

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

基金管理人承诺基金及重要事项披露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约定,于2015年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。
基金的投资有风险,投资者投资于本基金可能面临波动性和流动性风险。投资者应认真阅读本基金招募说明书,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力,做出投资决策。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年1月1日起至3月31日止。

§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	160601
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
投资目标	本基金通过投资于国内宏观经济以及资本市场发展趋势良好的公司,在追求风险可控的前提下,追求超越基金业绩比较基准的长期投资资本增值。
投资策略	本基金的投资将以宏观经济分析为重点,注重把握基于未来趋势的估值机会,寻找具有良好成长性和市场突破潜力的行业、股票和债券,动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	80%*中证1000指数收益率+20%*银行人民币一年定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于中高风险,追求长期资本增值的股票型证券投资基金。产品的风险收益特征与本基金合同约定的业绩比较基准存在差异,本基金的投资将以宏观经济分析为重点,注重把握基于未来趋势的估值机会,寻找具有良好成长性和市场突破潜力的行业、股票和债券,动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。
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

§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	3.321,067,199.66
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.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	业绩比较基准②	①-②	①-②
过去三个月	30.26%	1.29%	14.99%	1.37%
			15.25%	-0.08%

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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	450,591,206.29	14.02
B	制造业	1,422,976,732.01	44.20
C	建筑业	26,767,414.73	0.82
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	297,190,611.82	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	0.81
J	房地产业	21,778,411.89	0.67
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	102,760,138.47	3.20
O	建筑业	-	-
P	建筑业	-	-
Q	卫生和社会工作	25,819,553.76	0.80
R	文化、体育和娱乐业	15,934,458.52	1.22
S	综合	1,432,416.40	0.04
T	其他	2,928,551,402.81	91.13

§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	002714	华信新材	2,500,010	191,100,735.00	5.93
2	002223	鑫农医疗	4,012,842	143,981,371.16	4.51
3	600666	宇通客车	3,882,568	115,195,792.56	3.54
4	601136	华信新材	2,071,431	109,806,557.31	3.42
5	000100	TCL 集团	18,366,013	108,359,476.70	3.37
6	601688	华泰证券	3,108,163	108,269,487.90	3.35
7	002072	中航工业	2,243,417	102,762,138.47	3.20
8	000043	深赛格	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

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资明细

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 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	048001	国开1301	1,269,280	130,025,043.20	4.05

§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。

§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。

§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。

§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。

§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,故此不适用。

§11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11.2 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,故此不适用。

§12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.12.1 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。

§13 投资组合报告附注

5.13.1 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。
5.13.2 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。
5.13.3 本基金资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存贷保证金	2,386,272.71
2	应收证券清算款	179,086,163.97
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

§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。

§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	期末受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限说明
1	000672	中航工业	102,760,138.47	3.20	限售

§16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金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,不存在非公平交易的情况。

§17 关联交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金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,不存在非公平交易的情况。

§18 关联方交易

4.3.2 关联交易专项说明
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金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,不存在非公平交易的情况。

§19 报告期末本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	2,928,551,402.81	88.51
2	其中:股票	2,928,551,402.81	88.51
3	固定收益投资	130,025,043.20	3.93
4	其中:国债	-	-
5	金融债券投资	-	-
6	企业债券投资	-	-
7	中期票据	-	-
8	其他债券	-	-
9	其他资产	142,095,943.23	4.29
10	合计	3,308,888,458.73	100.00

§20 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、牧业	450,591,206.29	14.02
B	制造业	1,422,976,732.01	44.20
C	建筑业	26,767,414.73	0.82
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	297,190,611.82	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	0.81
J	房地产业	21,778,411.89	0.67
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	102,760,138.47	3.20
O	建筑业	-	-
P	建筑业	-	-
Q	卫生和社会工作	25,819,553.76	0.80
R	文化、体育和娱乐业	15,934,458.52	1.22
S	综合	1,432,416.40	0.04
T	其他	2,928,551,402.81	91.13

§21 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	002714	华信新材	2,500,010	191,100,735.00	5.93
2	002223	鑫农医疗	4,012,842	143,981,371.16	4.51
3	600666	宇通客车	3,882,568	115,195,792.56	3.54
4	601136	华信新材	2,071,431	109,806,557.31	3.42
5	000100	TCL 集团	18,366,013	108,359,476.70	3.37
6	601688	华泰证券	3,108,163	108,269,487.90	3.35
7	002072	中航工业	2,243,417	102,762,138.47	3.20
8	000043	深赛格	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

§22 报告期末按债券品种分类的债券投资明细

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

§23 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	048001	国开1301	1,269,280	130,025,043.20	4.05

§24 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。

§25 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。

§26 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。

§27 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.27.1 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。

§28 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.28.1 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,故此不适用。

§29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.29.2 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,故此不适用。

§30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.30.1 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。

§31 投资组合报告附注

5.31.1 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。
5.31.2 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。
5.31.3 本基金资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存贷保证金	2,386,272.71
2	应收证券清算款	179,086,163.97
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

§32 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。

§33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.33.1 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。

§34 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.34.1 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,故此不适用。

§35 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.35.2 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,故此不适用。

§36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.36.1 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。

§37 投资组合报告附注

5.37.1 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、