

中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年03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 报告送出日期:2017年04月21日

81 重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。

82 基金产品概况 基金简称:中欧成长优选混合 场内简称:中欧成长 基金主代码:166020 基金运作方式:契约型、开放式、发起式

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元 3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期末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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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。

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧成长优选混合 E.

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧成长优选混合 E.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较 中欧成长优选混合 A

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧成长优选混合 E.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较 中欧成长优选混合 E

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧成长优选混合 E.

注:自2015年9月22日起,本基金增加E类份额,图示日期为2015年9月25日至2017年3月31日。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Rows for 庄波 and 黄德德.

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任职,则任职日期为基金合同生效日。

4.3 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《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》及公司内相关制度规定,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环节严格控制交易公平执行,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 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金管理人管理的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。

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金管理人管理的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。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 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。

85 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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 4 资产支持证券, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他资产, 9 合计.

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, 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, J 金融业, K 房地产业, 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, 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.

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 本基金本报告期末持有沪港通股票

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 601607 上海医药, 2 000895 双汇发展, 3 600261 阳光照明, 4 600036 招商银行, 5 000848 承德露露, 6 600062 华润双鹤, 7 600887 伊利股份, 8 002557 洽洽食品, 9 000860 顺鑫农业, 10 000001 平安银行.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债, 2 央行票据, 3 金融债, 4 企业债, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计.

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五名债券投资明细 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Row 1 113011 光大转债.

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资产支持证券投资明细 本基金本报告期末持有资产支持证券

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五名贵金属投资明细 本基金本报告期末持有贵金属

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五名权证投资明细 本基金本报告期末持有权证

5.9 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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资国债期货

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资期权

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明细 本基金本报告期末持有股票

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在受争议情况

5.11.6 投资衍生品持仓的其他文字描述部分 本报告期末无

86 开放式基金资产变动 单位:份 报告期初基金份额总额 中欧成长优选混合 A 中欧成长优选混合 E

Table with 4 columns: 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额总额, 报告期间基金份额申购总额, 报告期间基金份额赎回总额. Rows for 中欧成长优选混合 A and 中欧成长优选混合 E.

87 报告期末基金份额持有人户数及持有人数量 报告期末基金份额持有人户数 报告期末基金份额持有人数量

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Row 1 机构.

88 影响投资者决策的其他重要信息 无

89 影响投资者决策的其他重要信息 无

中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF) 2017年第1季度报告 2017年03月31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 报告送出日期:2017年04月21日

81 重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。

82 基金产品概况 基金简称:中欧新趋势混合(LOF) 场内简称:中欧趋势 基金主代码:166001 基金运作方式:契约型上市开放式(LOF)

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元 3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期末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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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。

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧新趋势混合(LOF)E.

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧新趋势混合(LOF)E.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧新趋势混合(LOF)E.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动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)E

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Rows for 过去三个月 and 中欧新趋势混合(LOF)E.

注:自2015年10月8日起本基金增加E类份额,图示日期为2015年10月12日至2017年3月31日。

84 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

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明. Rows for 周蔚文.

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任职,则任职日期为基金合同生效日。

4.2 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

4.3 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《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》及公司内相关制度规定,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环节严格控制交易公平执行,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 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金管理人管理的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。

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金管理人管理的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。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 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。

85 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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 4 资产支持证券, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他资产, 9 合计.

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

类别净值增长率为3.29%,同期业绩比较基准收益率为2.86%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 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。

85 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(%)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元) 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 4 资产支持证券, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产, 7 银行存款和结算备付金合计, 8 其他资产, 9 合计.

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, 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, J 金融业, K 房地产业, 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, 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.

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 本基金本报告期末持有沪港通股票

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 600519 贵州茅台, 2 000858 五粮液, 3 600489 华泰化工, 4 300122 碧水源, 5 000538 云南白药, 6 000272 德化陶瓷, 7 002507 美尚服饰, 8 600643 爱建集团, 9 799994 泰达股份.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债, 2 央行票据, 3 金融债, 4 企业债, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计.

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五名债券投资明细 序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Row 1 120418 12农发18.

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资产支持证券投资明细 本基金本报告期末持有资产支持证券

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五名贵金属投资明细 本基金本报告期末持有贵金属

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五名权证投资明细 本基金本报告期末持有权证

5.9 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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资国债期货

5.11 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资期权

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明细 本基金本报告期末持有股票

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在受争议情况

5.11.6 投资衍生品持仓的其他文字描述部分 本报告期末无

86 开放式基金资产变动 单位:份 报告期初基金份额总额 中欧新趋势混合(LOF)A 中欧新趋势混合(LOF)E

Table with 4 columns: 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额总额, 报告期间基金份额申购总额, 报告期间基金份额赎回总额. Rows for 中欧新趋势混合(LOF)A and 中欧新趋势混合(LOF)E.

87 报告期末基金份额持有人户数及持有人数量 报告期末基金份额持有人户数 报告期末基金份额持有人数量

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Row 1 机构.

88 影响投资者决策的其他重要信息 无

中欧基金管理有限公司 关于新增微众银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

根据中欧基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与深圳前海微众银行股份有限公司(简称“微众银行”)签署的内销协议和相关业务准备情况,本公司决定自2017年4月21日起增加微众银行为下述基金的代销机构,并开通定投业务,费率优惠活动的公告

注:上述基金暂停申购期间,定投业务同时暂停,限制大额申购同样适用。