为0.70%,基金投资收益高于同期业绩比较基准。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	849,500,793.00	83.61
	其中:债券	789,500,793.00	77.71
	资产支持证券	60,000,000.00	5.91
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	95,000,000.00	9.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	44,853,354.60	4.41
8	其他资产	26,635,607.28	2.62
9	合计	1,015,989,754.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	582,930,993.00	60.83
5	企业短期融资券	90,932,000.00	9.49
6	中期票据	105,641,000.00	11.02
7	可转债	-	-
8	其他	9,996,800.00	1.04
9	合计	789,500,793.00	82.38

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	124561	14汾湖债	499,800	52,479,000.00	5.48
2	122929	09九江债	500,000	51,250,000.00	5.35
3	041469003	14华联投CP001	500,000	50,500,000.00	5.27
4	122930	09盐锦债	467,800	47,996,280.00	5.01
5	101455002	14汉城投MTN001	400,000	44,816,000.00	4.68

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123508	14吉城02	400,000	40,000,000.00	4.17
2	123507	14吉城01	200,000	20,000,000.00	2.09

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	60,891.06
2	应收证券清算款	27,443.67
3	应收股利	-
4	应收利息	26,526,519.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	20,753.08
8	其他	-
9	合计	26,635,607.28

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中欧纯债添利分级债券A	中欧纯债添利分级债券B
报告期期初基金份额总额	484,099,141.05	405,405,950.00
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	484,099,141.05	405,405,950.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人本报告期内无申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧纯债添利分级债券型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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.lcfunds.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
二〇一四年十月二十五日

中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧新动力股票(LOF)(场内简称:中欧动力)
基金主代码	166009
交易代码	166009
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年2月10日
报告期末基金份额总额	1,639,984,486.74份
投资目标	本基金通过投资于促进中国经济发展方式加快转变的新动力行业和上市公司,以求充分分享中国经济未来持续发展的成果并力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用"自上而下"和"自下而上"相结合的投资策略。在资产配置方面,自上而下地调整股票和债券等各类资产的配置比例;在投资品种选择方面,自下而上地选择具有投资价值的证券品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	84,395,244.13
2.本期利润	362,929,934.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.3056
4.期末基金资产净值	2,499,965,322.76
5.期末基金份额净值	1.5244

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。

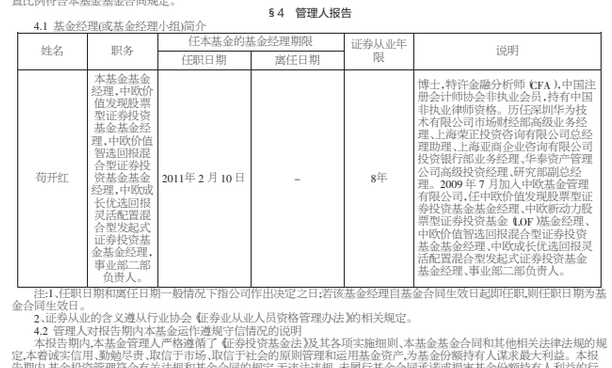
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	23.12%	0.82%	10.23%	0.67%	12.89%	0.15%

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

中欧新动力股票型证券投资基金(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
(2011年2月10日-2014年9月30日)



注:本基金合同生效日为2011年2月10日,建仓期为2011年2月10日至2011年8月9日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苟开红	本基金基金经理,中欧价值发现股票型证券投资基金基金经理,中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金经理,中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,事业部二部负责人。	2011年2月10日	-	8年	博士,特许金融分析师(CFA),中国注册会计师协会非执业会员,持有中国非执业律师资格。历任深圳华为技术有限公司市场财经部高级业务经理、上海荣正投资咨询有限公司总经理助理、上海亚商企业咨询有限公司投资银行部业务经理、华泰资产管理公司高级投资经理、研究部副总经理。2009年7月加入中欧基金管理有限公司,任中欧价值发现股票型证券投资基金基金经理、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金经理、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、事业部二部负责人。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年三季度,市场整体表现较好,本基金在二季末充分利用市场调整优化个股,提高仓位,而在本季也依据市场的轮动而不断动态调整、优化组合,取得了相对较好的业绩表现,报告期内净值实现正增长。

4.5 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23.12%,同期业绩比较基准增长率为10.23%,基金投资收益高于同期业绩比较基准。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,808,317,733.60	71.40
	其中:股票	1,808,317,733.60	71.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,010,000.00	0.79
	其中:债券	20,010,000.00	0.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	360,000,000.00	14.21
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	309,611,447.00	12.22
8	其他资产	34,789,120.51	1.37
9	合计	2,532,728,301.11	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	93,745,518.08	3.75
B	采矿业	54,238,013.88	2.17
C	制造业	1,306,826,347.28	52.27
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	42,181,127.44	1.69
E	建筑业	42,940,465.40	1.72
F	批发和零售业	47,593,235.29	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	46,001,826.35	1.84
H	住宿和餐饮业	3,729,547.60	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,270,400.40	3.77
J	金融业	7,293,000.00	0.29
K	房地产业	11,946,376.64	0.48
L	租赁和商务服务业	10,199,362.50	0.41
M	科学研究和技术服务业	12,139,039.50	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	30,066,973.24	1.20
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	5,146,500.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	1,808,317,733.60	72.33

