

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2017年半年度报告

2017年06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

送出日期：2017年08月29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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月28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2017年1月1日起至2017年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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 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贵金属投资明细	48
7.9 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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52

10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	57
§12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)		
基金简称	中欧行业成长混合(LOF)		
基金主代码	166006		
交易代码	166006		
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)		
基金合同生效日	2015年01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		
报告期末基金份额总额	2,263,855,310.62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	2010-03-26		
下属分级基金的基金简称	中欧行业成长混合(LOF) A	中欧行业成长混合(LOF) E	中欧行业成长混合(LOF) C
下属分级基金的交易代码	166006	001886	004231
下属分级基金的场内简称	中欧成长	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	2,259,534,885.85份	3,811,233.54份	509,191.23份

注：自2017年1月12日起,本基金增加C类份额，登记机构为中欧基金管理有限公司，原有A、E类基金份额保持不变。

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%

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。
--------	--

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	田东辉
	联系电话	021-68609600	010-68858113
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		021-68609700、 400-700-9700	95580
传真		021-33830351	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区金融大街3号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区金融大街3号A楼
邮政编码		200120	100808
法定代表人		窦玉明	李国华

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.zofund.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	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司； C、E类份额：中欧基金管理有限公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号 C、E类份额：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层
--------	---	--

§ 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

单位：人民币元

	中欧行业成长混合(LOF) A	中欧行业成长混合(LOF) E	中欧行业成长混合(LOF) C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年01月01日-2017年06月30日)	报告期(2017年01月01日-2017年06月30日)	报告期(2017年01月12日-2017年06月30日)
本期已实现收益	56,088,354.00	176,290.21	13,414.31
本期利润	360,083,247.55	689,724.32	67,114.90
加权平均基金份额本期利润	0.2040	0.2267	0.2803
本期基金加权平均净值利润率	19.29%	20.82%	25.93%
本期基金份额净值增长率	20.32%	20.38%	21.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)		
期末可供分配利润	95,620,266.05	193,375.50	20,609.34
期末可供分配基金份额利润	0.0423	0.0507	0.0405
期末基金资产净值	2,678,855,923.81	4,554,473.34	602,655.45
期末基金份额净值	1.1856	1.1950	1.1836
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	45.20%	24.80%	21.02%

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。

4、本基金于2017年1月12日增加C类份额,增加份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算,下同。

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 (中欧行业成长混合 (LOF) A)	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	9.57%	0.83%	3.95%	0.51%	5.62%	0.32%
过去三个月	11.36%	0.84%	4.33%	0.47%	7.03%	0.37%
过去六个月	20.32%	0.76%	7.44%	0.43%	12.88%	0.33%
过去一年	18.95%	0.78%	11.08%	0.51%	7.87%	0.27%
自基金合同生效日至今	45.20%	2.13%	5.73%	1.35%	39.47%	0.78%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%,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。

阶段 (中欧行业成长混合 (LOF) E)	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	9.65%	0.83%	3.95%	0.51%	5.70%	0.32%
过去三个月	11.42%	0.84%	4.33%	0.47%	7.09%	0.37%
过去六个月	20.38%	0.76%	7.44%	0.43%	12.94%	0.33%
过去一年	19.79%	0.78%	11.08%	0.51%	8.71%	0.27%
自基金份额起始运作日至今	24.80%	1.46%	7.35%	0.95%	17.45%	0.51%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%,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。

阶段 (中欧行业成长混合 (LOF) C)	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	9.51%	0.83%	3.95%	0.51%	5.56%	0.32%
过去三个月	11.38%	0.83%	4.33%	0.47%	7.05%	0.36%
自基金份额起始运作 日至今	21.02%	0.76%	7.27%	0.43%	13.75%	0.33%

