

**中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）**

**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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 01 月 01 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, 241, 137, 750. 72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（LO<br>F）A     | 中欧新趋势混合（LO<br>F）E |
| 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            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2, 156, 467, 170. 55份 | 84, 670, 580. 17份 |

### 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<br>黎亿海                  | 吴玉婷                |
|         | 联系电话<br>021-68609600       | 021-5269999-212052 |
|         | 电子邮箱<br>liyihai@zofund.com | 015289@cib.com.cn  |
| 客户服务电话  | 021-68609700、400-700-9700  | 95561              |
| 传真      | 021-33830351               | 021-62159217       |

## 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 中欧新趋势混合（LOF）A  |                |                  |
|---------------|----------------|----------------|------------------|
|               | 2017年          | 2016年          | 2015年            |
| 本期已实现收益       | 418,962,512.28 | 174,371,655.14 | 1,271,458,294.75 |
| 本期利润          | 649,854,252.97 | -72,309,371.92 | 1,487,827,910.18 |

|                      |                  |                  |                  |
|----------------------|------------------|------------------|------------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.2435           | -0.0229          | 0.6540           |
| 本期基金份额净值增长率          | 23.86%           | -1.61%           | 61.64%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2017年末           | 2016年末           | 2015年末           |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.2745           | 0.0290           | 0.4795           |
| 期末基金资产净值             | 2,748,427,799.69 | 3,645,917,813.01 | 3,975,946,172.05 |
| 期末基金份额净值             | 1.2745           | 1.0290           | 1.5194           |

| <b>3.1.3 期间数据和指标</b> | 中欧新趋势混合（LOF）E  |                |               |
|----------------------|----------------|----------------|---------------|
|                      | 2017年          | 2016年          | 2015年         |
| 本期已实现收益              | 29,873,665.44  | 12,871,570.05  | 123,127.10    |
| 本期利润                 | 45,919,925.87  | 24,756,469.86  | -1,855,018.66 |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.2662         | 0.1151         | -0.1849       |
| 本期基金份额净值增长率          | 23.82%         | -1.52%         | 18.13%        |
| <b>3.1.4 期末数据和指标</b> | 2017年末         | 2016年末         | 2015年末        |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.2356         | 0.0544         | 0.3821        |
| 期末基金资产净值             | 113,460,976.55 | 240,205,534.01 | 98,531,253.42 |
| 期末基金份额净值             | 1.3400         | 1.0822         | 1.5200        |

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

| 阶段<br>(中欧新趋势混<br>合(LOF) A) | 份额净<br>值增长<br>率① | 份额<br>净值<br>增长<br>率标<br>准差 | 业绩比<br>较基<br>准收<br>益率<br>③ | 业绩比较<br>基<br>准收<br>益率标<br>准差<br>④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------------------|------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------------|-----|-----|
|                            |                  |                            |                            |                                   |     |     |

|           | (2)     |       |        |       |         |       |
|-----------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月     | 7.25%   | 1.09% | 2.75%  | 0.62% | 4.50%   | 0.47% |
| 过去六个月     | 13.10%  | 0.89% | 6.93%  | 0.55% | 6.17%   | 0.34% |
| 过去一年      | 23.86%  | 0.80% | 13.42% | 0.51% | 10.44%  | 0.29% |
| 过去三年      | 96.99%  | 1.77% | 11.53% | 1.35% | 85.46%  | 0.42% |
| 过去五年      | 164.98% | 1.57% | 47.79% | 1.23% | 117.19% | 0.34% |
| 自基金合同生效至今 | 119.91% | 1.61% | 63.66% | 1.46% | 56.25%  | 0.15% |

