

# 中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 07 月 07 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中欧电子信息产业沪港深股票
基金主代码	004616
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年07月07日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	70,221,660.39份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于电子信息产业相关行业股票，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。本基金为股票型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，进行短期的战术避险选择。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率×65%+恒生指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金和混合型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	田青
	联系电话	021-68609600	010-67595096
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	010-67595096
传真		021-33830351	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	本期2017年07月07日（基金合同生效日）- 2017年12月31日
本期已实现收益	5,672,268.16
本期利润	5,770,679.87
加权平均基金份额本期利润	0.0534
本期基金份额净值增长率	8.96%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2017年末
期末可供分配基金份额利润	0.0786
期末基金资产净值	76,512,532.87
期末基金份额净值	1.0896

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、所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、本基金合同于2017年7月7日生效，故无上年可比区间，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	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
过去三个月	4.61%	1.19%	-2.96%	0.90%	7.57%	0.29%
自基金合同生效起至今	8.96%	0.90%	1.30%	0.85%	7.66%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中证TMT产业主题指数收益率×65%+恒生指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率\*15%。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。

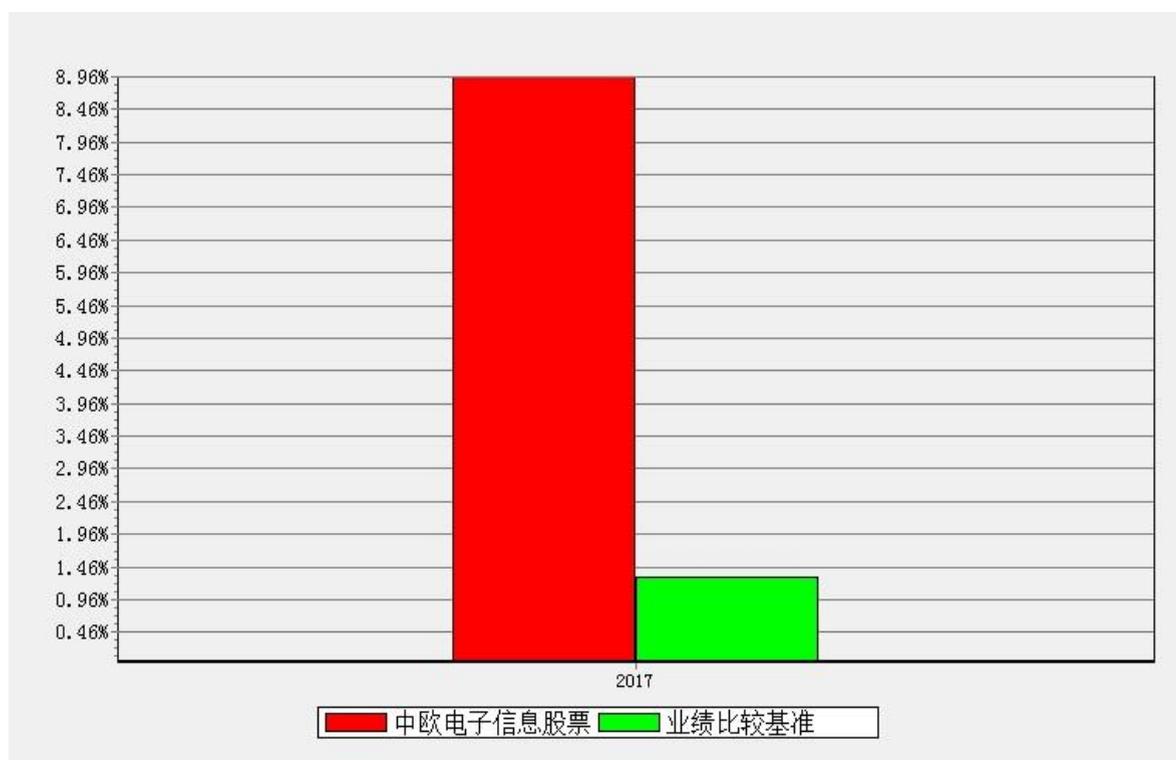
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金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07月07日-2017年12月31日)



注：本基金基金合同生效日期为2017年7月7日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2017年7月7日，2017年度数据为2017年7月7日至2017年7月7日数据