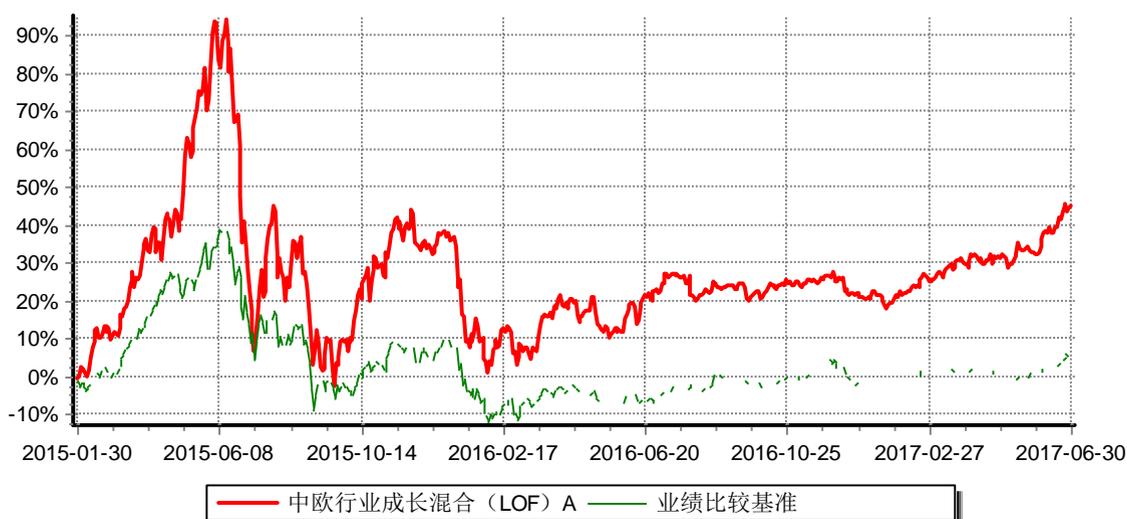
注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧行业成长混合（LOF）A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年01月30日-2017年06月30日）



中欧行业成长混合（LOF）E

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年10月12日-2017年06月30日）



注：本基金自2015年10月8日起新增E类份额，图示日期为2015年10月12日至2017年6月30日。

中欧行业成长混合 (LOF) C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年01月13日-2017年06月30日)



注：本基金自2017年1月12日起新增C类份额，图示日期为2017年1月13日至2017年6月30日。

§ 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、国都证券股份有限公司、北京

百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2017年6月30日，本基金管理人共管理57只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
李欣	基金经理	2016年01月08日	—	7年	历任国海富兰克林基金管理有限公司研究员，银河基金管理有限公司研究员。2015年12月21日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理。

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、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 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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、

股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，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 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

2017年上半年，上证指数上涨2.86%、深成指数上涨3.46%、创业板指下跌7.34%、沪深300指数上涨10.78%。整个市场在上半年显出极大的分化，题材和概念为主的公司各个板块中持续下跌，而业绩增长良性且估值合理的公司受到青睐。从宏观经济角度出发，本基金认为，在整体流动性局限的背景下，整体系统性行情很难出现。不过，随着市场趋于理性，低估值板块和消费品板块率先找到估值中枢，并持续吸引资金净流入。随着国际政局和中国经济的企稳，市场依旧具备很多结构性投资亮点，包括但不限于全球大宗商品的供需稳定再加上中国供给侧改革带来的上游盈利的改善，中国优质制造类企业集中度提升和国际化步伐的加快，以及中国政府大力推进的电子半导体，新能源汽车以及环保等新兴产业的发展等。

因此，本基金在整个2017年上半年操作积极，大部分时间保持高仓位，在低估值类蓝筹的基本配置下，辅以成长性突出且估值相对合理的电子、新能源汽车、环保和家电家居等板块配置，获得较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值增长率为20.32%，同期业绩比较基准收益率为7.44%；E类份额净值增长率为20.38%，同期业绩比较基准收益率为7.44%；C类份额净值增长率为21.02%，同期业绩比较基准收益率为7.27%。

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，本基金对于中国和全球宏观经济的判断并不悲观。PPP为主的基建以及棚改货币化带来的房地产去库存，这两点对中国经济的稳定带来了非常积极影响，再加上三四线房地产销售持续超预期，以及进出口形势显著好转，使得上半年中国GDP增速超越市场预期。以美国为代表的西方经济依旧良性，而欧洲债务危机告一段落后迎来了全面复苏的状态，因此，本基金认为经济整体将保持平稳增长，向下风险基本释放。

证券市场方面，整体投资风险偏好依然不高，机会多出现在绩优股层面，随着上游

和中游行业报表持续好转，预计其吸引力仍在；消费品行业依然受益于消费升级和龙头效应，这种受益在未来很长时间很难扭转，因此A股市场依然具备很强的吸引力，尤其是以沪深300为主体的中大市值板块。高估值成长股在经历了大幅下跌后，也出现了一些可投资的标的，不过目前占比较小。风险方面，由于上半年消费龙头的上涨幅度过大，基本透支了部分未来估值切换的幅度，有可能会出现回调风险。

依据对于经济整体的判断，本基金认为今年下半年将持续结构性行情。一方面，在资金面偏紧且风险偏好下降的背景下，价值股和部分业绩成长确定的行业依然是主要投资方向，金融、家电、电子、新能源汽车、通信具备投资价值。另一方面，着眼于全球经济复苏和中国经济的平稳，本基金会逐步将视角放在中游制造、上游资源品以及航运板块。

