

## 中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

### 更新招募说明书摘要

(2015 年第 1 号)

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

二〇一五年九月

## 重要提示

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型而来。基金转型经2015年1月30日中欧中小盘股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自2015年1月30日起，由《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》修订而成的《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，原《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效。中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）经中国证监会变更注册为本基金，但并不表明中国证监会对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

投资有风险，投资人在申购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2015 年 7 月 29 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、基金管理人.....	5
二、基金托管人.....	10
三、相关服务机构.....	14
四、基金的名称.....	32
五、基金的存续.....	32
六、基金的投资目标.....	32
七、基金的投资范围.....	32
八、基金的投资策略.....	32
九、基金的业绩比较基准.....	36
十、基金的风险收益特征.....	36
十一、基金投资组合报告.....	37
十二、基金的业绩.....	41
十三、基金的费用与税收.....	43
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	44

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
- 3、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
- 4、法定代表人：窦玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006年7月19日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：袁维
- 13、客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.88亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资6,580万元人民币，占公司注册资本的35%；

国都证券股份有限公司出资3,760万元人民币，占公司注册资本的20%；

北京百骏投资有限公司出资3,760万元人民币，占公司注册资本的20%；

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资3,760万元人民币，占公司注册资本的20%；

万盛基业投资有限责任公司出资940万元人民币，占公司注册资本的5%。

上述5个股东共出资18,800万元人民币。

### （二）主要人员情况

## 1、基金管理人董事会成员

**竇玉明先生**，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，民航投资管理有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

**Marco D' Este 先生**，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credito Italiano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

**朱鹏举先生**，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都证券股份有限公司投资银行总部业务董事、投资银行业务内核小组副组长，兼任国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司、大连柏荣工程技术有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理。

**刘建平先生**，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事，总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

**David Youngson 先生**，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

**郭雳先生**，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

## 2、基金管理人监事会成员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

**廖海先生**，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

**黎忆海女士**，中欧基金管理有限公司职工监事，监察稽核部总监，中国籍。南开大学会计学专业硕士。历任湖南省计算机高等专科学校教师，深圳世纪星源股份有限公司财务分析员，华富基金管理有限公司监察稽核员。

**黄峰先生**，中欧基金管理有限公司职工监事，信息技术部总监，中国籍。北京大学信息科学中心信号与信息处理专业硕士。历任中再资产管理有限公司信息技术部主管，海通证券股份有限公司项目经理，微软全球技术中心工程师。

### 3、公司高级管理人员

**窦玉明先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

**刘建平先生**，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

**卢纯青女士**，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，10年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

**许欣先生**，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，13年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

**黄桦先生**，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，24年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门

经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

**曹剑飞先生**，中国籍，新加坡国立大学统计学专业硕士，13年以上证券从业经验。历任长江证券有限责任公司投资总部分析师，泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理，华宝兴业基金管理有限公司研究部高级研究员、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理助理，农银汇理基金管理有限公司投资总监、农银汇理行业成长股票型基金基金经理（2008年8月4日起至2014年4月15日）、农银汇理大盘蓝筹股票型基金基金经理（2010年9月1日起至2011年11月17日）、农银汇理消费主题股票型基金基金经理（2012年4月24日起至2013年6月24日）、农银汇理低估值高增长股票型基金基金经理（2013年3月26日起至2014年4月15日）。2014年4月加入中欧基金管理有限公司，现任投资总监、事业部负责人、中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2014年8月18日起至今）、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金（2015年3月18日起至今）。

##### （2）历任基金经理

**沈洋先生**，于2009年12月30日至2012年1月18日期间担任中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

**王海先生**，于2012年1月18日起至2014年1月10日期间担任中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

**魏博先生**，于2014年1月10日起至2015年1月16日期间担任中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 5、公司投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、曹剑飞、刘明月、周玉雄、赵国英、曲径，风控部总监卞玺云组成。其中总经理刘建平任



