

# 中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）

## 2018 年半年度报告

2018 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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月27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2018年01月01日起至2018年06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	7
§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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	56

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）		
基金简称	中欧新趋势混合（LOF）		
基金主代码	166001		
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）		
基金合同生效日	2007年01月29日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,310,808,948.93份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2007-04-23		
下属分级基金的基金简称	中欧新趋势混合（LOF）A	中欧新趋势混合（LOF）E	中欧新趋势混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	中欧趋势	-	-
下属分级基金的交易代码	166001	001881	005787
报告期末下属分级基金的份额总额	2,268,982,849.09份	41,690,304.08份	135,795.76份

注：自2018年3月21日起，本基金在现有A类和E类基金份额的基础上增设C类基金份额，原份额保持不变。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司，在兼顾风险的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的投资风格以积极的股票选择策略为特点，注重挖掘基于未来趋势的企业价值。资产配置和行业配置层面，本基金在正常市场条件下不做主动性资产配置调整，并倾向于持有较多符合经济发展和市场变革新趋势的行业。股票选择层面，本基金通过客观化的定量分析、主观化的定性分析、证券估值等步

	骤选择合适的、物有所值的上市公司股票构建最优投资组合。
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于中高风险、追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。在严格控制风险的前提下，本基金的投资将以前瞻的眼光把握经济发展与市场变革的中长期趋势，努力挖掘个股与板块、行业的投资机遇。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95561
传真	021-33830351	021-62159217
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	福州市湖东路154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	上海市江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	窦玉明	高建平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中证报、证券时报、上证报、证券日报
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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

地点	
----	--

## 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；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类、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)		
	中欧新趋势混合 (LOF) A	中欧新趋势混合 (LOF) E	中欧新趋势混合 (LOF) C
本期已实现收益	156,664,288.54	2,642,857.61	-1,390.73
本期利润	-221,261,389.36	-1,967,794.99	-10,703.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0894	-0.0463	-0.0811
本期加权平均净值利润率	-8.17%	-3.98%	-7.61%
本期基金份额净值增长率	-8.54%	-8.55%	-7.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)		
期末可供分配利润	63,714,701.05	3,365,514.52	3,501.00
期末可供分配基金份额利润	0.0281	0.0807	0.0258
期末基金资产净值	2,332,697,550.14	45,055,818.60	139,296.76
期末基金份额净值	1.0281	1.0807	1.0258
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	101.13%	31.74%	-7.13%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧新趋势混合（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.44%	1.52%	-6.42%	1.08%	0.98%	0.44%
过去三个月	-4.34%	1.15%	-8.33%	0.92%	3.99%	0.23%
过去六个月	-8.54%	1.17%	-10.78%	0.93%	2.24%	0.24%
过去一年	3.44%	1.04%	-4.60%	0.77%	8.04%	0.27%
过去三年	11.34%	1.60%	-21.79%	1.21%	33.13%	0.39%
自基金合同生效日至今	101.13%	1.59%	46.01%	1.44%	55.12%	0.15%

注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A600 指数\*80%+富时中国国债全价指数\*20%。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。

中欧新趋势混合（LOF）E

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----



	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-5.44%	1.52%	-6.42%	1.08%	0.98%	0.44%
过去三个月	-4.35%	1.15%	-8.33%	0.92%	3.98%	0.23%
过去六个月	-8.55%	1.18%	-10.78%	0.93%	2.23%	0.25%
过去一年	3.43%	1.04%	-4.60%	0.77%	8.03%	0.27%
自基金份额运作日至今	31.74%	1.23%	-1.42%	0.96%	33.16%	0.27%

注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A600 指数\*80%+富时中国国债全价指数\*20%。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。

中欧新趋势混合（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.51%	1.52%	-6.42%	1.08%	0.91%	0.44%
过去三个月	-4.54%	1.15%	-8.33%	0.92%	3.79%	0.23%
自基金份额运作日至今	-7.13%	1.16%	-10.90%	0.94%	3.77%	0.22%

注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A600 指数\*80%+富时中国国债全价指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧新趋势混合（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



中欧新趋势混合（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



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2018年6月30日。



注：本基金于2018年3月21日新增C类份额，图示日期为2018年3月22日至2018年06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2018年6月30日，本基金管理人共管理73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		
凌莉	基金经理助理	2017-03-23	-	10年	2008-01-07加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司培训生、助理研究员、研究员、金融工程研究员兼风控专员、基金经理助理、基金经理、交易员
周蔚文	投资总监、策略组负责人、基金经理	2011-08-16	-	18年	历任光大证券研究所研究员，富国基金研究员、高级研究员、基金经理。2011-01-10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部总监、副总经理