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2017年7月7日（基金合同生效日）至2017年12月31日未进行利润分配。

## § 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以及自然人股东，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、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司。截至2017年12月31日，本基金管理人共管理66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		

刘晨	基金经理	2017-07-07	-	10	历任中国国际金融有限公司资产管理部经理，方正富邦基金管理有限公司研究员、基金经理，永赢基金管理有限公司投资经理。2014-08-01加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司研究员
曲径	策略组负责人、基金经理	2017-11-17	-	10	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01加入中欧基金管理有限公司。

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

##### 4.3.2 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不公平交易的情况。

#### 4.3.3 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年全年A股市场的风格倾向于大盘蓝筹，资金集中在盈利预期稳定的偏消费类板块中，全年回顾看传媒，计算机和通信板块在A股所有板块中均排名靠后，电子部分白马全年有一定超额收益，但个股和板块走势差异相比2016年更大，出现了明显的二八分化局面，在外资进入的增量模式下，市场对于高ROE的稳定品种给予了相比过往市场中的很高的溢价，而对于短期ROE的波动则难以给予估值。

在此背景下，基金在7月份发行，从8，9月份进入正式运作，三季度基金集中配置在半导体行业中，并围绕5G和消费电子进行了比较集中的投资。在四季度我们判断宏观经济进入很强的区间，因此增加了偏后周期的计算机，如制造业升级等领域的配置，和传媒板块的投资。整体来看，在建仓期，基金表现一般，在调整中未能足够好地保存收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金自其运作日期至今净值增长率为8.96%，同期业绩比较基准增长率为1.30%。

#### 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2018年，在中美国债收益率不断攀升的环境下，个人整体思路是“把握蓝筹+后周期alpha”，由于宏观经济趋向于稳定，但边际增速放缓，市场对于业绩的确定性追求会超过2017年，同时，海外资金的不断流入也会加强市场对于“高壁垒”的认同，而非“高景气度，低估值”的传统基金投资思路。总体来看，可以对市场维持谨慎乐观，

主要由于部分蓝筹股估值相比海外仍有上升空间，港股情况也类似，但主要方向可能在消费与金融板块。

回归TMT内部，我们认为板块内部仍将出现大量的结构性机会，主要会集中在国家政策方向支持的人工智能，5G，大数据，半导体等领域，但相比2017年，可能对于股价的安全边际要求更高。其中比较重要的理由仍然是流动性，政府确定性的去杠杆会挤压金融市场的资金流入，全年流动性相比去年可能情况类似，我们认为重要的观察节点可能在二三季度。因此，全年看，我们将聚焦在TMT板块内的领先公司的业绩研究上，以“自下而上”的方法为客户获得超额收益。

长期看，TMT集中了中国产业转型升级的核心产业，无论汽车电子，半导体，5G等方向必将是中国未来10年的核心竞争力，我们对此充满信心。自下而上看，我们也不断发现中国企业的创新能力，研发水平不断提高，结合“工程师红利”，我们认为中国资本市场会出现一批更大更强的TMT核心资产。

具体投资方向上，我们全年将主抓TMT内部的蓝筹行情，以企业的竞争壁垒为核心，业绩和估值的匹配度为其次，精选个股。此外，对于未来3年明确看好的半导体，5G，智能制造，大数据和人工智能在把握安全边际的前提下进行投资。

#### 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的情形。

### § 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第22037号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中欧电子信息

	<p>产业沪港深股票型证券投资基金(以下简称“中欧电子信息产业沪港深股票基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了中欧电子信息产业沪港深股票基金2017年12月31日的财务状况以及2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中欧电子信息产业沪港深股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中欧电子信息产业沪港深股票基金的基金管理人中欧基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负</p>

	<p>责评估中欧电子信息产业沪港深股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中欧电子信息产业沪港深股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中欧电子信息产业沪港深股票基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中欧电子信息产业沪港深股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意</p>

	财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧电子信息产业沪港深股票基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮、俞伟敏
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2018-03-28

