

# 中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)

## 2012年半年度报告

### 2012年6月30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：二〇一二年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6	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.....	36
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8	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.....	37
7.9	投资组合报告附注.....	37

8	基金份额持有人信息.....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	38
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
9	开放式基金份额变动.....	38
10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	42
11	备查文件目录.....	43
11.1	备查文件目录.....	43
11.2	存放地点.....	43
11.3	查阅方式.....	43

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	中欧新趋势股票(LOF) (场内简称: 中欧趋势)
基金主代码	166001
交易代码	166001
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月29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
报告期末基金份额总额	2,246,794,373.01份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年4月23日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司, 在兼顾风险的原则下, 追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的投资风格以积极的股票选择策略为特点, 注重挖掘基于未来趋势的企业价值。资产配置和行业配置层面, 本基金在正常市场条件下不做主动性资产配置调整, 并倾向于持有较多符合经济发展和市场变革新趋势的行业。股票选择层面, 本基金通过客观化的定量分析、主观化的定性分析、证券估值等步骤选择合适的、物有所值的上市公司股票构建最优投资组合。
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金属于中高风险、追求长期稳定资本增值的股票型证券投资基金。在严格控制风险的前提下, 本基金的投资将以前瞻的眼光把握经济发展与市场变革的中长期趋势, 努力挖掘个股与板块、行业的投资机遇。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张志永
	联系电话	021-68609600	021-62677777-212004
	电子邮箱	liyihai@lcfunds.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、 400-700-9700	95561
传真		021-33830351	021-62159217
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路 66号东亚银行金融大厦8层	福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路 66号东亚银行金融大厦8层	上海市江宁路168号兴业大 厦20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		唐步	高建平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	www.lcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	1,115,015.34
本期利润	142,780,121.12
加权平均基金份额本期利润	0.0730
本期加权平均净值利润率	10.72%

本期基金份额净值增长率	11.75%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-663,117,658.08
期末可供分配基金份额利润	-0.2951
期末基金资产净值	1,583,676,714.93
期末基金份额净值	0.7049
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-16.28%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.09%	1.04%	-4.82%	0.88%	3.73%	0.16%
过去三个月	6.56%	1.00%	1.06%	0.89%	5.50%	0.11%
过去六个月	11.75%	1.16%	5.18%	1.08%	6.57%	0.08%
过去一年	-8.12%	1.13%	-14.82%	1.09%	6.70%	0.04%
过去三年	-25.89%	1.30%	-12.01%	1.25%	-13.88%	0.05%
自基金合同生效起至今	-16.28%	1.69%	7.76%	1.67%	-24.04%	0.02%

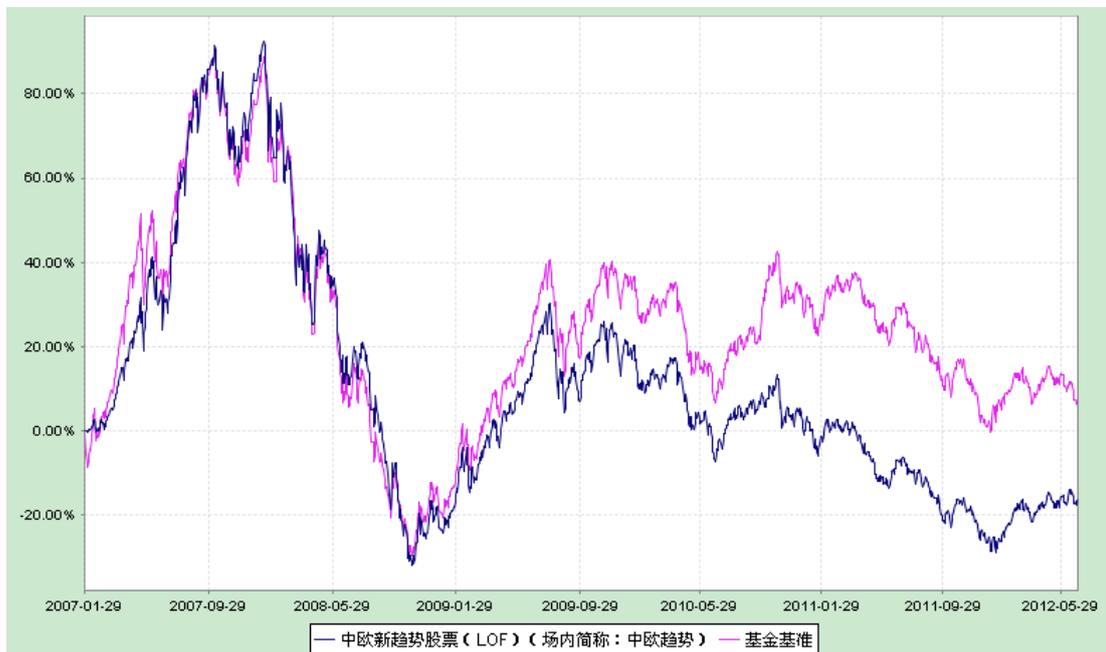
注：本基金大类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，债券资产占基金资产的0-35%，现金及剩余期限在1年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即股票资产和债券资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上，我们选择具有较强代表性的富时中国A600指数和富时中国国债全价指数作为两个大类资产的标的指数。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分80%，债券部分20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