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不公平交易的情况。

### 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

回顾上半年，宏观经济总体延续去年的较好增长态势，不过由于居民对住房的偏爱，使得大家对地产业的预期产生了一些担忧。金融方面，去杠杆的背景下，社会总融资额下降，资金面有所偏紧。反映在A股，除了年初的金融地产脉冲性行情之外，只有医药行业持续表现较好，在社会资金偏紧、地产预期变化、美国挑起的贸易争端大超预期等背景下，股市持续下跌，超出了我们年初预期的上下震荡行情，寻找结构性机会的判断。本基金在年初预期资金面会有所偏紧、经济增速未来有所下滑，因此主要资产配置在医药、保险、科技三大方向，还少量配置其它行业景气趋好的细分行业，如油产业链、航空、火电。由于除了医药、火电之外，大部分行业股票持续下跌，因此本基金也取得负受益。

### 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-8.54%，同期业绩比较基准增长率为-10.78%；E类份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准率为-10.78%；C类份额净值增长率为-7.13%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%。

## 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年下半年，从宏观经济、股票估值、市场资金面三个角度综合来看，A股市场未来下跌空间有限，投资机会多于上半年的概率较大。

宏观经济方面，在地产预期继续偏紧、地方政府去杠杆，中美贸易争端可能继续存在的背景下，经济增长率会有所下滑，但股市已经开始反映了不少这些预期。只要对经济中长期前景有信心，经济增长率的正常缓慢下滑不会对企业的长期盈利到来持续负面影响。

股票估值方面，股票估值处于A股历史几次大底附近，只要经济不恶化，这种低估值不可能长期维持。

市场资金方面，这是影响股市的最重要的因素，在中短期内，国家政策起决定性作用。当前，金融去杠杆，防范系统性金融风险是第一任务。根据过去一两年的进度以及目的来看，对股市的边际影响即将进入逐步降低的阶段，国家目的是防范风险，主动调控，不会主动招来风险，从这个角度理解，金融去杠杆是有底的。

因此，目前对股市没必要过度悲观，保持中性偏谨慎乐观的态度，继续从有前景的行业中寻找竞争力强、长期价值低估的公司是我们的主要工作。

#### 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

本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。权益登记日为2018年1月11日，场内除息日为2018年1月12日，场外除息日为2018年1月11日，A类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.530元，合计发放红利366,463,710.60元，其中现金分红247,284,378.46元。E类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.610元，合计发放红利13,665,424.66元，其中现金分红为10,651,084.89元。

本基金本年度收益分配满足法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。权益登记日为2018年1月11日，场内除息日为2018年1月12日，场外除息日为2018年1月11日，A类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.530元，合计发放红利366,463,710.60元，其中现金分红247,284,378.46元。E类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.610元，合计发放红利13,665,424.66元，其中现金分红为10,651,084.89元。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	200,768,258.41	196,931,109.08
结算备付金		38,675,439.74	6,777,841.15
存出保证金		825,095.22	1,137,518.87

交易性金融资产	6.4.7.2	1,966,230,452.89	2,260,670,393.97
其中：股票投资		1,964,393,120.89	2,249,630,493.97
基金投资		-	-
债券投资		1,837,332.00	11,039,900.00
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	183,900,000.00	429,700,000.00
应收证券清算款		7,769,232.00	19,915,685.55
应收利息	6.4.7.5	20,857.12	-66,638.08
应收股利		-	-
应收申购款		564,870.79	1,067,176.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,398,754,206.17	2,916,133,087.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,796,826.26	46,862,960.23
应付赎回款		719,569.03	770,834.00
应付管理人报酬		3,033,105.70	3,355,048.30
应付托管费		505,517.59	559,174.71
应付销售服务费		94.30	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,348,149.74	1,208,764.52
应交税费		6.39	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-



递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,458,271.66	1,487,529.39
负债合计		20,861,540.67	54,244,311.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,310,808,948.93	2,241,137,750.72
未分配利润	6.4.7.1 0	67,083,716.57	620,751,025.52
所有者权益合计		2,377,892,665.50	2,861,888,776.24
负债和所有者权益总计		2,398,754,206.17	2,916,133,087.39