投资决策委员会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：570亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

#### 2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及

基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

### 3、托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2015年6月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共42只，包括中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）（原中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF））（166006）、长信纯债壹号债券型证券投资基金（原长信中短债证券投资基金）（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利债券型证券投资基金（LOF）（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）（164208）、鹏华丰泽债券型证券投资基金（LOF）（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）（162105）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金（000774）、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金（000966）、中信建投凤凰货币市场

基金（001006）、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（001194）、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金（001183）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金（001216）、易方达改革红利混合型证券投资基金（001076）、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金（001250）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（001249）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金（001285）、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金（001210）、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金（001447）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（001314）、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金（001431）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金（001433）。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 12,919.41 亿元。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控

制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，对违法违规行为及时予以风险提示，要求限期纠正，同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、场外发售机构

###### （1）直销机构：

###### 1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

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

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

###### 2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

###### （2）其他销售机构

###### 1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：刘秀宇

电话：010-6610860

传真：010-66107571

客服热线：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### 2) 招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

3) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66215533

传真：010-66218888

客服热线：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

4) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

联系人：牛峰

电话：010-85109619

传真：010-85108557

客服热线：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58766688

传真：021-58798398

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号办公地址：北京市西城区金融大街3号金鼎大厦A座6层

法定代表人：李国华

联系人：杨娟

电话：010-68858076

传真：010-68858057

客服热线：95580

网址：www.psbc.com

7) 兴业银行股份有限公司

住所：上海市江宁路168号兴业大厦9楼

办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021-52629999-218966

客服热线：95561

网址：www.cib.com.cn

8) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：穆婷

电话：010-57092845

传真：010-57092611

客服热线：95568

网站：www.cmbc.com.cn



9) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

联系人：王媛

电话：010-65556689

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

10) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：潘逸

电话：020-38322888

传真：020-87310779

客服热线：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

11) 国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

12) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

13) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130578

传真：0755-82130573

客服热线：400-109-9918

网址：www.cfsc.com.cn

14) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87550265

传真：020-87553600

网址：www.gf.com.cn

15) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

16) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：福建省福州市湖东路 268 号；上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20-22 层

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：0591-38507869

传真：0591-38507538

客服热线：95562c

网址：www.xyzq.com.cn

17) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525、400-888-8788

网址：www.ebscn.com

18) 华福证券有限责任公司

住所：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-96326

传真：010-88085195、010-88085265-8191

客服热线：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

19) 中国银河证券股份有限公司

住所：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568062

传真：010-66568704、010-66568532、010-66568640

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

20) 齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889118

传真：0531-68889093

客服热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

21) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：储晓明

联系人：黄莹

电话：4008895523

传真：021-33388224

客服热线：95523

网址：www.swhysc.com

22) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20  
楼 2005 室

法定代表人：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

23) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：王立群

电话：021-23219000

传真：021-63410707、021-63410627

客服热线：95553

网址：www.htsec.com

24) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法人代表：蔡咏

联系人：李飞

电话：0551-62207323

传真：021-38670767

客服热线：95578、400-888-8777

网址：www.gyzq.com.cn

25) 平安证券有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 层

办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 层

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

电话：0755-22622268

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

26) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676798

传真：021-38670798

客服热线：4008888666

网址：www.gtja.com

27) 安信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人：牛冠兴

联系人：张晨

电话：021-66581727

传真：010-66581721

客服热线：4008-001-001

网址：[www.essences.com.cn](http://www.essences.com.cn)

28) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

传真：010-63081173

客服热线：400-800-8899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

29) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：孔晓君

电话：0755-82943666

传真：025-84579938、025-84579778

客服热线：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

30) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616-8259

传真：021-68761616

客服热线：400-8888-128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

31) 英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：李欣

电话：0755-83007179

传真：0755-83007167

客服热线：4008-698-698

网址：www.ydsc.com.cn

### 32) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383

传真：010-60836031；0755-23835525

客服热线：95558

网址：www.citics.com

### 33) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022313

传真：0532-85022301

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

### 34) 金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼



办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025500

传真：0755-83025625

客服热线：4008-888-228

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

35) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服热线：400-809-6096

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

36) 联讯证券有限责任公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西

面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

联系人：宋航

电话：0752-2119391

传真：0931-4890628

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

37) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

38) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

电话：0510-82588168

客服热线：95570

网址：www.glsc.com.cn

39) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人：祝献忠

联系人：黄恒

电话：010-58568235

传真：010-58568140

客服热线：010-58568118

网址：www.hrsec.com.cn

40) 东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-62601555

传真：0512-62938812

客服热线：400-860-1555

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

41) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679535

客服热线：4009101166

公司网站：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

42) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：010-66045152

传真：010-66045518

客服热线：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

43) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

众禄基金销售网：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

44) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

客服热线：400-700-9665

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

45) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-58788678

传真：021-58787698

客服热线：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

46) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

47) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

48) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐昶绯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

49) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：李广宇

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

50) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：汪林林

电话：0571-88920810

传真：0571-86800423

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

51) 北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

电话：010-62020088

传真：010-62020088-8802

客服热线：400-888-6661

网址：www.myfp.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

## 2、场内发售机构

具有基金销售资格的、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

### （二）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

### （三）出具法律意见书的律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、孙睿

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

### （四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：俞伟敏

经办会计师：单峰 俞伟敏

#### 四、基金的名称

中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）

#### 五、基金的存续

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。

#### 七、基金的投资范围

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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金股票投资占基金资产的比例为60% - 95%，其中投资于成长性行业股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

#### 八、基金的投资策略

##### 1、资产配置策略



本基金将通过分析宏观经济趋势，政府政策行为和资金供需关系三个影响资本市场的主要因素，在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，确定相应大类资产配置比例。

#### （1）宏观面

从股市与宏观经济的内在作用机理来看，宏观经济决定着股市波动，引起股市上涨的原动力是一国经济的发展，当经济向好时，企业业绩上升，投资股票收益高，资金大量涌入股市，股价持续上升；反之，经济衰退，企业不景气，投资缩减，股价下跌。另一方面，股价会充分反映宏观经济变动的各种信息，当实际公布的经济数据和市场预测相背离时，股市会随之做出相应的修正。鉴于以上内在作用机理的存在，本基金资产配置主要建立在对未来宏观经济走势的预期以及预期和实际偏离的修正上。

#### （2）政策面

国家政策对股市有着直接的影响，是影响股市走势的主要因素之一，本基金将主要通过分析政府的财政政策、货币政策和其他政策三个方面来判断政策对股市的影响：

国家财政通过税收总量和结构的变化，调节证券投资和实际投资规模，抑制社会投资总需求膨胀或者补偿有效投资需求的不足。当政府实行积极的财政政策，并且财政政策落到实处时，有利于股市。

政府通过适时灵活运用利率、存款准备金率和公开市场操作等政策工具，调节市场资金供求，宽松的货币政策会扩大社会上货币供给总量，对经济发展和证券市场交易有着积极影响。

其他政策（如印花税调整等）会通过影响投资者的股权风险溢价（ERP），从而显著影响估值水平。

#### （3）资金面

最终决定股市价格水平的因素来源于市场的供需关系，本基金通过分析市场的货币供应量和股票供给量来分析市场的供需关系：当资金充沛，需求大于供给时，股市上升；当供给大于需求时，股市下跌。