#### 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

中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年1月29日至2012年6月30日)



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7月28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；本报告期内，本基金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 基金管理人及基金经理情况

###### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券有限责任公司、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.2亿元人民币。截至2012年6月30日，本基金管理人共管理11只开放式基金，即中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金和中欧信用增利分级债券型证券投资基金。

###### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
王海	本基金基金经理， 中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理	2010-09-02	2012-01-18	10年	特许金融分析师(CFA)，工商管理学硕士。历任通用技术集团投资管理有限公司(原上海中技投资顾问有限公司)项目经理、高级研究员、投资部副总经理，中海基金管理有限公司专户投资经理助理、专户投资经理。2009年3月加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理；现任中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
刘水云	本基金基金经理	2010-12-30	-	12年	特许金融分析师(CFA)，挪威管理学院工商管理硕士。历任波士顿基金管理有限公司高级研究员、组合经理，长信基金管理有限公司高级研究员，国海富兰克林基金管理有限公司助理基金经理，上投摩根基金管理有限公司助理基金经理。2010年8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(LOF)基金经理助理；现任中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
周蔚文	本基金基金经理， 中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理， 中欧盛世成长分级股	2011-08-16	-	12年	管理学硕士。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理。2011年1月加入中欧基金管理有限公司，历任研究部总监；现任副总经理兼投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合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

	票型证券投资基金基金经理，副总经理兼投资总监				(LOF)基金经理、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理。
腊博	本基金基金经理助理，中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2012-01-30	-	8年	金融学硕士。历任新西兰 ANYING 国际金融有限公司首席货币策略师、总经理助理，新西兰 FORSIGHT 金融研究有限公司货币和股票策略分析师，长城证券宏观策略研究员。2010年8月加入中欧基金管理有限公司，任宏观策略研究员、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，本基金在一季度判断经济是近两年周期的环比底部，二季度可能是同比底部，但存在不确定性，因此总体大类资产配置中股票仓位保持在行业平均水平。股票资产中，成长类与周期类都有布局，其中成长类主要是白酒等消费品以及国内经济的几个有成长亮点的细分行业；周期类股票主要有地产以及工程机械、煤炭、保险等，由于对经济是否会如预期那样稳定并略微提高增长保持一定的谨慎，因此周期性股票选择时强调了上市公司业绩的可靠性，在煤炭价格刚开始下跌时卖出类煤炭股票，规避了一定的风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金净值增长率为 11.75%，同期业绩比较基准增长率为 5.18%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，欧元区国家几个高负债国家的紧缩过程还将持续，其对国内出口以及金融市场资金流动都将带来负面影响，短期不能判断该过程何时结束。最近 2-3 个月，国内经济指标有所稳定，同时国家在前期出台了一些稳定经济增长的措施，正常情况下，这些措施在今后二个季度将发挥作用，国内经济有平稳并略微向上的倾向，这将对股市稳定带来正面作用。该预判的一种风险是国内房地产价格继续保持上涨，将带来进一步的限制政策，从而使地产销售量上升、库存减少、新开工增加、下游产业链需求增加的传导过程更加漫长。