注：报告截止日2018年6月30日，A类基金份额净值1.0281元，基金份额2,268,982,849.09份；E类基金份额净值1.0807元，基金份额41,690,304.08份；C类基金份额净值1.0258元，基金份额135,795.76份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
<b>一、收入</b>		-192,258,526.67	373,524,905.56
1. 利息收入		6,309,248.27	11,435,184.45
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	1,918,431.85	948,141.41
债券利息收入		5,433.84	3,967,123.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,385,382.58	6,519,919.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		183,542,083.92	164,161,397.03

其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	169,084,682.31	147,755,889.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	753,929.69	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	13,703,471.92	16,405,507.93
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.1 6	-382,545,643.01	196,026,254.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.1 7	435,784.15	1,902,069.34
<b>减：二、费用</b>		30,981,360.92	38,215,558.40
1. 管理人报酬		20,489,819.98	26,930,348.47
2. 托管费		3,414,969.98	4,488,391.45
3. 销售服务费		317.00	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	6,832,416.07	6,550,404.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14.45	-
7. 其他费用	6.4.7.1 9	243,823.44	246,413.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		-223,239,887.59	335,309,347.16
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-223,239,887.59	335,309,347.16
-------------------	--	-----------------	----------------

注：本基金于2018年3月21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：中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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）	2,241,137,750.72	620,751,025.52	2,861,888,776.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-223,239,887.59	-223,239,887.59
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）	69,671,198.21	49,701,713.90	119,372,912.11
其中：1. 基金申购款	723,416,619.11	124,809,795.63	848,226,414.74
2. 基金赎回款	-653,745,420.90	-75,108,081.73	-728,853,502.63
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）	-	-380,129,135.26	-380,129,135.26
五、期末所有者权益（基金净值）	2,310,808,948.93	67,083,716.57	2,377,892,665.50
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至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)	3,764,958,990.80	121,164,356.22	3,886,123,347.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	335,309,347.16	335,309,347.16
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)	-1,210,653,971.77	-123,419,621.57	-1,334,073,593.34
其中：1. 基金申购款	484,365,529.64	27,924,572.61	512,290,102.25
2. 基金赎回款	-1,695,019,501.41	-151,344,194.18	-1,846,363,695.59
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)	2,554,305,019.03	333,054,081.81	2,887,359,100.84

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

中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)(原名为中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF),以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第243号《关于同意中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集6,871,163,845.62元,业经普华永道

中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第008号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2007年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,874,704,054.16份基金份额,其中认购资金利息折合3,540,208.54份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

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

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)于2015年7月17日公告后更名为中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)。

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8月28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》、《中欧新趋势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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需要说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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[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]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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	200,768,258.41
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	200,768,258.41

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,921,939,490.97	1,964,393,120.89	42,453,629.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	966,000.00	1,837,332.00
	银行间市场	-	-
	合计	966,000.00	1,837,332.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,922,905,490.97	1,966,230,452.89	43,324,961.92

#### 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2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
交易所市场	183,900,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	183,900,000.00	-

##### 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 2018年06月30日
应收活期存款利息	63,689.47
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	15,663.51
应收债券利息	952.77
应收资产支持证券利息	-



应收买入返售证券利息	-59,782.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	334.17
合计	20,857.12

#### 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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,348,149.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,348,149.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	2,203.37
预提费用-审计费	52,068.27
预提费用-信息披露费	278,848.72
预提费用-上市费	29,752.78
其他应付	95,202.82
应付转出费	195.70
合计	1,458,271.66

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 中欧新趋势混合（LOF）A

金额单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合 (LOF) A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,156,467,170.55	2,156,467,170.55
本期申购	697,770,225.20	697,770,225.20
本期赎回 (以“-”号填列)	-585,254,546.66	-585,254,546.66
本期末	2,268,982,849.09	2,268,982,849.09

## 6.4.7.9.2 中欧新趋势混合 (LOF) E

金额单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合 (LOF) E)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	84,670,580.17	84,670,580.17
本期申购	25,510,598.15	25,510,598.15
本期赎回 (以“-”号填列)	-68,490,874.24	-68,490,874.24
本期末	41,690,304.08	41,690,304.08

## 6.4.7.9.3 中欧新趋势混合 (LOF) C

金额单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合 (LOF) C)	本期2018年03月21日至2018年06月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	135,795.76	135,795.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	135,795.76	135,795.76

