

## 中欧新趋势股票型证券投资基金 (LOF)

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

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:2015年4月22日

#### §1 重要提示

基金管理人承诺及重要提示: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:2015年4月22日

#### §2 基金产品概况

基金名称:中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)  
场内简称:中欧趋势  
基金代码:160012  
基金运作方式:契约型上市开放式基金(LOF)  
基金合同生效日:2007年1月29日  
基金合同生效前基金简称:中欧新趋势股票型证券投资基金  
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

基金业绩比较基准:80%沪深300指数收益率+20%中证100指数收益率  
投资策略:本基金通过投资于国内宏观经济以及资本市场发展趋势的上市公司,在兼顾流动性的前提下,追求超越基金业绩比较基准的长期投资资本增值。  
风险控制:本基金的投资将以分散化的投资组合分散非系统性风险,在兼顾流动性的前提下,追求超越基金业绩比较基准的长期投资资本增值。

#### §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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	752,061,202.25
2.本期利润	751,425,348.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.2856
4.期末基金份额净值	3.321,267,199.66
5.期末基金净值总额	1,224.31

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.本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	业绩比较基准	净值增长率与业绩比较基准差	①-③	②-④
过去三个月	30.26%	1.29%	14.99%	1.73%	-15.25%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金合同生效日为2007年1月29日,建仓期为2007年1月29日至2007年2月28日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同规定。

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

周文 基金经理 2011年8月16日 - 15年 曾留学瑞士,历任光大证券研究所研究员,国信基金资产管理公司研究员,嘉实基金管理有限公司,2011年11月加入中欧基金管理有限公司,历任中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 基金经理助理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

周文 基金经理助理 2011年8月16日 - 15年 曾留学瑞士,历任光大证券研究所研究员,国信基金资产管理公司研究员,嘉实基金管理有限公司,2011年11月加入中欧基金管理有限公司,历任中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理。

#### 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明  
报告期内,本基金管理人严格执行《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,通过系统和人工方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现异常交易行为,未发现不公平交易的情况。

#### 4.4 关联交易专项说明

4.4.1 关联交易专项说明  
报告期内,本基金管理人管理的有投资组合不存在参与的交易公开竞价或交易或成交较多的单边交易,且不存在其他可能影响公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度,整体经济企稳的担忧下,股市延续了去年四季度以来的火爆行情,各主要股指普遍上涨,中小盘股表现尤为突出,本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其各项实施细则,本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律法规和基金合同的规定,无法追述,未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.6 报告期内基金持有人或数、基金份额净值变动情况

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元的情形。

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 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	2,928,551,402.85	88.51
2	其中:股票	2,928,551,402.85	88.51
3	固定收益投资	1,802,512,643.20	5.63
4	其中:债券	1,802,512,643.20	5.63
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	108,216,699.25	3.27
8	其他资产	142,095,943.23	4.29
9	合计	3,308,488,458.73	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	450,591,206.29	14.02
B	采矿业	1,422,976,732.01	44.20
C	制造业	76,607,414.73	2.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	297,190,681.82	9.23
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	4,165,645.00	0.13
I	金融业	26,232,015.21	0.79
J	房地产业	21,779,411.89	0.66
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	医药制造业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	102,702,138.47	3.20
O	住宿和餐饮业	-	-
P	教育、文化和娱乐业	19,354,458.52	0.59
Q	卫生和社会工作	25,819,553.76	0.80
R	文化、体育和娱乐业	19,354,458.52	0.59
S	综合	1,432,440.40	0.04
T	其他	2,928,551,402.85	91.13

#### 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组合

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	002714	碧水源	2,500,010	191,100,735.00	5.93
2	002223	鑫农医疗	4,012,842	148,981,371.16	4.51
3	600666	宇通客车	3,882,568	115,195,792.56	3.54
4	601136	新安股份	2,071,431	109,806,557.31	3.42
5	000100	TCL集团	18,366,013	108,359,476.70	3.37
6	601461	联华药业	3,108,163	108,269,487.90	3.29
7	002072	中航光电	2,043,417	102,702,138.47	3.20
8	000043	宝通软件	2,660,523	95,832,038.46	2.98
9	000263	三钢股份	12,922,372	87,656,201.42	2.71
10	000061	华发实业	8,419,459	82,173,919.84	2.54

#### 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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	130,025,043.20	4.05	
4	其中:政策性金融债	130,025,043.20	4.05	
5	企业债券	-	-	
6	中期票据	-	-	
7	短期融资券	-	-	
8	其他	-	-	
9	合计	-	130,025,043.20	4.05

#### 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组合

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	048001	国开1301	1,269,280	130,025,043.20	4.05

