

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:2015年08月26日

重要提示
基金管理人的董事会及监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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人报告的内容如有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，由此给基金份额持有人造成损失的，基金管理人和基金托管人应承担连带责任。
基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
基金投资于股票市场，股票价格会随市场波动而变化，因此基金净值将随市场波动而变化，投资者在投资本基金前，应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同等法律文件，了解详细信息，应阅读半年度报告正文。
本基金首次募集期为2015年1月1日起至2015年6月30日止。
本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)(转型前)

基金名称 中欧中小盘股票(LOF)

场内简称 中欧小盘

基金代码 166006

交易代码 166006

基金运作方式 约约上市开放式(LOF)

基金合同生效日 2009年12月8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 3,014,641,105.56份

基金合同的续期安排 不定期

基金上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2010年03月08日

2.1.2 中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)(转型后)

基金名称 中欧行业成长混合(LOF)

场内简称 中欧成长

基金代码 166006

交易代码 166006

基金运作方式 约约上市开放式(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 3,041,803,362.65份

基金合同的续期安排 不定期

注:本基金转型日期为2015年1月30日,即日起中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)正式变更为中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)。

2.2 基金产品说明

2.2.1 中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)(转型前)

投资目标 本基金主要投资于具有良好成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业,特别是那些由于盈利能力的小企业,在经济周期的前半段,力争实现基金资产的长期增长。

投资策略 本基金将综合自下而上的资产配置策略和自上而下的个股精选策略,通过深入研究和分析,把握中国经济发展的脉搏,精选具有核心竞争力的上市公司。同时结合行业分析、动态调整和组合优化,动态调整和组合优化。

业绩比较基准 40%×沪深300指数收益率+40%×中证小盘指数收益率+20%×中债总督指数收益率。

风险收益特征 本基金属于股票型基金,其证券资产投资比例的高限,政策风险,其长期平均风险和预期收益均高于货币市场基金和债券基金。

2.2.2 中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)(转型后)

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健增值。

投资策略 本基金将综合自下而上的资产配置策略和自上而下的个股精选策略,通过深入研究和分析,把握中国经济发展的脉搏,精选具有核心竞争力的上市公司。同时结合行业分析、动态调整和组合优化,动态调整和组合优化。

业绩比较基准 沪深300指数收益率+70%×中债总督指数收益率+3%×风险溢价率。

风险收益特征 本基金为混合型基金,其股票投资比例相对较高,风险水平高于债券基金和货币基金。

注:本基金目前以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,议案内容包括对基金业绩比较基准的修改,由之前的“40%×沪深300指数收益率+40%×中证小盘指数收益率+20%×中债总督指数收益率”修改为“沪深300指数收益率+75%×中债综合指数收益率+25%”。上述持有人大会决议自2015年1月30日起正式生效。

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(转型前) 中欧基金管理有限公司 中国邮政储蓄银行股份有限公司

名称(转型后) 中欧基金管理有限公司 中国邮政储蓄银行股份有限公司

联系人 联系电话 021-69906900 010-69981112

电子邮箱 liyihua@zfund.com baiyuanhang@zfund.com

客户服务电话 021-69907000, 400-700-9700 95580

传真 021-33930031 010-69981100

2.4 信息披露方式

项目 网址 www.zfund.com

基金年度报告备置地点 基金管理人办公地址

§ 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

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2015年01月01日-2015年01月29日

本期已实现收益 141,085,136.00

本期可供分配利润 133,972,188.36

加权平均基金份额本期利润 0.083

本期基金份额变动率 5.69%

3.1.2 期间数据和指标 2015年01月29日

期末可供分配基金份额利润 -0.1570

期末基金资产净值 2,738,190,360.42

期末基金份额净值 0.9963

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.期末可供分配利润除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,不包括当年盈余)。
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低于前所列数字。

转型后

金额单位:人民币元

3.1.4 期间数据和指标 2015年01月30日-2015年06月30日

本期已实现收益 1,662,798.39

1,530,541,406.36

加权平均基金份额本期利润 0.4935

本期基金份额变动率 4.0100%

3.1.5 期末数据和指标 2015年06月30日

资产净值 3,097,094,229.47

基金份额净值 1.0121

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.期末可供分配利润除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,不包括当年盈余)。
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低于前所列数字。