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2018年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为32,402,450.00份，均为中欧新趋势A类基金份额(2017年6月30日：深交所上市的基金份额为29,237,266.00份，均为中欧新趋势A类基金份额)，托管在场外未上市交易的基金份额为2,278,406,498.93

份，其中中欧新趋势A类基金份额2,236,580,399.09份，中欧新趋势E类基金份额41,690,304.08份，中欧新趋势C类基金份额135,795.76份(2017年6月30日：托管在场外未上市交易的基金份额为2,525,067,753.03份，其中中欧新趋势A类基金份额2,372,096,900.54份，中欧新趋势E类基金份额152,970,852.49份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现本基金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

##### 6.4.7.10.1 中欧新趋势混合（LOF）A

单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合（LOF）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	597,886,256.10	-5,925,626.96	591,960,629.14
本期利润	156,664,288.54	-377,925,677.90	-221,261,389.36
本期基金份额交易产生的变动数	35,622,444.43	23,856,727.44	59,479,171.87
其中：基金申购款	145,536,988.23	-25,095,875.90	120,441,112.33
基金赎回款	-109,914,543.80	48,952,603.34	-60,961,940.46
本期已分配利润	-366,463,710.60	-	-366,463,710.60
本期末	423,709,278.47	-359,994,577.42	63,714,701.05

##### 6.4.7.10.2 中欧新趋势混合（LOF）E

单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合（LOF）E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,949,967.23	8,840,429.15	28,790,396.38
本期利润	2,642,857.61	-4,610,652.60	-1,967,794.99
本期基金份额交易产生的变动数	-3,082,677.92	-6,708,984.29	-9,791,662.21
其中：基金申购款	3,003,146.85	1,351,332.21	4,354,479.06

基金赎回款	-6,085,824.77	-8,060,316.50	-14,146,141.27
本期已分配利润	-13,665,424.66	-	-13,665,424.66
本期末	5,844,722.26	-2,479,207.74	3,365,514.52

#### 6.4.7.10.3 中欧新趋势混合（LOF）C

单位：人民币元

项目 (中欧新趋势混合（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	-1,390.73	-9,312.51	-10,703.24
本期基金份额交易产生的变动数	26,426.90	-12,222.66	14,204.24
其中：基金申购款	26,426.90	-12,222.66	14,204.24
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,036.17	-21,535.17	3,501.00

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	1,727,318.10
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	170,227.93
其他	20,885.82
合计	1,918,431.85

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日

卖出股票成交总额	2,278,927,818.36
减：卖出股票成本总额	2,109,843,136.05
买卖股票差价收入	169,084,682.31

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	753,929.69
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	753,929.69

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,799,996.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,039,900.00
减：应收利息总额	6,166.32
买卖债券差价收入	753,929.69

#### 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 2018年01月01日至2018年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	13,703,471.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,703,471.92

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-382,545,643.01
——股票投资	-383,416,975.01
——债券投资	871,332.00
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-382,545,643.01

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	367,070.45
转换费收入	68,713.70
合计	435,784.15

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	6,832,416.07
银行间市场交易费用	-
合计	6,832,416.07

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	52,068.27
信息披露费	138,848.72
汇划手续费	4,353.67
帐户维护费	18,000.00
上市费	29,752.78
其他费用	800.00
合计	243,823.44

#### 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
兴业银行股份有限公司	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
自然人股东	基金管理人的股东

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

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2018年01月01日至201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,489,819.98	26,930,348.47
其中：支付销售机构的客户维护费	1,434,163.62	1,174,469.66

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费



单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,414,969.98	4,488,391.45

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中欧新趋势混合（L OF）A	中欧新趋势混合（L OF）E	中欧新趋势混合（L OF）C	合计
兴业银行 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	0.00	317.00	317. 00
国都证券	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	317.00	317. 00

注：

1、本基金A类、E类基金份额不收取销售服务费，自2018年3月21日起，本基金在现有A类和E类基金份额的基础上增设C类基金份额，所以上年度可比期间无对应数据。

2、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类基金份额前一日的基金资产净值

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2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

中欧新趋势混合（LOF）A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日
基金合同生效日（2007年01月29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	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中欧新趋势混合（LOF）E

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日（2007年01月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	149,943.01	149,943.01
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	149,943.01	149,943.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.36%	0.10%

中欧新趋势混合（LOF）C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日（2007年01月29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	135,795.76	-
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	135,795.76	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	100.00%	-