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	002004	华邦颖泰	1,330,000	25,762,100.00	1.03
2	300203	聚光科技	1,179,883	21,981,220.29	0.88
3	002157	正邦科技	2,050,261	20,974,170.03	0.84
4	300227	光韵达	803,215	20,891,622.15	0.84
5	002264	新华都	2,511,460	20,820,003.40	0.83
6	002136	安纳达	1,755,000	20,200,050.00	0.81
7	600028	中国石化	3,780,000	20,034,000.00	0.80
8	300076	GQY视讯	972,009	19,828,983.60	0.79
9	600751	天津海运	2,185,000	19,686,850.00	0.79
10	002026	山东威达	1,901,001	19,618,330.32	0.78

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	20,010,000.00	0.80
	其中:政策性金融债	20,010,000.00	0.80
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	20,010,000.00	0.80

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	130243	13国开43	200,000	20,010,000.00	0.80
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的上市公司中国石油化工股份有限公司(中国石化,代码:600028)于2014年1月13日发布公告称2013年11月22日凌晨,公司位于青岛经济技术开发区的东黄复线原油管道发生破裂,导致原油泄漏,部分原油漏入市政排水暗渠。当日上午10点25分,市政排水暗渠发生爆炸,导致周边行人、居民、捡拾人员伤亡的重大事故。本次事故共造成62人死亡,136人受伤。公司对遇难者表示沉痛的悼念,对受伤人员及家属表示深切的慰问。公司决定将每年11月22日作为中国石化安全生产警示日,以告慰逝者,警示后人。本次事故发生后,公司及时进行抢险、搜救、清理和善后处理工作,积极配合国务院事故调查组进行相关分析调查,同时调整生产运行,努力减少本次事故对生产经营造成的影响。国务院对山东省青岛市"11.22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元,公司将承担其相应赔偿责任。相关资金主要来自中国石化在以前年度积累的安全生产保险基金和公司向商业保险公司投保的商业巨灾保险的保险理赔资金。

本基金有关该股票的投资决策程序,符合法律法规和公司规章制度的规定。本基金经研究认为,在事故发生后公司及中国石化相关董事、监事、高级管理人员服从国务院事故调查组对本次事故责任的认定,并接受对相关责任人员的处理决定,并且全力配合当地政府做好事故善后工作,全面排查整改油气管网等各类隐患,牢记血的教训,举一反三,堵塞管理漏洞,完善各项制度。本基金经过认真研究,认为公司在事故发生后有主动改正错误的态度,且公司总体生产经营和财务状况保持稳定,2014年公司适逢国企改革和油气改革的双重利好因素推动,具备未来的投资价值。

其余九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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	879,468.26
2	应收证券清算款	7,998,894.77
3	应收股利	-
4	应收利息	1,149,854.15
5	应收申购款	24,745,780.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	34,789,120.51

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	990,450,531.06
报告期期间基金总申购份额	1,181,694,410.19
减:报告期期间基金总赎回份额	532,160,454.51
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,639,984,486.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人本报告期内无申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)相关批准文件

2、《中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)托管协议》

4、《中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.lcfunds.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
二〇一四年十月二十五日

英大领先回报混合型发起式证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月20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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	领先回报
基金主代码	000458
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月5日
报告期末基金份额总额	106,930,908.25份
投资目标	本基金主要采用宏观周期策略与精选行业领先企业策略,寻找能够持续为股东创造价值的投资标的,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。
投资策略	本基金以自上而下和自下而上相结合的方构建投资组合,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为混合型基金,核心投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、股票选择策略,通过上述策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+50%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	6,880,737.70
2.本期利润	9,962,181.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1099
4.期末基金资产净值	112,210,297.27
5.期末基金份额净值	1.0494

注:①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。

②本期已实现收益指基金本期投资收益、利息收入、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。

3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	11.07%	0.87%	7.06%	0.45%	4.01%	0.42%

注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2014年3月5日至2014年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
秦岭	研究部副总经理,本基金基金经理	2014年3月5日	-	8	秦岭先生,清华大学管理学硕士。8年证券、基金行业从业经历。2012年9月加入我公司,现任英大基金管理有限公司研究部副总经理。历任国务院发展研究中心助理研究员,天弘基金研究部研究员,大成基金研究部研究员,中国国际金融有限公司研究部高级经理。
赵强	权益投资部基金经理,本基金基金经理	2014年3月5日	-	11	赵强先生,南开大学管理学硕士。2012年9月加入英大基金管理有限公司,现任英大基金管理有限公司权益投资部基金经理。具备16年金融业从业经历,其中11年基金行业从业经历。历任职于国金通用基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、招商银行天津分行、中国农业银行天津分行等金融机构。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合