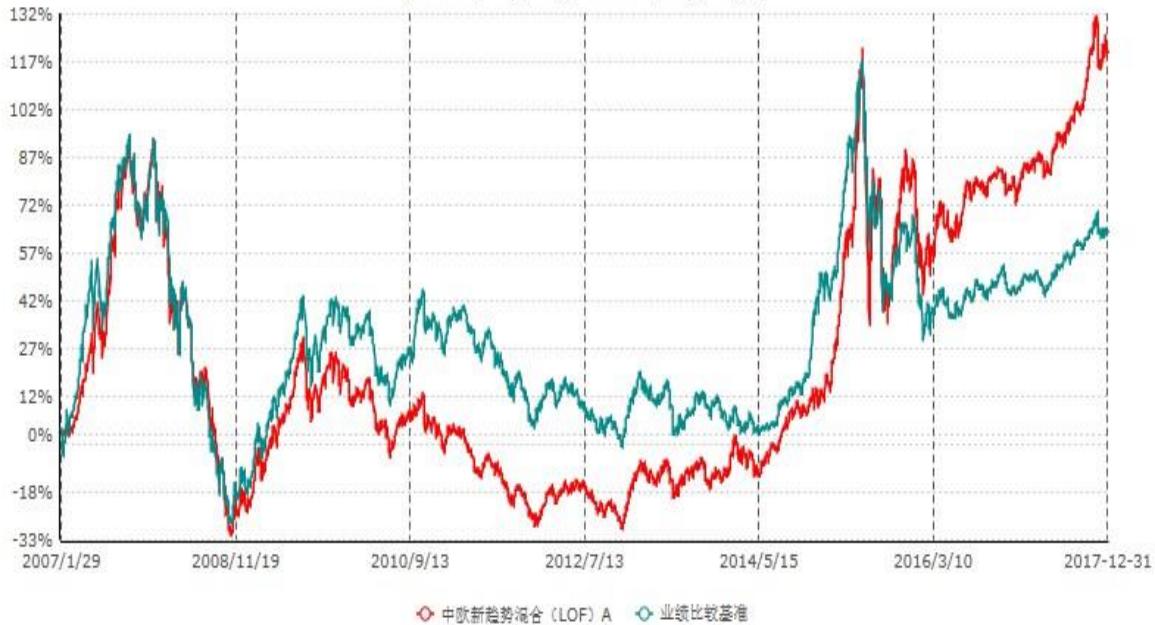
注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A600 指数\*80%+富时中国国债全价指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

| 阶段<br>(中欧新趋势混合(LOF) E) | 份额<br>净值<br>增长<br>率① | 份额<br>净值<br>增长<br>率标<br>准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------------------|----------------------|---------------------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月                  | 7.28%                | 1.09%                           | 2.75%              | 0.62%                 | 4.53%  | 0.47% |
| 过去六个月                  | 13.10%               | 0.89%                           | 6.93%              | 0.55%                 | 6.17%  | 0.34% |
| 过去一年                   | 23.82%               | 0.80%                           | 13.42%             | 0.51%                 | 10.40% | 0.29% |
| 自基金运作日至<br>今           | 44.06%               | 1.24%                           | 10.49%             | 0.96%                 | 33.57% | 0.28% |

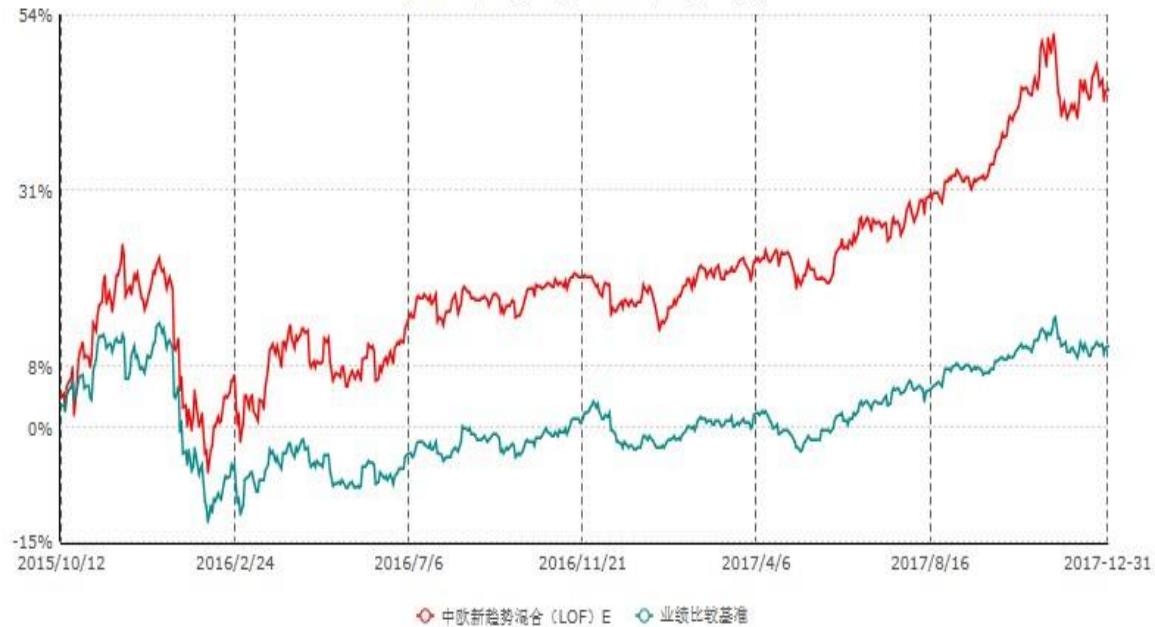
注：本基金业绩比较基准为：富时中国 A600 指数\*80%+富时中国国债全价指数\*20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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  
(2007年01月29日-2017年12月31日)