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年12月31日
<b>资 产：</b>	
银行存款	3,967,956.90
结算备付金	806,375.63
存出保证金	80,181.18
交易性金融资产	71,804,910.25
其中：股票投资	71,804,910.25
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	845,213.82
应收利息	1,539.35
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	77,506,177.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	384,914.53
应付管理人报酬	96,025.17
应付托管费	16,004.18
应付销售服务费	-
应付交易费用	331,173.56
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	165,526.82
负债合计	993,644.26
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	70,221,660.39
未分配利润	6,290,872.48

所有者权益合计	76,512,532.87
负债和所有者权益总计	77,506,177.13

注：

1. 报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.0896元，基金份额总额70,221,660.39份。

2. 本基金于2017年7月7日生效，本财务报表的实际编制期间为2017年7月7日至2017年12月31日止期间，故本报告中无对比数据，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2017年07月07日（基金合同生效日） 至2017年12月31日
一、收入	7,934,137.27
1. 利息收入	980,749.18
其中：存款利息收入	122,552.59
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	858,196.59
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	5,928,830.67
其中：股票投资收益	5,910,734.67
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	18,096.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	98,411.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	926,145.71
<b>减：二、费用</b>	<b>2,163,457.40</b>
1. 管理人报酬	807,019.22
2. 托管费	134,503.16
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,050,407.63
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	171,527.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>5,770,679.87</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>5,770,679.87</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31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)	241,435,798.05	-	241,435,798.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,770,679.87	5,770,679.87
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)	-171,214,137.66	520,192.61	-170,693,945.05
其中：1. 基金申购款	65,076,323.18	7,867,628.76	72,943,951.94
2. 基金赎回款	-236,290,460.84	-7,347,436.15	-243,637,896.99
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)	70,221,660.39	6,290,872.48	76,512,532.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金(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”)证监许可[2016]2826号《关于准予中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金注册的批复》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《中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金基金合同》于2017年7月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为241,435,798.05份基金份额,包含认购资金利息折合52,039.19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,基金托管人中国建设银行股份有限公司。

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2018年3月28日批准报出。

### 7.4.2 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》、《中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间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12月31日的财务状况以及2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的

交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司	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
万盛基业投资有限责任公司(“万盛基业”)	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司(“北京百骏”)	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a(“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)(“上海睦亿合伙”)	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司(“中欧盛世资管”)	基金管理人的控股子公司
中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司(“钱滚滚”)	基金管理人的控股子公司

注：1、本报告期内，经中欧基金管理有限公司(以下简称“中欧基金”)2017年股东大会通过，并经中国证券监督管理委员会批准(批准文号：证监许可[2017]1253号)，公司股东意大利意联银行股份合作公司(Unione di Banche Italiane S.p.A.)将其持有的公司10%股权转让给窦玉明、于洁、赵国英、卢纯青、方伊、关子阳、卞玺云、魏

博、郑苏丹、曲径、黎忆海等11人，万盛基业投资有限责任公司将其持有的公司1.7%股权转让给周玉雄、卢纯青等2人。此次股权转让完成之后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币188,000,000元。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2017年8月8日在指定媒介进行了信息披露，变更后的公司股权结构详见2017年8月8日披露的相关公告。

2、本报告期内，中欧基金管理有限公司旗下子公司钱滚滚财富管理（上海）有限公司，自2017年11月20日起将公司名称变更为“中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司”。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2017年11月22日在指定媒体进行了信息披露。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（基金合同生效日） 2017年07月07日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	19,637,132.90	2.76%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（基金合同生效日） 2017年07月07日至2017年12月31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	18,287.96	2.79%	645.42	0.19%

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。

#### 7.4.8.1.4 债券交易

无。

#### 7.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	220,000,000.00	3.86%

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	807,019.22
其中：支付销售机构的客户维护费	139,267.55

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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	134,503.16

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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07月07日至2 017年12月31日
基金合同生效日（2017年07月07日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	9,124,840.30
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	9,124,840.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.99%

注：本基金管理人于本报告期内通过中欧基金管理有限公司直销申购本基金，适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	883,113.28	1.26%

注：本基金自然人股东于本报告期内通过中欧基金管理有限公司直销申购本基金，适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.8.5 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07月07日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,967,956.90	77,377.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 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12月31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71,804,910.25元，无属于第二层次和第三层次的余额。

(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和债券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，确定相关股票和债券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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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，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。

根据财政部、国家税务总局于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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营