注：买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，卖出/赎回总份额含转换出份额。

#### 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

份额单位：份

中欧新趋势混合（LOF）A

关联方名称	本期末 2018年06月30日		上年度末 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	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	42,443.98	0.00%	42,443.98	0.00%

中欧新趋势混合（LOF）E

关联方名称	本期末 2018年06月30日		上年度末 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	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	367,598.72	0.88%	87,618.66	0.10%

注：

1、截止本报告期末，本基金自然人股东持有本基金A类份额的实际比例为0.0019%。截止上年度末，本基金自然人股东持有本基金A类份额的实际比例为0.0020%。上表展示的比例均为四舍五入后的结果。

2、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机构申购本基金，适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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
兴业银行股份有限公司	200,768,258.41	1,727,318.10	29,640,887.54	614,889.02

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明  
无。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金  
中欧新趋势混合（LOF）A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		2018-01-12 (场内)	2018-01-11 (场外)					
1	2018-01-11	2018-01-12 (场内)	2018-01-11 (场外)	1.530	247,284,378.46	119,179,332.14	366,463,710.60	-
合计				1.530	247,284,378.46	119,179,332.14	366,463,710.60	-

中欧新趋势混合（LOF）E

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放总	本期利润分配合计	备注
----	-------	-----	--------	----------	----------	----------	----

				份额分 红数		额		
1	2018-01-11	2018-01-12 (场内)	2018-01-11 (场外)	1.610	10,651,084.89	3,014,339.77	13,665,424.66	-
合计				1.610	10,651,084.89	3,014,339.77	13,665,424.66	-

注：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（2018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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新股锁定	13.77	16.40	1,054,601	14,521,855.77	17,295,456.40	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于中高风险、追求长期稳定资本增值的股票型证券投资基金。在严格控制风险的前提下，本基金的投资将以前瞻的眼光把握经济发展与市场变革的中长期趋势，努力挖掘个股与板块、行业的投资机遇。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。本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司，在兼顾风险的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、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。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发行的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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2018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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金流动性情况良好，持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发发行上市且可自由流通的品种，均能及时以合理的价格及时变现以满足流动性的需求。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。综合来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

#### 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债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018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	200,768,258.41	-	-	-	200,768,258.41
结算备付金	38,675,439.74	-	-	-	38,675,439.74
存出保证金	825,095.22	-	-	-	825,095.22

交易性金融资产	-	-	1,837,332.00	1,964,393,120.89	1,966,230,452.89
买入返售金融资产	183,900,000.00	-	-	-	183,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	7,769,232.00	7,769,232.00
应收利息	-	-	-	20,857.12	20,857.12
应收申购款	-	-	-	564,870.79	564,870.79
资产总计	424,168,793.37	-	1,837,332.00	1,972,748,080.80	2,398,754,206.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,796,826.26	13,796,826.26
应付赎回款	-	-	-	719,569.03	719,569.03
应付管理人报酬	-	-	-	3,033,105.70	3,033,105.70
应付托管费	-	-	-	505,517.59	505,517.59
应付销售服务费	-	-	-	94.30	94.30
应付交易费用	-	-	-	1,348,149.74	1,348,149.74
应交税费	-	-	-	6.39	6.39
其他负债	-	-	-	1,458,271.66	1,458,271.66
负债总计	-	-	-	20,861,540.67	20,861,540.67
利率敏感度缺	424,168,793.37	-	1,837,332.00	1,951,886,540.13	2,377,892,665.50

口					
上年度末2017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	196,931,109.08	-	-	-	196,931,109.08
结算备付金	6,777,841.15	-	-	-	6,777,841.15
存出保证金	1,137,518.87	-	-	-	1,137,518.87
交易性金融资产	-	-	11,039,900.00	2,249,630,493.97	2,260,670,393.97
买入返售金融资产	429,700,000.00	-	-	-	429,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	19,915,685.55	19,915,685.55
应收利息	-	-	-	-66,638.08	-66,638.08
应收申购款	-	-	-	1,067,176.85	1,067,176.85
资产总计	634,546,469.10	-	11,039,900.00	2,270,546,718.29	2,916,133,087.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	46,862,960.23	46,862,960.23
应付赎回款	-	-	-	770,834.00	770,834.00
应付管理人报酬	-	-	-	3,355,048.30	3,355,048.30
应付托管费	-	-	-	559,174.71	559,174.71