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，防止估值被歪曲进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进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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，投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	580,605,513.74	403,228,302.72
结算备付金		4,331,857.54	12,286,963.63
存出保证金		2,362,628.07	3,599,426.11
交易性金融资产	6.4.7.2	2,120,996,105.60	1,378,356,741.22
其中：股票投资		2,120,996,105.60	1,378,356,741.22

基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,089,350.13	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	87,300.35	97,936.68
应收股利		—	—
应收申购款		20,430,362.44	31,493.67
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		3,028,903,117.87	1,797,600,864.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
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		327,679,107.05	11,138,753.98
应付赎回款		10,982,397.40	2,055.70
应付管理人报酬		2,531,361.90	2,408,463.39
应付托管费		421,893.65	401,410.56
应付销售服务费		343.69	—
应付交易费用	6.4.7.7	2,441,916.04	5,687,898.21
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	833,045.54	907,445.60

负债合计		344,890,065.27	20,546,027.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,263,855,310.62	1,803,330,879.90
未分配利润	6.4.7.10	420,157,741.98	-26,276,043.31
所有者权益合计		2,684,013,052.60	1,777,054,836.59
负债和所有者权益总计		3,028,903,117.87	1,797,600,864.03

注：报告截止日2017年6月30日，A类基金份额净值1.1856元，基金份额2,259,534,885.85份；C类基金份额净值1.1836元，基金份额509,191.23份；E类基金份额净值1.1950元，基金份额3,811,233.54份。

6.2 利润表

会计主体：中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		386,835,987.71	-184,209,899.85
1.利息收入		1,323,623.59	1,728,221.91
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	900,759.40	1,728,221.91
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		422,864.19	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		80,365,126.02	-297,667,079.49
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	57,450,227.33	-302,125,395.97
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	—	—
资产支持证券投资收		—	—

益			
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7 .14	—	—
股利收益	6.4.7 .15	22,914,898.69	4,458,316.48
3.公允价值变动收益	6.4.7 .16	304,562,028.25	110,475,584.57
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	585,209.85	1,253,373.16
减：二、费用		25,995,900.94	36,409,124.69
1. 管理人报酬		13,900,605.06	14,146,201.96
2. 托管费		2,316,767.56	2,357,700.35
3. 销售服务费		1,007.43	—
4. 交易费用	6.4.7 .18	9,583,023.64	19,667,482.96
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	194,497.25	237,739.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		360,840,086.77	-220,619,024.54
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		360,840,086.77	-220,619,024.54

注：本基金于2017年1月12日增加C类份额，增加份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算，下同

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06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)	1,803,330,879.90	-26,276,043.31	1,777,054,836.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	360,840,086.77	360,840,086.77
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)	460,524,430.72	85,593,698.52	546,118,129.24
其中：1.基金申购款	1,327,673,068.49	128,189,961.47	1,455,863,029.96
2.基金赎回款	-867,148,637.77	-42,596,262.95	-909,744,900.72
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)	2,263,855,310.62	420,157,741.98	2,684,013,052.60
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06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)	1,985,034,943.66	438,780,870.48	2,423,815,814.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-220,619,024.54	-220,619,024.54
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)	-167,735,345.82	-20,622,759.45	-188,358,105.27
其中：1.基金申购款	1,179,743,360.18	8,299,461.34	1,188,042,821.52
2.基金赎回款	-1,347,478,706.00	-28,922,220.79	-1,376,400,926.79

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)	1,817,299,597.84	197,539,086.49	2,014,838,684.33

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:

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")是由中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金转型而来。2015年1月30日中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,同意将中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型为中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)。根据《中欧基金管理有限公司关于中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告》,自2015年1月30日起,中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)于2015年1月30日正式转型并更名为中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)。自同日起,《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》失效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称"中国邮政储蓄银行")。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2010]第95号文审核同意,原中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)39,505,449份基金份额于2010年3月26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《中欧行业成长混合型证券投资基金(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(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。

本基金的投资组合比例为: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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 75%+中债综合指数收益率 \times 25%。

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2017年8月29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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧行业成长混合型证券投资基金(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、中国基金业协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2017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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日半年度的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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	580,605,513.74
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	580,605,513.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	1,824,717,412.20	2,120,996,105.60	296,278,693.40
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
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	1,824,717,412.20	2,120,996,105.60	296,278,693.40

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

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,000,000.00	—
银行间市场	100,089,350.13	—
合计	300,089,350.13	—

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:2017年06月30日
应收活期存款利息	36,680.10
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	1,754.37
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	36,809.13
应收申购款利息	11,099.87
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	956.88
合计	87,300.35