除了以上短期因素，股票市场还反映国家经济的长期基本面。在目前国家主导经济、政府支配大部分资源的背景下，市场还没有看到会促使经济大概率转型成功的信号与机制，因此股票市场难以出现估值提升的大机会，我们只能从大的经济总量中寻找相对的亮点领域，并从中筛选优质公司进行投资。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无需实施利润分配。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	154,100,435.27	120,839,732.17
结算备付金		3,656,808.86	6,064,504.04
存出保证金		2,500,000.00	1,800,766.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,332,709,733.70	972,665,673.84
其中：股票投资		1,332,709,733.70	959,646,173.84
基金投资		-	-
债券投资		-	13,019,500.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	5,000,000.00
应收证券清算款		104,179,564.63	21,460,908.07
应收利息	6.4.7.5	81,800.75	263,860.14

应收股利		58,338.00	-
应收申购款		55,233.58	8,248.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,597,341,914.79	1,128,103,692.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,719,850.06	-
应付赎回款		369,569.45	230,572.90
应付管理人报酬		1,945,706.16	1,465,764.41
应付托管费		324,284.35	244,294.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,566,753.23	1,894,810.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,739,036.61	3,170,078.17
负债合计		13,665,199.86	7,005,520.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,246,794,373.01	1,777,168,215.64
未分配利润	6.4.7.10	-663,117,658.08	-656,070,043.30
所有者权益合计		1,583,676,714.93	1,121,098,172.34
负债和所有者权益总计		1,597,341,914.79	1,128,103,692.80

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.7049元,基金份额总额2,246,794,373.01份。

## 6.2 利润表

会计主体: 中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)

本报告期: 2012年1月1日至2012年6月30日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012 年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011 年6月30日
----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

<b>一、收入</b>		<b>160,227,197.81</b>	<b>-136,413,002.45</b>
1.利息收入		1,765,393.04	1,973,554.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,592,449.68	726,964.18
债券利息收入		96,798.36	446,958.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		76,145.00	799,631.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,769,500.29	-143,589,900.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,514,118.26	-153,433,128.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	140,522.03	-570,631.76
资产支持证券投资		-	-
收益			
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	7,114,860.00	10,413,859.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	141,665,105.78	5,185,037.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27,198.70	18,306.32
<b>减：二、费用</b>		<b>17,447,076.69</b>	<b>30,748,718.64</b>
1. 管理人报酬		9,872,338.54	11,426,128.52
2. 托管费		1,645,389.76	1,904,354.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,680,213.51	17,168,823.23
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	249,134.88	249,412.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>142,780,121.12</b>	<b>-167,161,721.09</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>142,780,121.12</b>	<b>-167,161,721.09</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,777,168,215.64	-656,070,043.30	1,121,098,172.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	142,780,121.12	142,780,121.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	469,626,157.37	-149,827,735.90	319,798,421.47
其中：1. 基金申购款	524,013,412.80	-166,826,110.06	357,187,302.74
2. 基金赎回款	-54,387,255.43	16,998,374.16	-37,388,881.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,246,794,373.01	-663,117,658.08	1,583,676,714.93
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,948,071,201.70	-277,505,912.95	1,670,565,288.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-167,161,721.09	-167,161,721.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-121,479,100.71	19,471,353.24	-102,007,747.47
其中：1. 基金申购款	14,706,536.61	-2,764,546.52	11,941,990.09
2. 基金赎回款	-136,185,637.32	22,235,899.76	-113,949,737.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,826,592,100.99	-425,196,280.80	1,401,395,820.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：刘建平，主管会计工作负责人：黄桦，会计机构负责人：丁驿雯

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第243号《关于同意中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集6,871,163,845.62元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第008号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2007年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,874,704,054.16份基金份额,其中认购资金利息折合3,540,208.54份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2007]第40号文审核同意,本基金776,895,297份基金份额于2007年4月23日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资比例范围为:股票资产占基金资产的60%-95%,债券资产占基金资产的0-35%,现金及剩余期限在1年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:富时中国A600指数×80%+富时中国国债全价指数×20%(原名为新华富时中国A600指数及新华富时中国国债指数)。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2012年8月24日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金