应付交易费用	-	-	-	1,208,764.52	1,208,764.52
其他负债	-	-	-	1,487,529.39	1,487,529.39
负债总计	-	-	-	54,244,311.15	54,244,311.15
利率敏感度缺口	634,546,469.10	-	11,039,900.00	2,216,302,407.14	2,861,888,776.24

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2018年06月30日本基金持有交易性债券资产占比0.08% (2017年12月31日:0.39%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017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。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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,964,393,120.89	82.61	2,249,630,493.97	78.61
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	1,964,393,120.89	82.61	2,249,630,493.97	78.61

#### 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:人民币元)	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	261,694,283.38	188,954,286.24
	2. 业绩比较基准下降5%	-261,694,283.38	-188,954,286.24

#### 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2018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1,948,846,966.34元，属于第二层次的余额为17,383,486.55元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次2,249,481,985.77元，第二层次11,188,408.20元，无第三层次)。

##### (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2018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(2017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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例(%)
1	权益投资	1,964,393,120.89	81.89
	其中：股票	1,964,393,120.89	81.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,837,332.00	0.08
	其中：债券	1,837,332.00	0.08
	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	183,900,000.00	7.67
	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	239,443,698.15	9.98
8	其他各项资产	9,180,055.13	0.38
9	合计	2,398,754,206.17	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

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	53,574,392.72	2.25
C	制造业	1,135,552,154.75	47.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,617,011.73	3.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	237,535,656.62	9.99
G	交通运输、仓储和邮政业	108,614,016.68	4.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	189,439,379.22	7.97
K	房地产业	38,818,167.40	1.63

L	租赁和商务服务业	57,181,601.73	2.40
M	科学研究和技术服务业	42,449,657.90	1.79
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,529,856.00	1.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,964,393,120.89	82.61

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300003	乐普医疗	3,851,706	141,280,576.08	5.94
2	300601	康泰生物	2,239,360	138,952,288.00	5.84
3	000538	云南白药	1,156,632	123,713,358.72	5.20
4	000661	长春高新	538,672	122,655,614.40	5.16
5	601318	中国平安	2,067,954	121,140,745.32	5.09
6	603368	柳药股份	2,580,991	87,185,875.98	3.67
7	600498	烽火通信	3,216,593	79,932,336.05	3.36
8	600011	华能国际	11,720,983	74,545,451.8	3.13



				8	
9	601100	恒立液压	3,458,590	72,215,359.20	3.04
10	000063	中兴通讯	5,273,000	68,707,190.00	2.89
11	601601	中国太保	2,138,070	68,097,529.50	2.86
12	002589	瑞康医药	4,359,960	59,469,854.40	2.50
13	002027	分众传媒	5,975,089	57,181,601.73	2.40
14	601899	紫金矿业	14,840,552	53,574,392.72	2.25
15	300122	智飞生物	1,156,332	52,890,625.68	2.22
16	002185	华天科技	8,644,721	48,756,226.44	2.05
17	600976	健民集团	2,284,691	47,955,664.09	2.02
18	600029	南方航空	5,506,235	46,527,685.75	1.96
19	002821	凯莱英	524,400	45,743,412.00	1.92
20	600511	国药股份	1,592,737	42,924,262.15	1.81
21	603127	昭衍新药	802,451	42,449,657.90	1.79
22	600048	保利地产	3,181,817	38,818,167.40	1.63
23	601111	中国国航	4,199,644	37,334,835.16	1.57
24	000639	西王食品	2,635,285	33,810,706.55	1.42

25	002493	荣盛石化	3,263,575	33,680,094.00	1.42
26	603757	大元泵业	1,049,322	29,286,577.02	1.23
27	300347	泰格医药	428,800	26,529,856.00	1.12
28	603885	吉祥航空	1,606,197	24,751,495.77	1.04
29	300595	欧普康视	549,544	24,630,562.08	1.04
30	002690	美亚光电	927,301	22,106,855.84	0.93
31	600742	一汽富维	1,617,566	19,782,832.18	0.83
32	002242	九阳股份	1,035,541	18,318,720.29	0.77
33	601138	工业富联	1,054,601	17,295,456.40	0.73
34	002838	道恩股份	800,498	15,393,576.54	0.65
35	603387	基蛋生物	290,500	14,751,590.00	0.62
36	603367	辰欣药业	347,000	8,109,390.00	0.34
37	300577	开润股份	81,207	3,347,352.54	0.14
38	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.01
39	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
40	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
41	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
42	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
43	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
44	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