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 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,441,207.18
银行间市场应付交易费用	708.86
合计	2,441,916.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	40,106.03
预提信息披露费	206,155.90
预提审计费	49,588.57

预提上市费	29,752.78
其他应付	7,442.26
合计	833,045.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧行业成长混合(LOF) A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,802,430,805.27	1,802,430,805.27
本期申购	1,321,229,104.11	1,321,229,104.11
本期赎回	-864,125,023.53	-864,125,023.53
期末数	2,259,534,885.85	2,259,534,885.85
项目 (中欧行业成长混合(LOF) E)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	900,074.63	900,074.63
本期申购	5,888,741.30	5,888,741.30
本期赎回	-2,977,582.39	-2,977,582.39
期末数	3,811,233.54	3,811,233.54
项目 (中欧行业成长混合(LOF) C)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	555,223.08	555,223.08
本期赎回	-46,031.85	-46,031.85
期末数	509,191.23	509,191.23

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2.截至2017年06月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为7,353,218.00份，均为中欧行业成长A类基金份额(2016年06月30日：9,280,442.00份，均为中欧行业成长A类基金份额)，托管在场外未上市交易的基金份额为2,256,502,092.62份，其中中欧行业成长A类基金份额2,252,181,667.85份，中欧行业成长C类基金份额509,191.23份，中欧行业成长E类基金份额3,811,233.54份(2016年06月30日：

1,808,019,155.84份，其中中欧行业成长A类基金份额1,798,669,628.77份，中欧行业成长E类基金份额

9,349,527.07)。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本基金A类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 (中欧行业成长混合 (LOF) A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,030,380.66	-47,299,856.97	-26,269,476.31
本期利润	56,088,354.00	303,994,893.55	360,083,247.55
本期基金份额交易产生的变动数	18,501,531.39	67,005,735.33	85,507,266.72
其中：基金申购款	25,249,342.71	102,462,271.24	127,711,613.95
基金赎回款	-6,747,811.32	-35,456,535.91	-42,204,347.23
本期已分配利润	—	—	—
本期末	95,620,266.05	323,700,771.91	419,321,037.96

单位：人民币元

项目 (中欧行业成长混合 (LOF) E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,282.64	-23,849.64	-6,567.00
本期利润	176,290.21	513,434.11	689,724.32
本期基金份额交易产生的变动数	-197.35	60,279.83	60,082.48
其中：基金申购款	107,404.71	341,339.45	448,744.16
基金赎回款	-107,602.06	-281,059.62	-388,661.68
本期已分配利润	—	—	—
本期末	193,375.50	549,864.30	743,239.80

单位：人民币元

项目 (中欧行业成长混合(LOF) C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	13,414.31	53,700.59	67,114.90
本期基金份额交易产生的变动数	7,195.03	19,154.29	26,349.32
其中：基金申购款	7,798.10	21,805.26	29,603.36
基金赎回款	-603.07	-2,650.97	-3,254.04
本期已分配利润	—	—	—
本期末	20,609.34	72,854.88	93,464.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	785,242.10
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	58,613.14
其他	56,904.16
合计	900,759.40

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	57,450,227.33
股票投资收益——赎回差价	—

收入	
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	57,450,227.33

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出股票成交总额	3,024,558,748.73
减：卖出股票成本总额	2,967,108,521.40
买卖股票差价收入	57,450,227.33

6.4.7.13 债券投资收益

无余额。

6.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	22,914,898.69
基金投资产生的股利收益	—
合计	22,914,898.69

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
1.交易性金融资产	304,562,028.25
——股票投资	304,562,028.25

——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	304,562,028.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	513,343.11
基金转换费收入	71,866.74
合计	585,209.85

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	9,583,023.64
银行间市场交易费用	—
合计	9,583,023.64

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	49,588.57

信息披露费	106,155.90
上市费	29,752.78
帐户维护费	9,000.00
合计	194,497.25

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，本基金并无须作披露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

无。

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 ("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司 ("邮储银行")	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司 ("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06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	54,791,885.88	0.85%	798,671,826.97	6.14%
------	---------------	-------	----------------	-------

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06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	占应付佣金余额的比例
国都证券	51,027.77	0.85%		—
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06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	占应付佣金余额的比例
国都证券	743,805.60	6.14%	330,885.69	6.08%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

6.4.10.1.4 债券交易

无。

6.4.10.1.5 债券回购交易

无。

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 2017年01月01日-2017	上年度可比期间 2016年01月01日-2016

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,900,605.06	14,146,201.96
其中：支付销售机构的客户维护费	637,403.73	746,633.90

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日-2017年06月30日	2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,316,767.56	2,357,700.35