## 2、行业配置策略

### （1）本基金的行业配置特点

本基金的主要特点是对于成长性行业的重点配置。在本基金的投资标的中，成长性行业主要包括以下两种类型：一是从行业的生命周期来看，处于快速成长期和成熟成长期的行业，处于这两个阶段的行业增长率快速提高，企业利润水平超出市场平均水平，获得超额收益率的可能性很高；二是短期内处于复苏景气阶段的行业，部分行业虽然从长期来看并未进入成长阶段，但仍存在阶段性景气复苏的可能性，这往往是由于经济周期波动、供求关系变化等因素造成，从较长时间来看，投资于此类行业的收益率水平往往趋于市场平均值，但若能够准确预计行业的阶段性复苏，则有可能抓住行业阶段性成长的机会。

## （2）成长性行业的选择标准

基金管理人将在申银万国一级行业的分类标准基础上，采取定性和定量的指标综合判断行业的成长性。筛选出的成长性行业将每六个月进行更新。

### 定量标准：

判断一个行业是否具有成长性，其核心是未来获得收入与盈利的能力。为了方便反映行业成长性，基金管理人将对行业的平均主营业务收入增长率、主营业务利润增长率及净利润增长率等成长性指标进行测算，并对测算结果分别进行排序。对于该三项指标中至少有一项增长率超越市场平均水平的行业，将进入本基金管理人重点研究的范围。

### 定性标准：

对行业基本面的深入分析也是判断成长性行业的重要途径。从行业自身来看，行业的成长性将受到行业发展阶段、行业景气程度、行业竞争状况、政策扶持程度、所处产业链地位、是否具有垄断性等多个定性指标的影响。基金管理人将在对各行业基本面进行分析的过程中，针对各行业的特殊性重点考察对其成长性影响较大的因素。在对行业的上述六个因素深入分析的基础上，基金管理人将分别就每个因素对该行业的影响做出“有利”或“不利”的判断。

### 综合判断：

在对各行业的定量指标进行排序的基础上，并结合对影响各行业的定性因素做出的“有利”或“不利”的判断，基金管理人将对各行业的成长性进行综合性评分并排序。对于排名处于前 80% 的行业，将作为成长性行业进入本基金重点研究和投资的范围。

### 3、个股选择策略

本基金将重点选择成长性行业内基本面优良且具有成长潜力的股票进行最终的投资组合构建。

本基金将重点分析各成长性行业上市公司的成长性指标（市盈增长比率（PEG）、近三年平均主营业务收入增长率、近三年平均息税折旧前利润（EBITA）增长率、未来一年预测每股收益（EPS）增长率等）、价值指标（市盈率（P/E）、市净率（P/B）、每股收益（EPS）、股息率等）、盈利指标（近三年平均净资产收益率（ROE）、近三年平均投资资本回报率（ROIC）等）等，筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。

### 4、债券选择策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

#### （1）久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

#### （2）期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

#### （3）类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

#### （4）个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

### 5、股指期货投资策略

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。

#### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

#### 7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

### 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2015 年第 2 季度报告，所载数据截至 2015 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	3,047,142,964.47	75.13
	其中：股票	3,047,142,964.47	75.13
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	—	—
	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	954,640,970.91	23.54
8	其他资产	53,843,124.09	1.33
9	合计	4,055,627,059.47	100.00

### 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	—	—

B	采矿业	—	—
C	制造业	1,934,887,650.32	49.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,342,370.00	1.24
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	462,865,878.31	11.88
G	交通运输、仓储和邮政业	6,045,339.67	0.16
H	住宿和餐饮业	801.05	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	588,781,702.12	15.11
J	金融业	3,941,280.00	0.10
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	151.56	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,266,353.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	11,438.44	—
S	综合	—	—
	合计	3,047,142,964.47	78.19

### 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	300171	东富龙	10,949,969	307,584,629.21	7.89
2	002551	尚荣医疗	6,754,311	293,069,554.29	7.52
3	601126	四方股份	8,938,145	272,613,422.50	7.00
4	300274	阳光电源	6,717,141	205,343,000.37	5.27
5	600962	*ST中鲁	10,191,917	204,144,097.51	5.24
6	002727	一心堂	2,382,868	196,872,554.16	5.05
7	002153	石基信息	1,271,622	165,298,143.78	4.24