## 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	601009	南京银行	145,319,079.15	5.08
2	000063	中兴通讯	128,836,763.79	4.50
3	600029	南方航空	119,220,670.55	4.17
4	000002	万科A	118,738,273.38	4.15
5	601899	紫金矿业	100,047,558.62	3.50
6	600000	浦发银行	99,749,385.14	3.49
7	601111	中国国航	92,512,023.46	3.23
8	000059	华锦股份	92,239,686.98	3.22
9	603619	中曼石油	88,264,594.87	3.08
10	002027	分众传媒	84,076,945.51	2.94
11	600048	保利地产	74,880,063.04	2.62
12	600011	华能国际	73,268,606.46	2.56
13	601601	中国太保	71,740,107.63	2.51
14	601318	中国平安	71,600,843.05	2.50
15	000408	藏格控股	63,945,878.79	2.23
16	002589	瑞康医药	60,411,323.81	2.11
17	600511	国药股份	56,116,557.22	1.96
18	603127	昭衍新药	47,150,714.65	1.65
19	600030	中信证券	45,724,102.00	1.60
20	002821	凯莱英	41,254,964.18	1.44

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。

## 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	000858	五 粮 液	181,227,906.08	6.33
2	601336	新华保险	150,955,240.71	5.27
3	601318	中国平安	140,003,340.41	4.89
4	601009	南京银行	132,813,060.84	4.64
5	600519	贵州茅台	121,035,159.30	4.23
6	300122	智飞生物	117,588,469.74	4.11
7	000002	万 科 A	109,684,755.89	3.83
8	300433	蓝思科技	100,716,953.89	3.52
9	600000	浦发银行	93,727,388.23	3.28
10	601601	中国太保	93,716,100.46	3.27
11	002027	分众传媒	90,642,760.04	3.17
12	000059	华锦股份	70,209,931.14	2.45
13	603619	中曼石油	69,753,240.91	2.44
14	002672	东江环保	62,443,357.56	2.18
15	002142	宁波银行	60,799,222.00	2.12
16	600029	南方航空	56,941,907.09	1.99
17	000408	藏格控股	54,285,774.73	1.90
18	000661	长春高新	52,215,860.92	1.82
19	600030	XD中信证	45,509,576.12	1.59
20	002185	华天科技	40,805,872.34	1.43

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,208,022,737.98
卖出股票收入（成交）总额	2,278,927,818.36

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,837,332.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,837,332.00	0.08

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123008	康泰转债	9,660	1,837,332.00	0.08

#### 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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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 本基金投资的中兴通讯股份有限公司（简称“中兴通讯”，000063.SZ）于2018年6月8日与美国BIS达成和解协议，根据协议将支付合计14亿美元民事罚款。随着2015年4G投资高峰的过去，我国电讯运营商的资本开支在2016-2018年逐年下滑，这一局面将因2019年开始的5G建设投入而扭转。根据业内预计，2019-2022年期间5G的资本开支将逐步增大，预计投资总额将是4G的两倍以上，中兴通讯作为全球领先的通信设备提供商将直接受益。但我们没有预料到的中兴通讯会成为中美贸易战的牺牲品，被美国政府禁止美国企业向其出售任何产品，这对中兴无疑将造成极大的打击。然而，我们认为有超过一半的概率美国将解除对中兴的禁售令，虽然中美的贸易摩擦对中兴短期的业绩确会产生影响，但中国5G的发展不会停止，公司长期的价值也不会受很大影响。其余九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	825,095.22
2	应收证券清算款	7,769,232.00
3	应收股利	-
4	应收利息	20,857.12

5	应收申购款	564,870.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,180,055.13

#### 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 新趋 势混 合（L OF）A	72,516	31,289.41	1,494,516,715.23	65.87%	774,466,133.86	34.13%
中欧 新趋 势混 合（L	388	107,449.24	13,901,173.05	33.34%	27,789,131.03	66.66%

OF) E						
中欧新趋势混合（LOF）C	1	135,795.76	135,795.76	100.00%	-	-
合计	72,905	31,696.17	1,508,553,684.04	65.28%	802,255,264.89	34.72%

### 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	云南国际信托有限公司—筌岚集合资金信托计划	4,438,669.00	13.70
2	云南国际信托有限公司—云霞17期集合资金信托计划	600,948.00	1.85
3	欧阳钢	495,198.00	1.53
4	罗颖	351,270.00	1.08
5	北京瑞和投资咨询有限责任公司	288,507.00	0.89
6	吴芳娟	263,474.00	0.81
7	黄伟民	260,000.00	0.80
8	张艳	208,879.00	0.64
9	罗惠仪	201,957.00	0.62
10	赵晓华	198,055.00	0.61