会计核算业务指引》、《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日半年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	154,100,435.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	154,100,435.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,285,226,580.41	1,332,709,733.70	47,483,153.29
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,285,226,580.41	1,332,709,733.70	47,483,153.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	80,319.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,481.04
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	0.70
其他	-
合计	81,800.75

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,566,753.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,566,753.23

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	2,500,000.00
应付赎回费	350.89
应付信息披露费	159,124.42
应付审计费	49,726.04
预提上市费	29,835.26
合计	2,739,036.61

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,777,168,215.64	1,777,168,215.64
本期申购	524,013,412.80	524,013,412.80
本期赎回（以“-”号填列）	-54,387,255.43	-54,387,255.43
本期末	2,246,794,373.01	2,246,794,373.01

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至2012年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为107,657,157.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为2,139,137,216.01份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-386,102,585.51	-269,967,457.79	-656,070,043.30
本期利润	1,115,015.34	141,665,105.78	142,780,121.12
本期基金份额交易产生的变动数	-106,267,935.98	-43,559,799.92	-149,827,735.90
其中：基金申购款	-118,653,251.77	-48,172,858.29	-166,826,110.06
基金赎回款	12,385,315.79	4,613,058.37	16,998,374.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-491,255,506.15	-171,862,151.93	-663,117,658.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	1,544,263.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	31,176.26
其他	17,010.41
合计	1,592,449.68

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	1,786,318,953.47
减：卖出股票成本总额	1,776,804,835.21
买卖股票差价收入	9,514,118.26

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,330,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,859,477.97
减：应收利息总额	330,200.00
债券投资收益	140,522.03

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,114,860.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,114,860.00

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	141,665,105.78
——股票投资	141,825,127.81
——债券投资	-160,022.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	141,665,105.78

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	6,741.51
转换费收入	51.99
其它	20,405.20
合计	27,198.70

注：1、本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	5,680,213.51
银行间市场交易费用	-
合计	5,680,213.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	159,124.42
银行汇划费用	1,449.16
上市费	29,835.26
账户维护费用	9,000.00
合计	249,134.88

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金代销机构
国都证券有限责任公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	649,550,104.59	17.15%	2,701,444,082.93	23.97%

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券	-	-	215,989.95	4.06%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	-	-	225,000,000.00	11.94%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	542,233.79	17.05%	163,700.97	10.45%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	2,239,774.44	23.75%	838,169.34	19.92%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,872,338.54	11,426,128.52
其中：支付销售机构的客户	1,419,496.61	1,824,168.00

维护费		
-----	--	--

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,645,389.76	1,904,354.67

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	6,001,200.00	6,001,200.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,001,200.00	6,001,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.27%	0.33%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	154,100,435.27	1,544,263.01	78,877,253.07	645,251.77

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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中高风险、追求长期稳定资本增值的股票型证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司，在兼顾风险的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部，负责进行风险的实时监控和定期计算，并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2011 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-------------------	------	------	------	-----	----

资产					
银行存款	154,100,435.27	-	-	-	154,100,435.27
结算备付金	3,656,808.86	-	-	-	3,656,808.86
存出保证金	-	-	-	2,500,000.00	2,500,000.00
交易性金融资产	-	-	-	1,332,709,733.70	1,332,709,733.70
应收证券清算款	-	-	-	104,179,564.63	104,179,564.63
应收利息	-	-	-	81,800.75	81,800.75
应收股利	-	-	-	58,338.00	58,338.00
应收申购款	-	-	-	55,233.58	55,233.58
资产总计	157,757,244.13	-	-	1,439,584,670.66	1,597,341,914.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,719,850.06	6,719,850.06
应付赎回款	-	-	-	369,569.45	369,569.45
应付管理人报酬	-	-	-	1,945,706.16	1,945,706.16
应付托管费	-	-	-	324,284.35	324,284.35
应付交易费用	-	-	-	1,566,753.23	1,566,753.23
其他负债	-	-	-	2,739,036.61	2,739,036.61
负债总计	-	-	-	13,665,199.86	13,665,199.86
利率敏感度缺口	157,757,244.13	-	-	1,425,919,470.80	1,583,676,714.93
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	120,839,732.17	-	-	-	120,839,732.17
结算备付金	6,064,504.04	-	-	-	6,064,504.04
存出保证金	-	-	-	1,800,766.41	1,800,766.41
交易性金融资产	13,019,500.00	-	-	959,646,173.84	972,665,673.84
应收证券清算款	-	-	-	21,460,908.07	21,460,908.07
应收利息	-	-	-	263,860.14	263,860.14
应收申购款	-	-	-	8,248.13	8,248.13
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
资产总计	144,923,736.21	-	-	983,179,956.59	1,128,103,692.80
负债					