资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	71,804,910.25	92.64
	其中:股票	71,804,910.25	92.64
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	4,774,332.53	6.16
8	其他各项资产	926,934.35	1.20
9	合计	77,506,177.13	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	34,990,508.85	45.73

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	-	-
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	33,992,934.40	44.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,103,552.00	2.75
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	717,915.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	71,804,910.25	93.85

### 8.2.2 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股票。

### 8.3 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

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	002371	北方华创	176,000	7,293,440.00	9.53
2	300170	汉得信息	555,500	6,610,450.00	8.64
3	600845	宝信软件	249,500	4,625,730.00	6.05
4	300188	美亚柏科	223,100	4,457,538.00	5.83

				0	
5	300433	蓝思科技	142,061	4,240,520.85	5.54
6	300229	拓尔思	259,500	3,713,445.00	4.85
7	300271	华宇软件	211,097	3,141,123.36	4.11
8	002313	日海通讯	86,800	2,812,320.00	3.68
9	600271	航天信息	130,000	2,800,200.00	3.66
10	002624	完美世界	81,301	2,720,331.46	3.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.zofund.com网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	26,024,766.98	34.01
2	603228	景旺电子	13,080,788.00	17.10
3	300251	光线传媒	9,845,925.56	12.87
4	300346	南大光电	9,778,269.00	12.78
5	000049	德赛电池	9,575,100.88	12.51
6	002281	光迅科技	8,287,699.00	10.83
7	300271	华宇软件	8,037,280.95	10.50
8	300170	汉得信息	7,538,141.76	9.85
9	603979	金诚信	5,986,414.84	7.82
10	000651	格力电器	5,773,172.00	7.55
11	300077	国民技术	5,659,269.12	7.40

12	002027	分众传媒	5,638,553.20	7.37
13	H00902	华能国际电力股份	5,631,394.02	7.36
14	600116	三峡水利	5,408,374.00	7.07
15	300433	蓝思科技	5,325,065.80	6.96
16	002273	水晶光电	5,287,347.50	6.91
17	600741	华域汽车	4,824,437.00	6.31
18	603515	欧普照明	4,760,617.78	6.22
19	600835	上海机电	4,759,229.14	6.22
20	600060	海信电器	4,615,524.00	6.03
21	300188	美亚柏科	4,593,549.51	6.00
22	603589	口子窖	4,575,664.00	5.98
23	600845	宝信软件	4,520,841.00	5.91
24	600426	华鲁恒升	4,334,149.16	5.66
25	300229	拓尔思	4,167,035.00	5.45
26	601766	中国中车	4,057,194.77	5.30
27	300058	蓝色光标	4,002,427.12	5.23
28	600879	航天电子	3,671,415.00	4.80
29	002456	欧菲科技	3,641,718.00	4.76
30	002415	海康威视	3,592,939.00	4.70
31	300059	东方财富	3,537,288.28	4.62
32	600690	青岛海尔	3,382,415.00	4.42
33	600486	扬农化工	3,103,641.00	4.06
34	600674	川投能源	2,976,741.28	3.89
35	002429	兆驰股份	2,955,109.00	3.86
36	600271	航天信息	2,928,309.38	3.83
37	600977	中国电影	2,922,491.00	3.82
38	603933	睿能科技	2,919,591.43	3.82
39	603939	益丰药房	2,888,681.00	3.78
40	300378	鼎捷软件	2,885,495.84	3.77
41	002812	创新股份	2,816,804.00	3.68