注：上表所列持有人均为场内持有人。

### 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	中欧新趋势混合（LOF）A	171,476.83	0.01%
	中欧新趋势混合（LOF）E	9,608,495.50	23.05%



	中欧新趋势混合（L OF）C	0.00	0.00%
	合计	9,779,972.33	0.42%

#### 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	中欧新趋势混合（L OF）A	0~10
	中欧新趋势混合（L OF）E	>100
	中欧新趋势混合（L OF）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	中欧新趋势混合（L OF）A	0
	中欧新趋势混合（L OF）E	>100
	中欧新趋势混合（L OF）C	0
	合计	>100

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧新趋势混合（L OF）A	中欧新趋势混合（L OF）E	中欧新趋势混合（L OF）C
基金合同生效日（2 007年01月29日）基 金份额总额	6,874,704,054.16	-	-
本报告期期初基金 份额总额	2,156,467,170.55	84,670,580.17	-
本报告期基金总申	697,770,225.20	25,510,598.15	135,795.76

购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	585,254,546.66	68,490,874.24	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,268,982,849.09	41,690,304.08	135,795.76

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

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未发生重大的人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	57,201,269.78	1.28%	53,271.60	1.28%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	631,831,696.97	14.16%	588,426.06	14.16%	-
海通证券	1	940,929,696.19	21.08%	876,292.68	21.08%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	1,698,502,918.17	38.05%	1,581,820.57	38.05%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-

公司						
中信证券	1	72,740,519.68	1.63%	67,742.85	1.63%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	295,236,784.12	6.61%	274,954.29	6.61%	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	767,199,383.00	17.19%	714,493.30	17.19%	-

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，本基金减少广发证券深圳交易单元、华泰证券上海交易单元。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	11,799,996.01	100.00%	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	19,175,100,000.00	75.55%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	6,206,600,000.00	24.45%	-	-	-	-

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，本基金减少广发证券深圳交易单元、华泰证券上海交易单元。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2017年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证监会指定媒体	2018-01-01
2	中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)分红公告	中国证监会指定媒体	2018-01-09
3	中欧新趋势混合型证券投资	中国证监会指定媒体	2018-01-11

	基金（LOF）恢复大额申购、转换转入和定期定额投资的公告		
4	中欧基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通转换业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-01-15
5	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）2017年第4季度报告	中国证监会指定媒体	2018-01-19
6	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过天天基金和国泰君安代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-01-19
7	中欧基金管理有限公司关于新增大连银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-06
8	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2018年第1号）	中国证监会指定媒体	2018-03-14
9	中欧基金管理关于新增财通证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通定投和转换业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-14
10	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2018年第1号）	中国证监会指定媒体	2018-03-14
11	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过交通银行代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-20

	告		
12	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）基金合同（修订）	中国证监会指定媒体	2018-03-21
13	中欧基金管理有限公司关于中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）增加C类基金份额并相应修改基金合同的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-21
14	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）托管协议（修订）	中国证监会指定媒体	2018-03-24
15	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）基金合同（修订）	中国证监会指定媒体	2018-03-24
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金因法律法规变动相应修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-24
17	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	中国证监会指定媒体	2018-03-30
18	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	中国证监会指定媒体	2018-03-30
19	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）2017年年度报告摘要	中国证监会指定媒体	2018-03-30
20	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）2017年年度报告	中国证监会指定媒体	2018-03-30
21	中欧基金管理有限公司关于新增陆金所资管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的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-17

22	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-19
23	中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）2018年第一季度报告	中国证监会指定媒体	2018-04-23
24	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过挖财基金代销定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-23
25	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中兴通讯”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒体	2018-04-25
26	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过招商银行代销定投最低申购金额的公告	中国证监会指定媒体	2018-05-24
27	中欧基金管理有限公司关于新增长城证券为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务的公告	中国证监会指定媒体	2018-06-11
28	中欧基金管理有限公司关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒体	2018-06-19
29	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	中国证监会指定媒体	2018-06-30

## § 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	2018年1月2日至2018年4月3日、2018年5月28日至2018年6月30日	359,552,005.70	235,385,641.43	101,472,802.24	493,464,844.89	21.35%
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。							

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 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、中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、《中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《中欧新趋势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  
二〇一八年八月二十八日