8	300253	卫宁软件	2,800,370	145,619,240.00	3.74
9	002462	嘉事堂	2,454,091	130,312,232.10	3.34
10	300418	昆仑万维	860,050	124,518,039.00	3.20

#### 4 报告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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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债券。

#### 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

##### 9.1 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。

##### 9.2 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。本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 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。

##### 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。

##### 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。

## 11 投资组合报告附注

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。

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。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,225,862.00
2	应收证券清算款	45,535,264.40
3	应收股利	—
4	应收利息	81,997.69
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	53,843,124.09

### 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。

### 11.5 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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002727	一心堂	196,872,554.16	5.05	停牌
2	300418	昆仑万维	124,518,039.00	3.20	停牌

### 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。



## 十二、基金的业绩

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。

自本基金转型以来，本基金合同生效日 2015 年 1 月 30 日，基金业绩截止日 2015 年 6 月 30 日。

### 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

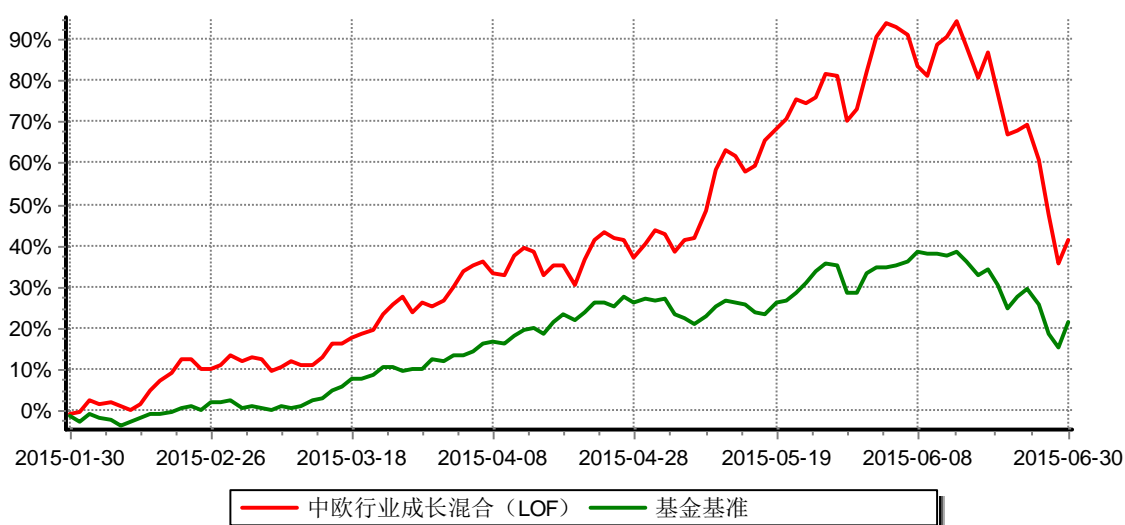
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015. 1. 30-2015. 6. 30	41.05%	2.79%	21.34%	1.67%	19.71%	1.12%

### 2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

中欧行业成长混合型证券投资基金（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

（2015年1月30日-2015年6月30日）



数据来源：中欧基金，wind

注：本基金合同生效日为 2015 年 1 月 30 日，建仓期为 2015 年 1 月 30 日至 2015 年 7 月 30 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。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市年费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2015 年 1 月刊登的《中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

一、“重要提示”部分

增加了“本更新招募说明书所载内容截止日为 2015 年 7 月 29 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。”的描述。

二、“二、释义”部分

更新了《基金法》的释义。

### 三、“三、基金管理人”部分

更新了基金管理人股权结构、董事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理和公司投资决策委员会成员的信息。