应付赎回款	-	-	-	230,572.90	230,572.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,465,764.41	1,465,764.41
应付托管费	-	-	-	244,294.06	244,294.06
应付交易费用	-	-	-	1,894,810.92	1,894,810.92
其他负债	-	-	-	3,170,078.17	3,170,078.17
负债总计	-	-	-	7,005,520.46	7,005,520.46
利率敏感度缺口	144,923,736.21	-	-	976,174,436.13	1,121,098,172.34

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2011年12月31日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为：1.16%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2011年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的60%-95%，债券资产占0-35%，现金及剩余期限在1年以内的政府债券不少于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,332,709,733.70	84.15	959,646,173.84	85.60
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,332,709,733.70	84.15	959,646,173.84	85.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币)	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约7,940.48万元	增加约5,478.58万元
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约7,940.48万元	减少约5,478.58万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,332,709,733.70 元，无属于第二层级的余额，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 961,623,275.13 元，第二层级 11,042,398.71 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,332,709,733.70	83.43
	其中：股票	1,332,709,733.70	83.43
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	157,757,244.13	9.88
6	其他各项资产	106,874,936.96	6.69
7	合计	1,597,341,914.79	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,636,000.00	0.10
C	制造业	696,323,156.67	43.97
C0	食品、饮料	275,857,694.37	17.42
C1	纺织、服装、皮毛	84,989,253.91	5.37
C2	木材、家具	12,692,003.80	0.80
C3	造纸、印刷	837,453.42	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,793,347.33	5.48
C5	电子	14,200.00	0.00
C6	金属、非金属	28,667,440.17	1.81
C7	机械、设备、仪表	205,659,839.15	12.99
C8	医药、生物制品	811,924.52	0.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	47,825,008.50	3.02
E	建筑业	1,146,320.00	0.07
F	交通运输、仓储业	15,641,295.92	0.99
G	信息技术业	59,108,545.16	3.73
H	批发和零售贸易	111,668,702.61	7.05
I	金融、保险业	197,594,539.37	12.48
J	房地产业	133,304,195.00	8.42
K	社会服务业	66,898,866.47	4.22
L	传播与文化产业	1,563,104.00	0.10
M	综合类	-	-
	合计	1,332,709,733.70	84.15

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	2,173,213	99,402,762.62	6.28
2	000024	招商地产	3,391,360	83,190,060.80	5.25
3	000157	中联重科	6,306,743	63,256,632.29	3.99
4	600031	三一重工	4,499,724	62,636,158.08	3.96
5	600570	恒生电子	4,308,203	59,108,545.16	3.73