注:本基金大类资产的投资比例为:股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于成长型行业股票的比例不超过非现金基金资产的5%。权证、货币市场工具、国债、债券回购、资产支持证券、贵金属等金融衍生品的投资比例合计不超过基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资的具比如比例限制,我们选择具有较强代表性的具体投资表现作为本基金业绩的评价标准。在代表大类资产的表现的具比如指标上,最终具体比例为股票部分90%、大宗商品部分10%、权证部分5%。比值越大每个交易日进行一次再平衡,使大类资产比例保持恒定。
3.2.2 自基金合同生效以来以基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较(转型前)

阶段 份额净增长率(长短期) 份额净增长率(长短期) 业绩比较基准收益率(长短期) 业绩比较基准收益率(长短期) ①-③ ②-④

过去一个月 6.11% 15.0% 30.9% 14.6% 2.15% 0.04%

过去二个月 15.60% 15.6% 19.7% 12.7% -4.18% 0.30%

过去三个月 26.89% 13.1% 34.3% 10.5% -74.2% 0.26%

过去一年 25.84% 12.9% 41.6% 9.06% -15.72% 0.33%

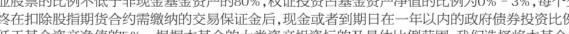
过去二年 16.69% 15.0% 54.42% 10.3% -37.73% 0.56%

自基金合同生效之日起至今 -4.07% 1.40% 23.0% 1.13% -28.77% 0.36%

注:本基金大类资产的投资比例为:股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于成长型行业股票的比例不超过非现金基金资产的5%。权证、货币市场工具、国债、债券回购、资产支持证券、贵金属等金融衍生品的投资比例合计不超过基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资的具比如比例限制,我们选择具有较强代表性的具体投资表现作为本基金业绩的评价标准。在代表大类资产的表现的具比如指标上,最终具体比例为股票部分90%、大宗商品部分10%、权证部分5%。比值越大每个交易日进行一次再平衡,使大类资产比例保持恒定。
3.2.2 自基金合同生效以来以基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较(转型后)

中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2009年12月30日-2015年01月29日)



3.3 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(转型后)

阶段 份额净增长率(长短期) 份额净增长率(长短期) 业绩比较基准收益率(长短期) 业绩比较基准收益率(长短期) ①-③ ②-④

过去一个月 -18.34% 4.2% -6.55% 2.62% -12.79% 1.58%

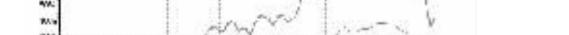
过去二个月 11.30% 3.31% 8.50% 1.96% 28.9% 1.36%

自基金合同生效之日起至今 41.05% 2.79% 21.34% 1.67% 107.10% 1.12%

注:本基金大类资产的投资比例为:股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于成长型行业股票的比例不超过非现金基金资产的5%。权证、货币市场工具、国债、债券回购、资产支持证券、贵金属等金融衍生品的投资比例合计不超过基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资的具比如比例限制,我们选择具有较强代表性的具体投资表现作为本基金业绩的评价标准。在代表大类资产的表现的具比如指标上,最终具体比例为股票部分90%、大宗商品部分10%、权证部分5%。比值越大每个交易日进行一次再平衡,使大类资产比例保持恒定。
3.2.2 自基金合同生效以来以基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较(转型后)

中行行业成长混合型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年01月30日-2015年06月30日)



3.4 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

4.1.2 基金经理

4.1.3 基金投资决策

4.1.4 基金风险控制

4.1.5 基金绩效评价

4.1.6 基金费用

4.1.7 基金信息披露

4.1.8 基金销售

4.1.9 基金估值

4.1.10 基金转换

4.1.11 基金分红

4.1.12 基金折算

4.1.13 基金上市

4.1.14 基金存续

4.1.15 基金暂停

4.1.16 基金恢复

4.1.17 基金终止

4.1.18 基金清算

4.1.19 基金合同终止

4.1.20 基金合同终止

4.1.21 基金合同终止

4.1.22 基金合同终止

4.1.23 基金合同终止

4.1.24 基金合同终止

4.1.25 基金合同终止

4.1.26 基金合同终止

4.1.27 基金合同终止

4.1.28 基金合同终止

4.1.29 基金合同终止

</