注：支付基金托管人 中国邮政储蓄银行 的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2017年01月01日-2017年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧行业成长混合(LOF) A	中欧行业成长混合(LOF) E	中欧行业成长混合(LOF) C	合计
中欧基金	—	—	600.68	600.68
国都证券	—	—	1.80	1.80
中国邮政储蓄银行	—	—	—	—
合计	—	—	602.48	602.48

注：本基金 A 类、E 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，销售服务费按照前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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 2017年01月01日-2017年06月30日		
	中欧行业成长混合 (LOF) A	中欧行业成长混合 (LOF) E	中欧行业成长混合 (LOF) C
报告期初持有的基金份额	—	143,112.02	—
报告期间申购/买入总份额	—	—	153,374.23
报告期间因拆分变动份额	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—
期末持有的基金份额	—	143,112.02	153,374.23
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	3.76%	30.12%

份额单位：份

项目	上年度可比期间
----	---------

	2016年01月01日-2016年06月30日		
	中欧行业成长混合 (LOF) A	中欧行业成长混合 (LOF) E	中欧行业成长混合 (LOF) C
报告期初持有的基金份额	—	128,619.02	—
报告期间申购/买入总份额	—	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—	—
报告期末持有的基金份额	—	128,619.02	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	1.38%	—

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2、本基金管理人于2017年1月13日通过中欧基金管理有限公司直销中心申购本基金C类份额150,000元，申购费用0元，符合本基金招募说明书的相关规定。

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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期内未持有本基金。

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 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行活期存款	580,605,513.74	785,242.10	369,120,978.83	1,566,819.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，半年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)。

6.4.12 期末（2017年06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股票等流通受限股票

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金通过主要投资于未来持续成长能力强的潜力公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，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、风险管理部、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。

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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、组合在短时间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证券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公司的证券不得超过该证券的10%。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，本基金所持大部分资产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。

于2017年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的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，因此账面余额约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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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、结算备付金、存出保证金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年06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	580,605,513.74	—	—	—	580,605,513.74
结算备付金	4,331,857.54	—	—	—	4,331,857.54

存出保证金	2,362,628.07	—	—	—	2,362,628.07
交易性金融资产	—	—	—	2,120,996,105.60	2,120,996,105.60
买入返售金融资产	300,089,350.13	—	—	—	300,089,350.13
应收利息	—	—	—	87,300.35	87,300.35
应收申购款	19,999,000.00	—	—	431,362.44	20,430,362.44
资产总计	907,388,349.48	—	—	2,121,514,768.39	3,028,903,117.87
负债					
应付证券清算款	—	—	—	327,679,107.05	327,679,107.05
应付赎回款	—	—	—	10,982,397.40	10,982,397.40
应付管理人报酬	—	—	—	2,531,361.90	2,531,361.90
应付托管费	—	—	—	421,893.65	421,893.65
应付销售服务费	—	—	—	343.69	343.69
应付交易费用	—	—	—	2,441,916.04	2,441,916.04
其他负债	—	—	—	833,045.54	833,045.54
负债总计	—	—	—	344,890,065.27	344,890,065.27
利率敏感度缺口	907,388,349.48	—	—	1,776,624,703.12	2,684,013,052.60
上年度末 2016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	403,228,302.72	—	—	—	403,228,302.72

结算备付金	12,286,963.63	—	—	—	12,286,963.63
存出保证金	3,599,426.11	—	—	—	3,599,426.11
交易性金融资产	—	—	—	1,378,356,741.22	1,378,356,741.22
应收利息	—	—	—	97,936.68	97,936.68
应收申购款	—	—	—	31,493.67	31,493.67
资产总计	419,114,692.46	—	—	1,378,486,171.57	1,797,600,864.03
负债					
应付证券清算款	—	—	—	11,138,753.98	11,138,753.98
应付赎回款	—	—	—	2,055.70	2,055.70
应付管理人报酬	—	—	—	2,408,463.39	2,408,463.39
应付托管费	—	—	—	401,410.56	401,410.56
应付交易费用	—	—	—	5,687,898.21	5,687,898.21
其他负债	—	—	—	907,445.60	907,445.60
负债总计	—	—	—	20,546,027.44	20,546,027.44
利率敏感度缺口	419,114,692.46	—	—	1,357,940,144.13	1,777,054,836.59

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金未持有交易性债券资产（2016年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016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	2,120,996,105.60	79.02	1,378,356,741.22	77.56
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,120,996,105.60	79.02	1,378,356,741.22	77.56

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：人民币万元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	业绩比较基准上升5%	29,000.28	11,351.47
	业绩比较基准下降5%	-29,000.28	-11,351.47