6	600519	贵州茅台	247,100	59,093,965.00	3.73
7	002293	罗莱家纺	764,395	57,023,867.00	3.60
8	600559	老白干酒	1,887,248	53,862,057.92	3.40
9	600021	上海电力	8,427,747	46,352,608.50	2.93
10	002262	恩华药业	1,949,221	45,397,357.09	2.87
11	000869	张裕A	661,601	44,499,283.26	2.81
12	000001	深发展A	2,799,856	42,445,816.96	2.68
13	002157	正邦科技	3,766,205	39,695,800.70	2.51
14	000858	五粮液	1,199,915	39,309,215.40	2.48
15	300198	纳川股份	2,225,153	38,962,429.03	2.46
16	600697	欧亚集团	1,695,096	38,766,845.52	2.45
17	601117	中国化学	6,700,132	38,659,761.64	2.44
18	600048	保利地产	2,930,400	33,230,736.00	2.10
19	600109	国金证券	2,021,147	29,084,305.33	1.84
20	002327	富安娜	614,759	27,965,386.91	1.77
21	002671	龙泉股份	1,149,747	27,720,400.17	1.75
22	000430	张家界	2,851,385	26,974,102.10	1.70
23	603001	奥康国际	999,830	26,905,425.30	1.70
24	000516	开元投资	6,000,000	26,760,000.00	1.69
25	000895	双汇发展	423,423	26,201,415.24	1.65
26	601633	长城汽车	1,299,567	23,132,292.60	1.46
27	600067	冠城大通	4,000,000	22,280,000.00	1.41
28	600036	招商银行	2,000,000	21,840,000.00	1.38
29	300306	远方光电	515,162	21,121,642.00	1.33
30	600309	烟台万华	1,500,000	20,025,000.00	1.26
31	600377	宁沪高速	2,664,616	15,641,295.92	0.99
32	002146	荣盛发展	1,199,988	13,079,869.20	0.83
33	002572	索菲亚	654,227	12,692,003.80	0.80
34	300159	新研股份	937,616	11,242,015.84	0.71
35	002216	三全食品	414,711	10,429,981.65	0.66
36	000002	万科A	211,900	1,888,029.00	0.12
37	002304	洋河股份	12,600	1,695,330.00	0.11
38	601601	中国太保	73,447	1,629,054.46	0.10
39	000718	苏宁环球	180,000	1,458,000.00	0.09
40	600837	海通证券	146,000	1,405,980.00	0.09
41	000961	中南建设	92,000	1,146,320.00	0.07
42	300027	华谊兄弟	68,800	1,089,104.00	0.07
43	600111	包钢稀土	24,000	947,040.00	0.06
44	000651	格力电器	45,000	938,250.00	0.06
45	600030	中信证券	74,000	934,620.00	0.06
46	600104	上汽集团	64,986	928,649.94	0.06

47	002601	佰利联	11,530	900,493.00	0.06
48	600027	华电国际	210,000	879,900.00	0.06
49	601009	南京银行	100,000	852,000.00	0.05
50	002292	奥飞动漫	39,993	837,453.42	0.05
51	600557	康缘药业	54,934	811,924.52	0.05
52	000028	国药一致	25,000	744,500.00	0.05
53	000968	煤气化	40,000	610,000.00	0.04
54	600863	内蒙华电	75,000	592,500.00	0.04
55	300190	维尔利	24,947	551,079.23	0.03
56	000568	泸州老窖	12,920	546,645.20	0.03
57	600395	盘江股份	20,000	537,600.00	0.03
58	000799	酒鬼酒	10,000	524,000.00	0.03
59	601918	国投新集	40,000	488,400.00	0.03
60	300104	乐视网	20,000	474,000.00	0.03
61	000415	渤海租赁	62,000	473,680.00	0.03
62	000616	亿城股份	125,000	457,500.00	0.03
63	300015	爱尔眼科	9,950	208,651.50	0.01
64	300274	阳光电源	9,920	124,198.40	0.01
65	300144	宋城股份	2,200	31,592.00	0.00
66	600537	亿晶光电	1,000	14,200.00	0.00

注：深发展 A (000001) 于 2012 年 8 月 2 日更名为平安银行。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	601318	中国平安	110,259,012.93	9.83
2	601788	光大证券	65,518,461.37	5.84
3	000157	中联重科	64,897,610.09	5.79
4	600031	三一重工	63,590,372.38	5.67
5	600309	烟台万华	57,181,829.68	5.10
6	002293	罗莱家纺	53,926,965.67	4.81
7	600559	老白干酒	52,946,958.04	4.72
8	000869	张裕A	47,635,769.31	4.25
9	601006	大秦铁路	45,345,001.00	4.04
10	600123	兰花科创	43,921,388.84	3.92
11	600021	上海电力	43,673,854.16	3.90
12	000937	冀中能源	42,562,884.93	3.80