42	002624	完美世界	2,785,663.35	3.64
43	002470	金正大	2,757,266.00	3.60
44	600900	长江电力	2,745,600.00	3.59
45	002081	金螳螂	2,733,398.00	3.57
46	600970	中材国际	2,679,389.00	3.50
47	002368	太极股份	2,645,453.88	3.46
48	600004	白云机场	2,572,776.10	3.36
49	603883	老百姓	2,561,462.00	3.35
50	000538	云南白药	2,549,704.00	3.33
51	002313	日海通讯	2,538,882.00	3.32
52	300168	万达信息	2,526,737.85	3.30
53	000759	中百集团	2,517,667.00	3.29
54	002465	海格通信	2,502,515.98	3.27
55	601233	桐昆股份	2,384,297.78	3.12
56	603038	华立股份	2,374,085.00	3.10
57	600406	国电南瑞	2,337,327.00	3.05
58	002353	杰瑞股份	2,284,661.00	2.99
59	300658	延江股份	2,207,712.00	2.89
60	000768	中航飞机	2,160,601.00	2.82
61	002439	启明星辰	2,150,515.00	2.81
62	300253	卫宁健康	2,136,838.00	2.79
63	002036	联创电子	2,122,818.12	2.77
64	600887	伊利股份	2,100,453.00	2.75
65	002151	北斗星通	2,083,225.00	2.72
66	600038	中直股份	2,032,893.02	2.66
67	603078	江化微	2,010,474.60	2.63
68	601607	上海医药	1,958,738.64	2.56
69	300202	聚龙股份	1,940,605.88	2.54
70	000910	大亚圣象	1,812,807.32	2.37
71	603826	坤彩科技	1,792,866.00	2.34
72	H03988	中国银行	1,729,759.60	2.26

73	300529	健帆生物	1,713,497.00	2.24
74	300183	东软载波	1,706,187.00	2.23
75	300316	晶盛机电	1,703,744.00	2.23
76	002032	苏泊尔	1,697,913.00	2.22
77	000596	古井贡酒	1,697,718.00	2.22
78	002035	华帝股份	1,697,514.00	2.22
79	603160	汇顶科技	1,696,979.00	2.22
80	002460	赣锋锂业	1,688,005.00	2.21
81	002466	天齐锂业	1,680,750.00	2.20
82	600702	沱牌舍得	1,667,103.00	2.18
83	000568	泸州老窖	1,655,837.00	2.16
84	000547	航天发展	1,654,108.00	2.16
85	000858	五粮液	1,652,602.00	2.16
86	002338	奥普光电	1,651,340.00	2.16
87	600990	四创电子	1,650,520.96	2.16
88	600562	国睿科技	1,649,811.50	2.16
89	300036	超图软件	1,609,051.00	2.10
90	603025	大豪科技	1,551,389.45	2.03
91	603328	依顿电子	1,542,057.00	2.02
92	002709	天赐材料	1,538,061.00	2.01

注：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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	23,049,757.24	30.13
2	603228	景旺电子	11,556,527.22	15.10
3	300251	光线传媒	9,982,945.00	13.05
4	300346	南大光电	9,797,940.75	12.81
5	000049	德赛电池	9,651,311.00	12.61
6	002281	光迅科技	9,156,307.78	11.97

7	603979	金诚信	5,941,372.88	7.77
8	300077	国民技术	5,713,847.00	7.47
9	000651	格力电器	5,700,297.82	7.45
10	H00902	华能国际电力股份	5,578,401.85	7.29
11	600116	三峡水利	5,332,614.00	6.97
12	002273	水晶光电	5,287,628.00	6.91
13	603589	口子窖	4,670,492.74	6.10
14	300271	华宇软件	4,633,472.92	6.06
15	600060	海信电器	4,420,241.70	5.78
16	600741	华域汽车	4,344,530.13	5.68
17	600690	青岛海尔	4,217,444.84	5.51
18	600426	华鲁恒升	4,111,320.78	5.37
19	300058	蓝色光标	4,059,048.00	5.31
20	002415	海康威视	4,039,101.50	5.28
21	002456	欧菲科技	3,902,404.60	5.10
22	002027	分众传媒	3,834,613.00	5.01
23	603939	益丰药房	3,382,852.00	4.42
24	300059	东方财富	3,352,806.00	4.38
25	002429	兆驰股份	3,154,534.00	4.12
26	601233	桐昆股份	3,077,589.00	4.02
27	603883	老百姓	3,052,621.00	3.99
28	600486	扬农化工	2,947,051.00	3.85
29	000538	云南白药	2,926,886.00	3.83
30	600977	中国电影	2,912,654.00	3.81
31	002812	创新股份	2,787,286.15	3.64
32	600674	川投能源	2,753,083.00	3.60
33	002470	金正大	2,720,164.35	3.56
34	600835	上海机电	2,626,982.40	3.43
35	600900	长江电力	2,624,539.00	3.43
36	002081	金螳螂	2,567,344.00	3.36

