

# 中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)

[2015] 第四季度报告

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

报告送出日期:2016年1月22日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国邮政储蓄银行股份有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则勤勉尽责地履行本报告中的财务指标、净值表现、收益分配等信息的披露义务，但不保证基金一定盈利。

基金经理仅就本基金的表现向其委托人披露，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	
场内简称	
基金主代码	
基金运作方式	
基金合同生效日	
报告期末基金份额总额	
投资目标	
投资策略	
业绩比较基准	
风险收益特征	
基金管理人	
基金托管人	
基金简称	中欧行业成长混合(LOF)
场内简称	中欧行业成长
基金主代码	160006
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2010-07-20
报告期末基金份额总额	1,386,034,034.00份
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增值。
投资策略	本基金将根据宏观经济、政策环境以及资金供求关系三个影响因素的变化，适时调整股票、债券和现金三类资产类别配置比例，确保相对合理资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+银行定期存款利率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券基金，低于股票型基金，属中等风险收益水平的混合型基金。
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

注:自2015年10月8日起,本基金增加E类份额,份额日期为2015年10月12日至2015年12月31日。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
中欧行业成长混合(LOF)A	中欧行业成长混合(LOF)B		
1.本期已实现收益	327,007,369.01	88,343.76	
2.期初现金余额	500,000,000.00	2,026.45	-2,233.44
3.期末现金余额本期利润	0.00	0.2374	-0.0039
4.期末可供分配基金份额总额	160,000,000.00		
5.期末可供分配基金份额净值	1,384,263,734.00	765,560.36	

注:自2015年10月8日起,本基金增加E类份额,份额机构为中欧基金管理有限公司。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
曹剑飞	本基金基金经理,中欧行业成长混合型证券投资基金基金经理,投资总监,事业部负责人	2014年08月16日	13年	

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;若该基金经理因基金管理合同生效日起即任职,则任职日期为基金管理合同生效日。

2.报告期内的合计数从行业分类《证券业从业人员执业资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,本基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金资产,本基金持有人对本基金的管理运用基金资产,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的规定,无法违法违纪、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投票权行使情况

4.5 报告期内基金净值表现

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

4.7 其他需要说明的事项

## § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	1,691,471,438.20	65.34
2	基金投资	1,691,471,438.20	65.34
3	股票投资	-	-
4	债券投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	货币市场基金投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	836,400,500.00	34.30
8	其他资产	8,922,792.01	0.37
9	合计	2,422,890,734.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的深股通股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期内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组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合