13	600066	宇通客车	42,209,678.78	3.77
14	600546	山煤国际	41,738,028.09	3.72
15	600028	中国石化	38,371,860.52	3.42
16	002157	正邦科技	38,095,480.07	3.40
17	300216	千山药机	37,155,722.60	3.31
18	000024	招商地产	37,074,826.94	3.31
19	002585	双星新材	36,086,894.18	3.22
20	600570	恒生电子	35,718,747.94	3.19
21	601009	南京银行	35,150,541.89	3.14
22	300198	纳川股份	33,744,672.95	3.01
23	600036	招商银行	32,769,690.48	2.92
24	600377	宁沪高速	31,908,983.26	2.85
25	600109	国金证券	31,194,235.87	2.78
26	600795	国电电力	30,014,035.19	2.68
27	000895	双汇发展	29,795,082.69	2.66
28	600067	冠城大通	27,876,226.54	2.49
29	300190	维尔利	27,257,711.68	2.43
30	603001	奥康国际	26,939,926.93	2.40
31	600582	天地科技	26,686,795.59	2.38
32	600395	盘江股份	26,457,787.94	2.36
33	002671	龙泉股份	26,448,758.34	2.36
34	000927	一汽夏利	26,191,752.15	2.34
35	002353	杰瑞股份	25,843,017.29	2.31
36	000001	深发展 A	25,034,034.28	2.23
37	000516	开元投资	24,928,017.22	2.22
38	000728	国元证券	24,083,250.00	2.15
39	600875	东方电气	24,060,714.92	2.15
40	600858	银座股份	23,621,695.65	2.11
41	002327	富安娜	22,494,021.92	2.01

注：1. 买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 深发展 A（000001）于 2012 年 8 月 2 日更名为平安银行。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601788	光大证券	67,856,434.02	6.05
2	601318	中国平安	59,220,042.58	5.28
3	300216	千山药机	53,555,244.17	4.78
4	600795	国电电力	50,078,413.22	4.47
5	600066	宇通客车	50,027,613.37	4.46
6	600123	兰花科创	48,348,802.20	4.31

7	601006	大秦铁路	44,622,264.92	3.98
8	601009	南京银行	43,137,899.26	3.85
9	600546	山煤国际	40,780,331.73	3.64
10	000937	冀中能源	40,083,644.50	3.58
11	600028	中国石化	37,626,490.00	3.36
12	600309	烟台万华	34,569,629.16	3.08
13	600637	百视通	33,578,291.26	3.00
14	002585	双星新材	33,182,722.04	2.96
15	600395	盘江股份	33,086,937.73	2.95
16	600383	金地集团	30,162,692.82	2.69
17	002353	杰瑞股份	30,147,355.58	2.69
18	600036	招商银行	29,836,328.81	2.66
19	000002	万科A	29,691,809.86	2.65
20	000927	一汽夏利	29,203,222.01	2.60
21	300190	维尔利	28,616,582.00	2.55
22	600019	宝钢股份	28,183,213.31	2.51
23	600858	银座股份	27,341,523.84	2.44
24	000778	新兴铸管	27,032,102.88	2.41
25	002230	科大讯飞	26,052,992.41	2.32
26	600582	天地科技	26,001,930.25	2.32
27	000590	紫光古汉	24,006,383.39	2.14
28	600885	ST力阳	23,029,414.16	2.05
29	000728	国元证券	22,605,824.78	2.02

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,008,043,267.26
卖出股票的收入（成交）总额	1,786,318,953.47

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	2,500,000.00
2	应收证券清算款	104,179,564.63
3	应收股利	58,338.00
4	应收利息	81,800.75
5	应收申购款	55,233.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,874,936.96

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000157	中联重科	63,256,632.29	3.99	召开股东大会

#### 7.9.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(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
86,763	25,895.77	531,240,397.62	23.64%	1,715,553,975.39	76.36%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中欧基金管理有限公司	6,001,200.00	5.57%
2	李锡祥	2,000,200.00	1.86%
3	郁家华	1,550,000.00	1.44%
4	姜才	1,000,000.00	0.93%
5	侯升利	704,337.00	0.65%
6	宋文花	700,000.00	0.65%
7	谈德忠	565,271.00	0.53%
8	罗颖	560,268.00	0.52%
9	黄伟民	549,469.00	0.51%
10	沈跃生	500,130.00	0.46%