#### 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,故此不适用。

#### 5.9.3 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,故此不适用。

#### 5.9.4 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,故此不适用。

#### 5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

期权投资不属于本基金的投资范围,故此不适用。

#### 5.11 本期国债逆回购交易统计

5.11.1 本期国债逆回购交易统计  
报告期内,本基金未进行国债逆回购交易。

#### 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,386,272.71
2	应收证券清算款	179,086,146.37
3	应收股利	-
4	应收利息	1,840,458.11
5	应收申购款	819,051.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,095,943.23

#### 5.14 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。

#### 5.15 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000752	广生药	10,702,138.47	3.20	100%	限售

#### 6 开放式基金份额变动

单位:份	期初基金份额总额	报告期基金份额变动	期末基金份额总额
期初基金份额总额	2,622,559,966.17		
报告期基金份额变动	455,929,528.02		
减:报告期基金份额赎回	(454,274,106.01)		
减:报告期基金份额转出	(1,000,000.00)		
减:报告期基金份额申购	2,624,215,385.26		
期末基金份额总额	2,624,215,385.26		

#### 7 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份	期初持有基金份额	报告期持有基金份额
期初持有基金份额	6,001,200.00	
报告期持有基金份额	6,001,200.00	
期末持有基金份额	6,001,200.00	

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

交易日期	交易品种	交易金额(元)	交易金额(元)	占净资产
1	赎回	2015年2月10日	-6,001,200.00	-0.50%
合计		-6,001,200.00	-6,001,200.43	

#### 8 备查文件目录

1.《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)相关批准文件》  
2.《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》  
3.《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》  
4.《中欧新趋势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证件、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.lcfund.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。

#### 8.4 查阅费用

投资者查阅本说明书如有疑问,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  
二〇一五年四月二十二日

## 中欧增强回报债券型证券投资基金 (LOF)

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

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:2015年4月22日

#### §1 重要提示

基金管理人承诺及重要提示: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:2015年4月22日

#### §2 基金产品概况

基金名称:中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)  
场内简称:中欧回报  
基金代码:160008  
基金运作方式:契约型上市开放式基金(LOF)  
基金合同生效日:2007年1月29日  
基金合同生效前基金简称:中欧增强回报债券型证券投资基金  
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

基金业绩比较基准:1年期定期存款利率+1年期国债收益率  
投资策略:本基金通过投资于国内宏观经济以及资本市场发展趋势的上市公司,在兼顾流动性的前提下,追求超越基金业绩比较基准的长期投资资本增值。  
风险控制:本基金的投资将以分散化的投资组合分散非系统性风险,在兼顾流动性的前提下,追求超越基金业绩比较基准的长期投资资本增值。

#### §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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	6,836,724.52
2.本期利润	1,624,994.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0133
4.期末基金份额净值	122.081,646.10
5.期末基金净值总额	1,110.10

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.本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	业绩比较基准	净值增长率与业绩比较基准差	①-③	②-④
过去三个月	0.60%	0.25%	0.35%	1.52%	0.29%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金合同生效日为2007年12月28日,建仓期为2007年12月28日至2008年6月1日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同规定。

#### 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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹宇光	基金经理	2014年7月1日	-	9年	金融学硕士学历,曾任上海海富通证券研究所研究员,中欧基金管理有限公司研究员,中欧基金管理有限公司研究员,2007年10月加入中欧基金管理有限公司,历任中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 基金经理助理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

曹宇光 基金经理助理 2014年7月1日 - 9年 曾留学美国,历任光大证券研究所研究员,国信基金资产管理公司研究员,嘉实基金管理有限公司,2011年11月加入中欧基金管理有限公司,历任中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理,中欧新趋势股票型证券投资基金基金经理。

#### 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明  
报告期内,本基金管理人严格执行《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,通过系统和人工方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现异常交易行为,未发现不公平交易的情况。

#### 4.4 关联交易专项说明

4.4.1 关联交易专项说明  
报告期内,本基金管理人管理的有投资组合不存在参与的交易公开竞价或交易或成交较多的单边交易,且不存在其他可能影响公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度实体经济总体仍然偏弱,1-2月工业累计增加值增长6.8%,比2014年全年增速下降1.1个百分点。三、四月份工业增加值同比增长7.1%,比2014年全年增速下降1.9%,比2014年全年增速下降1.1个百分点。1-2月社会消费品零售总额同比增长10.7%,比2014年全年下降1.24个百分点。1-3月社会消费品零售总额同比增长7.9%,比2014年全年下降1.58个百分点。3月份PPI环比下降4.0%,4.4%,保持低位。中欧新趋势股票型证券投资基金投资策略:本基金通过投资于国内宏观经济以及资本市场发展趋势的上市公司,在