37	600970	中材国际	2,563,249.00	3.35
38	300168	万达信息	2,513,342.00	3.28
39	002465	海格通信	2,470,867.00	3.23
40	000759	中百集团	2,441,499.00	3.19
41	600406	国电南瑞	2,417,090.00	3.16
42	603038	华立股份	2,381,132.00	3.11
43	600887	伊利股份	2,330,754.41	3.05
44	603933	睿能科技	2,313,895.00	3.02
45	600004	白云机场	2,313,625.75	3.02
46	603515	欧普照明	2,295,386.40	3.00
47	300658	延江股份	2,239,615.00	2.93
48	300253	卫宁健康	2,147,361.32	2.81
49	601766	中国中车	2,116,862.00	2.77
50	000768	中航飞机	2,100,794.00	2.75
51	600038	中直股份	2,084,844.68	2.72
52	002353	杰瑞股份	2,075,929.00	2.71
53	000858	五粮液	2,050,025.00	2.68
54	000596	古井贡酒	2,040,746.67	2.67
55	002151	北斗星通	2,030,454.00	2.65
56	603078	江化微	1,994,045.00	2.61
57	002035	华帝股份	1,913,358.94	2.50
58	002036	联创电子	1,882,968.00	2.46
59	300202	聚龙股份	1,850,831.00	2.42
60	000568	泸州老窖	1,832,030.00	2.39
61	601607	上海医药	1,829,606.50	2.39
62	600879	航天电子	1,804,768.00	2.36
63	002032	苏泊尔	1,791,617.90	2.34
64	H03988	中国银行	1,761,590.77	2.30
65	300529	健帆生物	1,749,116.00	2.29
66	600990	四创电子	1,733,730.00	2.27
67	300183	东软载波	1,701,987.32	2.22

68	603826	坤彩科技	1,669,319.00	2.18
69	600562	国睿科技	1,644,515.50	2.15
70	603160	汇顶科技	1,634,430.00	2.14
71	300316	晶盛机电	1,619,406.00	2.12
72	000910	大亚圣象	1,618,023.00	2.11
73	002338	奥普光电	1,611,942.00	2.11
74	300378	鼎捷软件	1,602,203.35	2.09
75	002460	赣锋锂业	1,596,480.00	2.09
76	002466	天齐锂业	1,592,496.00	2.08
77	000547	航天发展	1,578,615.00	2.06
78	600702	沱牌舍得	1,563,764.00	2.04

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。

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	388,519,178.93
卖出股票收入（成交）总额	322,723,415.06

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	80,181.18
2	应收证券清算款	845,213.82
3	应收股利	-
4	应收利息	1,539.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	926,934.35

#### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
4,498	15,611.75	9,162,006.29	13.05%	61,059,654.10	86.95%

### 9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,120,097.61	1.60%

### 9.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年07月07日)基金份额总额	241,435,798.05
----------------------------	----------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	65,076,323.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	236,290,460.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	70,221,660.39

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 11.2.1 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。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟先生为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）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。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为60,000.00元人民币。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	佣金	占当期	

			股票成交总额比例		佣金总量的比例	
国金证券	1	3,791,391.00	0.53%	3,530.83	0.54%	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
方正证券（原民族证券）	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	41,239,759.35	5.80%	38,405.75	5.85%	-
银河证券	1	74,321,089.05	10.45%	69,215.02	10.55%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	153,076.00	0.02%	142.56	0.02%	-
西部证券	1	30,962,067.67	4.35%	28,834.66	4.40%	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	36,025,243.12	5.07%	33,549.99	5.11%	-
国都证券	2	19,637,132.90	2.76%	18,287.96	2.79%	-
广发证券	2	53,156,563.86	7.47%	43,163.90	6.58%	-
申万宏源西部证券	2	112,137,689.47	15.77%	104,433.05	15.92%	-
天风证券	2	274,569,408.32	38.60%	255,706.14	38.98%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	65,249,173.25	9.17%	60,766.75	9.26%	-

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. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

### 11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总量的比例	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券（原民族证券）	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	46,300,000.00	8.13%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	22	3.86%	-	-	-	-

			0, 00 0, 00 0. 00					
广发证券	-	-	5, 01 3, 00 0, 00 0. 00	88.01%	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中欧基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十日