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为2,120,996,105.60元，无属于第二层次和第三层次的余额。（2016年12月31日：属于第一层次的余额为1,265,691,785.22元，属于第二层次的余额为112,664,956.00元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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，若出现重大事项停牌、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2016年12月31日：同）。

(d) 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。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	2,120,996,105.60	70.03
	其中：股票	2,120,996,105.60	70.03
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	300,089,350.13	9.91
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	584,937,371.28	19.31
7	其他资产	22,880,290.86	0.76

8	合计	3,028,903,117.87	100.00
---	----	------------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	22,549,188.20	0.84
C	制造业	1,484,842,074.93	55.32
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	117,220,753.00	4.37
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,933,117.72	0.93
J	金融业	420,294,321.13	15.66
K	房地产业	51,155,380.62	1.91
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,270.00	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,120,996,105.60	79.02

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	000333	美的集团	3,399,904	146,331,868.16	5.45
2	601318	中国平安	2,849,979	141,387,458.19	5.27
3	000651	格力电器	2,959,812	121,855,460.04	4.54
4	600036	招商银行	4,949,909	118,352,324.19	4.41
5	601939	建设银行	19,199,925	118,079,538.75	4.40
6	002050	三花智控	5,194,271	84,770,502.72	3.16
7	600104	上汽集团	2,699,909	83,832,174.45	3.12
8	002008	大族激光	2,400,000	83,136,000.00	3.10
9	603799	华友钴业	1,100,607	66,894,893.46	2.49
10	002450	康得新	2,560,500	57,662,460.00	2.15
11	600867	通化东宝	3,099,789	56,540,151.36	2.11
12	002007	华兰生物	1,499,765	54,741,422.50	2.04
13	002572	索菲亚	1,320,000	54,120,000.00	2.02
14	600885	宏发股份	1,339,170	53,419,491.30	1.99
15	002640	跨境通	2,502,632	53,180,930.00	1.98
16	000786	北新建材	3,300,000	52,272,000.00	1.95
17	002466	天齐锂业	839,915	45,649,380.25	1.70
18	002415	海康威视	1,400,000	45,220,000.00	1.68
19	002035	华帝股份	1,760,000	42,592,000.00	1.59
20	601933	永辉超市	5,999,975	42,479,823.00	1.58
21	600519	贵州茅台	87,000	41,050,950.00	1.53
22	000820	神雾节能	1,049,978	39,878,164.44	1.49
23	300156	神雾环保	1,199,965	39,310,853.40	1.46
24	600110	诺德股份	2,599,903	36,632,633.27	1.36
25	002434	万里扬	2,299,912	36,614,599.04	1.36
26	000063	中兴通讯	1,400,000	33,236,000.00	1.24
27	601688	华泰证券	1,800,000	32,220,000.00	1.20
28	300323	华灿光电	2,009,855	27,896,787.40	1.04
29	000858	五粮液	500,000	27,830,000.00	1.04

30	600048	保利地产	2,600,000	25,922,000.00	0.97
31	600383	金地集团	2,199,946	25,233,380.62	0.94
32	300275	梅安森	1,299,954	24,933,117.72	0.93
33	603868	飞科电器	399,985	24,735,072.40	0.92
34	600276	恒瑞医药	473,711	23,965,039.49	0.89
35	000426	兴业矿业	2,499,910	22,549,188.20	0.84
36	300203	聚光科技	800,000	22,496,000.00	0.84
37	002475	立讯精密	750,000	21,930,000.00	0.82
38	600998	九州通	1,000,000	21,560,000.00	0.80
39	000049	德赛电池	403,200	20,889,792.00	0.78
40	603160	汇顶科技	200,000	20,060,000.00	0.75
41	603228	景旺电子	388,169	18,729,154.25	0.70
42	601211	国泰君安	500,000	10,255,000.00	0.38
43	002384	东山精密	10,000	247,000.00	0.01
44	000878	云南铜业	10,000	131,900.00	—
45	300316	晶盛机电	10,000	124,900.00	—
46	002456	欧菲光	2,500	45,425.00	—
47	000888	峨眉山 A	100	1,270.00	—

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	197,320,830.09	11.10
2	601939	建设银行	115,430,728.50	6.50
3	000651	格力电器	96,024,544.05	5.40
4	600036	招商银行	92,877,147.69	5.23
5	002008	大族激光	82,456,607.23	4.64
6	601166	兴业银行	80,500,203.97	4.53
7	601933	永辉超市	73,617,168.90	4.14