注：以上均为场内基金份额持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	187,752.47	0.0084%

注：1、基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0；

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月29日）基金份额总额	6,874,704,054.16
本报告期期初基金份额总额	1,777,168,215.64
本报告期基金总申购份额	524,013,412.80
减：本报告期基金总赎回份额	54,387,255.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,246,794,373.01

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2012年1月19日发布公告，王海先生自2012年1月18日起不再担任中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理。相关变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

本报告期内，基金管理人于2012年6月1日发布公告，周蔚文先生自2012年5月28日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

本报告期内，基金管理人于2012年6月2日发布公告，徐红光先生自2012年5月31日起不再担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

10.2.2 报告期内，本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 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	2	649,550,104.59	17.15%	542,233.79	17.05%	-
海通证券	1	451,529,190.49	11.92%	371,406.69	11.68%	-
华泰证券	2	464,225,886.52	12.26%	395,574.58	12.44%	-
东方证券	1	334,774,184.75	8.84%	274,559.77	8.63%	-
光大证券	1	231,230,711.63	6.11%	196,545.90	6.18%	-
广发证券	1	193,021,724.46	5.10%	165,432.93	5.20%	-
银河证券	1	192,358,845.08	5.08%	163,843.22	5.15%	-
国信证券	1	192,288,333.20	5.08%	164,838.13	5.18%	-
中信证券	1	176,202,126.18	4.65%	143,599.33	4.52%	-
申银万国	1	154,807,941.59	4.09%	132,727.64	4.17%	-
长江证券	1	142,415,227.11	3.76%	115,713.07	3.64%	-
国金证券	1	139,485,722.81	3.68%	119,644.01	3.76%	-
中金公司	1	129,813,019.45	3.43%	112,131.53	3.53%	-
瑞银证券	1	107,795,462.06	2.85%	88,138.17	2.77%	-
中航证券	1	96,585,960.13	2.55%	82,098.45	2.58%	-
齐鲁证券	1	43,591,647.39	1.15%	37,668.21	1.18%	-
西部证券	1	33,823,891.16	0.89%	28,750.25	0.90%	-
中银国际	1	26,615,672.80	0.70%	22,022.60	0.69%	-
长城证券	1	15,102,565.98	0.40%	12,837.22	0.40%	-
招商证券	1	12,284,800.87	0.32%	9,981.41	0.31%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
西藏同信	1	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2、本报告期内，新增国海证券上海交易单元、红塔证券上海交易单元，减少广发证券深圳交易单元，华泰联合上海交易单元并入华泰证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国都证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	30,000,000.00	16.67%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	100,000,000.00	55.56%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	50,000,000.00	27.78%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下基金2011年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	公司网站	2012-01-04
2	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2011年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-01-18
3	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-01-19
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“深发展A”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-01-20
5	中欧基金管理有限公司关于新增中信证券(浙江)有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-02-13
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券(浙江)有限责任公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-02-13
7	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券(浙江)有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-02-13
8	中欧基金管理有限公司关于调整《中欧基金管理有限公司直销网上交易定期定额申购业务规则》的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-03-01
9	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2012年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-03-13
10	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要(2012年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-03-13
11	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2011年年度报告(正文)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-03-27
12	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2011年年度报告(摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-03-27
13	中欧基金管理有限公司关于开通上海银联兴业银行卡基金网上直销定期定额投资业务并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-04-13
14	中欧基金管理有限公司关于网上直销平台	《中国证券报》、《上	2012-04-13

	新增上海银联相关银行借记卡支付业务的公告	海证券报》、《证券时报》、公司网站	
15	中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)2012年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-04-24
16	中欧基金管理有限公司关于成立北京分公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-05-17
17	中欧基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-06-01
18	中欧基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2012-06-02
19	中欧基金管理有限公司旗下基金2012年6月29日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	公司网站	2012-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 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）托管协议》
- 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

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 11.3 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  
二〇一二年八月二十四日