### 四、“四、基金托管人”部分

更新了托管人的相关信息。

### 五、“五、相关服务机构”部分

更新了直销机构的网站信息和代销机构的基本信息。

### 六、“九、基金份额的场外申购、转换与赎回”部分

- 1、完善了场外申购与赎回的开放日及办理时间部分的表述；
- 2、完善了场外申购与赎回的限制部分的表述；
- 3、新增了养老金客户的申购费率；
- 4、更新了申购和赎回的数量限制部分的内容。

### 七、“十、基金份额的场内申购与赎回”部分

完善了申购与赎回的办理时间部分的表述。

### 八、“十二、基金的投资”部分

增加了“九、基金投资组合报告”的内容，数据截至2015年6月30日。

### 九、“十三、基金的业绩”部分

增加了整章的信息，包括“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”和“基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至2015年6月30日。

### 十一、“二十四、对基金份额持有人的服务”

更新了基金管理人的网站信息。

### 十二、“二十五、其它应披露事项”部分

更新了自2015年1月30日至2015年7月29日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自2015年1月30日至2015年7月29日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)停牌提示性公告	2015/1/30
2	关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告	2015/2/2
3	中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同	2015/2/2
4	中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同摘要	2015/2/2
5	中欧行业成长混合型证券投资基金托管协议	2015/2/2
6	中欧行业成长混合型证券投资基金招募说明书	2015/2/2
7	中欧基金管理有限公司关于中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）名称变更的公告	2015/2/5
8	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	2015/3/6
9	中欧基金管理有限公司关于新增中国国际金融有限公司为旗下基金代销机构的公告	2015/3/19
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的申购费率优惠活动的公告	2015/3/20
11	关于调整旗下部分基金持有广联达股票估值方法的公告	2015/3/25
12	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（正文）	2015/3/27
13	中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（摘要）	2015/3/27
14	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	2015/3/28
15	关于旗下部分基金参与工商银行开展的申购费率优惠活动的公告	2015/4/1
16	中欧行业成长混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	2015/4/1
17	关于调整旗下部分基金持有“阳光电源”股票估值方法的公告	2015/4/2
18	中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）场内交易价格波动的提示公告	2015/4/8
19	关于调整旗下部分基金持有“英特集团”股票估值方法的公告	2015/4/14

20	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2015年第1季度报告	2015/4/22
21	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“华平股份”股票估值方法的公告	2015/5/9
22	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“奥维通信”股票估值方法的公告	2015/5/9
23	中欧基金管理有限公司关于调整旗下基金持有“昆仑万维”股票估值方法的公告	2015/5/12
24	中欧基金管理有限公司关于调整旗下基金持有“一心堂”股票估值方法的公告	2015/5/12
25	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“三全食品”股票估值方法的公告	2015/5/26
26	中欧基金管理有限公司关于官方网上直销平台支付宝客户费率优惠活动的公告	2015/5/26
27	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销单笔最低申购金额的公告	2015/5/26
28	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“探路者”股票估值方法的公告	2015/5/27
29	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告	2015/6/10
30	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购金额的公告	2015/6/10
31	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“瑞康医药”股票估值方法的公告	2015/6/11
32	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宋城演艺”股票估值方法的公告	2015/6/27
33	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	2015/6/30
34	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2015年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2015/7/1

35	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“国投电力”股票估值方法的公告	2015/7/4
36	中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	2015/7/8
37	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“康尼机电”股票估值方法的公告	2015/7/8
38	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“金证股份”股票估值方法的公告	2015/7/8
39	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的公告	2015/7/9
40	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的公告	2015/7/11
41	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的公告	2015/7/14
42	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券有限责任公司费率优惠活动的公告	2015/7/17
43	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2015年第2季度报告	2015/7/20
44	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“华贸物流”股票估值方法的公告	2015/7/24
45	中欧基金管理有限公司关于网上直销系统开通通联支付渠道并实施费率优惠的公告	2015/7/28
46	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“广联达”股票估值方法的公告	2015/7/29

中欧基金管理有限公司

2015年9月12日