8	600110	诺德股份	68,814,806.74	3.87
9	000786	北新建材	64,214,779.74	3.61
10	000820	神雾节能	64,195,894.58	3.61
11	002450	康得新	61,017,852.03	3.43
12	601688	华泰证券	60,205,880.71	3.39
13	300156	神雾环保	58,956,667.06	3.32
14	300203	聚光科技	58,357,142.95	3.28
15	600867	通化东宝	55,471,312.73	3.12
16	002572	索菲亚	54,723,796.23	3.08
17	600019	宝钢股份	53,448,027.00	3.01
18	002007	华兰生物	53,283,242.47	3.00
19	002475	立讯精密	51,400,295.04	2.89
20	603799	华友钴业	51,008,185.73	2.87
21	600779	水井坊	48,715,490.49	2.74
22	002050	三花智控	48,714,616.93	2.74
23	000063	中兴通讯	48,501,984.58	2.73
24	002640	跨境通	45,984,092.53	2.59
25	002466	天齐锂业	41,681,061.09	2.35
26	002241	歌尔股份	41,464,522.18	2.33
27	601009	南京银行	39,856,099.17	2.24
28	600801	华新水泥	39,645,463.55	2.23
29	000728	国元证券	39,551,322.39	2.23
30	002142	宁波银行	39,214,592.86	2.21
31	002415	海康威视	38,608,790.55	2.17
32	601211	国泰君安	38,591,910.00	2.17
33	600885	宏发股份	38,418,419.88	2.16
34	601988	中国银行	38,350,024.64	2.16
35	600436	片仔癀	38,238,831.50	2.15
36	601699	潞安环能	38,131,051.94	2.15
37	000937	冀中能源	37,701,933.47	2.12

38	300275	梅安森	37,286,808.90	2.10
39	601818	光大银行	37,283,143.00	2.10
40	002035	华帝股份	36,887,317.54	2.08
41	600104	上汽集团	36,649,109.10	2.06
42	002434	万里扬	36,449,821.27	2.05
43	600028	中国石化	36,344,621.00	2.05

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	601166	兴业银行	80,983,986.90	4.56
2	002564	天沃科技	78,947,884.81	4.44
3	600452	涪陵电力	75,483,264.79	4.25
4	601318	中国平安	72,173,790.37	4.06
5	300203	聚光科技	68,293,461.16	3.84
6	000063	中兴通讯	62,544,629.06	3.52
7	000858	五粮液	61,477,574.64	3.46
8	600019	宝钢股份	59,146,526.02	3.33
9	002262	恩华药业	55,042,726.75	3.10
10	002127	南极电商	55,001,083.55	3.10
11	600502	安徽水利	53,213,870.00	2.99
12	601668	中国建筑	50,521,341.00	2.84
13	002159	三特索道	49,916,410.67	2.81
14	000878	云南铜业	49,878,243.39	2.81
15	601233	桐昆股份	47,237,449.47	2.66
16	600362	江西铜业	46,290,030.56	2.60
17	600779	水井坊	45,938,640.02	2.59
18	002241	歌尔股份	44,896,451.01	2.53
19	002475	立讯精密	43,284,112.52	2.44
20	600596	新安股份	42,957,255.89	2.42

21	600104	上汽集团	40,555,137.08	2.28
22	002138	顺络电子	40,426,816.15	2.27
23	000728	国元证券	40,011,921.46	2.25
24	000937	冀中能源	39,905,706.82	2.25
25	300145	中金环境	39,070,367.92	2.20
26	601933	永辉超市	38,640,107.12	2.17
27	600436	片仔癀	38,499,430.27	2.17
28	300450	先导智能	38,359,866.28	2.16
29	600801	华新水泥	38,210,962.40	2.15
30	000739	普洛药业	37,978,869.76	2.14
31	601988	中国银行	37,905,000.00	2.13
32	600110	诺德股份	37,658,445.74	2.12
33	002507	涪陵榨菜	37,609,524.16	2.12
34	600068	葛洲坝	37,549,597.92	2.11
35	002142	宁波银行	36,963,636.47	2.08
36	601009	南京银行	36,933,088.98	2.08
37	601818	光大银行	36,580,839.00	2.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,405,185,857.53
卖出股票收入（成交）总额	3,024,558,748.73

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序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序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 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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，故此项不适用。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,362,628.07

2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	87,300.35
5	应收申购款	20,430,362.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	22,880,290.86

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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

份额 级别	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
中欧行业成长混合 (LOF) A	12,162	185,786.46	2,067,563,039.36	91.50%	191,971,846.49	8.50%

中欧行业成长混合(LOF) E	99	38,497.31	143,112.02	3.76%	3,668,121.52	96.24%
中欧行业成长混合(LOF) C	45	11,315.36	153,374.23	30.12%	355,817.00	69.88%
合计	12,306	183,963.54	2,067,859,525.61	91.34%	195,995,785.01	8.66%

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	孙晓东	847859	11.53%
2	华燕	494746	6.73%
3	程佳	470800	6.40%
4	陈燕	399900	5.44%
5	王惠川	392200	5.33%
6	司家民	300015	4.08%
7	宋远松	290000	3.94%
8	张庆明	197100	2.68%
9	周富裕	184700	2.51%
10	路凤芝	119500	1.63%

注：以上均为中欧行业成长混合(LOF) A的场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧行业成长混合(LOF) A	23,149.67	0.00%
	中欧行业成长混合(LOF) E	129,202.41	3.39%

	中欧行业成长混合(LOF) C	211.19	0.04%
	合计	152,563.27	0.01%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金A类基金份额的比例为0.0010%，上表展示系四舍五入的结果。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧行业成长混合(LOF) A	0
	中欧行业成长混合(LOF) E	0
	中欧行业成长混合(LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧行业成长混合(LOF) A	0
	中欧行业成长混合(LOF) E	0
	中欧行业成长混合(LOF) C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧行业成长混合(LOF) A	中欧行业成长混合(LOF) E	中欧行业成长混合(LOF) C
基金合同生效日(2015年01月30日)基金份额总额	3,014,644,105.55	—	—
本报告期期初基金份额总额	1,802,430,805.27	900,074.63	—
本报告期基金总申购份额	1,321,229,104.11	5,888,741.30	555,223.08
减：本报告期基金总赎回份额	864,125,023.53	2,977,582.39	46,031.85
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,259,534,885.85	3,811,233.54	509,191.23

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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2017年3月30日发布公告，顾伟先生自2017年3月30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基金业协会办理相关手续并向上海证监局报告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金	占当期股票	佣金	占当期佣金	
	元					

	数量	额	成交总额比例		总量的比例	
长江证券	1	1,737,384,510.83	27.02%	1,618,029.42	27.02%	
长城证券	1	1,289,419,478.83	20.05%	1,200,830.06	20.05%	
国泰君安	1	760,147,285.3	11.82%	707,926.6	11.82%	
民生证券	1	680,393,490.29	10.58%	633,651.61	10.58%	
中金公司	1	572,738,248.4	8.91%	533,393.56	8.91%	
招商证券	1	372,569,797.12	5.79%	346,968.82	5.79%	
中信证券	2	321,529,789.85	5%	299,435.3	5%	
华泰证券	1	249,119,553.51	3.87%	231,999.4	3.87%	
国金证券	1	187,595,020.73	2.92%	174,708	2.92%	
东方证券	1	123,789,688.98	1.93%	115,283.86	1.93%	
方正证券	1	80,265,856.54	1.25%	74,752.56	1.25%	
国都证券	1	54,791,885.88	0.85%	51,027.77	0.85%	
安信证券	1	—	—	—	—	
申万宏源西部证券	1	—	—	—	—	
申银万国	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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
长江证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	405,000,000	44.26%	—	—
国泰君安	—	—	85,000,000	9.29%	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	225,000,000	24.59%	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	200,000,000	21.86%	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—

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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2016年12月31日基金资产净	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-01

	值、基金份额净值和基金份额累计净值公告		
2	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为旗下部分基金代销机构并同步开通转换和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-12
3	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加C类份额、提高净值精度并相应修改基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-12
4	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同(修订)	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-12
5	中欧基金管理有限公司关于新增京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-17
6	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2016年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-20
7	中欧基金管理有限公司关于新增京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-25
8	中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-11
9	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宝钢股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-15
10	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过同花顺代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-16
11	中欧基金管理有限公司北京分公	中国证监会指定报刊及网	2017-02-22

	司办公地址变更公告	站	
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-23
13	中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-02
14	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2017年第1号)	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-15
15	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(2017年第1号)	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-15
16	中欧基金管理有限公司关于新增金牛理财为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-24
17	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国信证券代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-28
18	中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
19	中欧基金管理有限公司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	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
20	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2016年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
21	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2016年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
22	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业证券开通转换和定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-14

23	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)2017年1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-21
24	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-22
25	中欧基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-24
26	中欧基金管理有限公司关于新增方正证券为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-12
27	中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换与定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-16
28	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年6月30日	656,659,597.34	204,724,899.77	266,387,654.35	594,996,842.76	26.28%
机构	2	2017年1月1日至2017年3月7日	366,739,520.69	281,529,654.66	326,739,520.69	321,529,654.66	14.20%
产品特有风险							

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF) 基金合同》
- 3、《中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF) 托管协议》
- 4、《中欧行业成长混合型证券投资基金(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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.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
二〇一七年八月二十九日