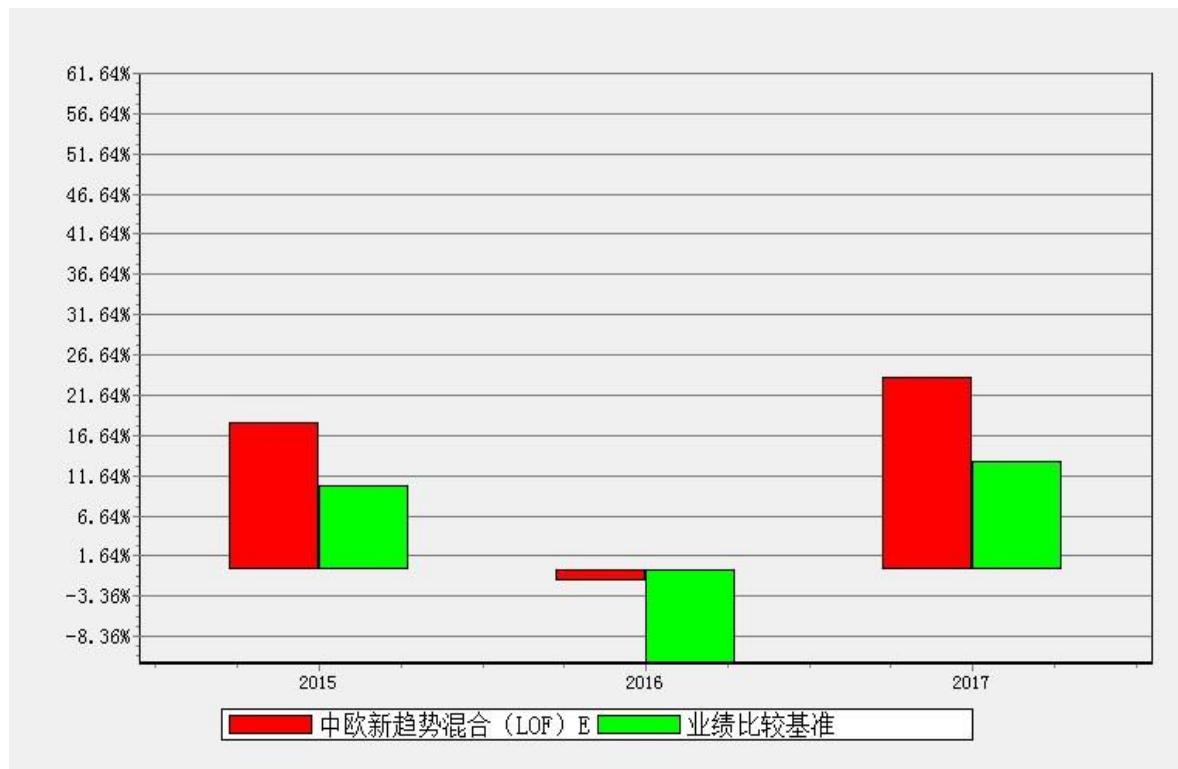
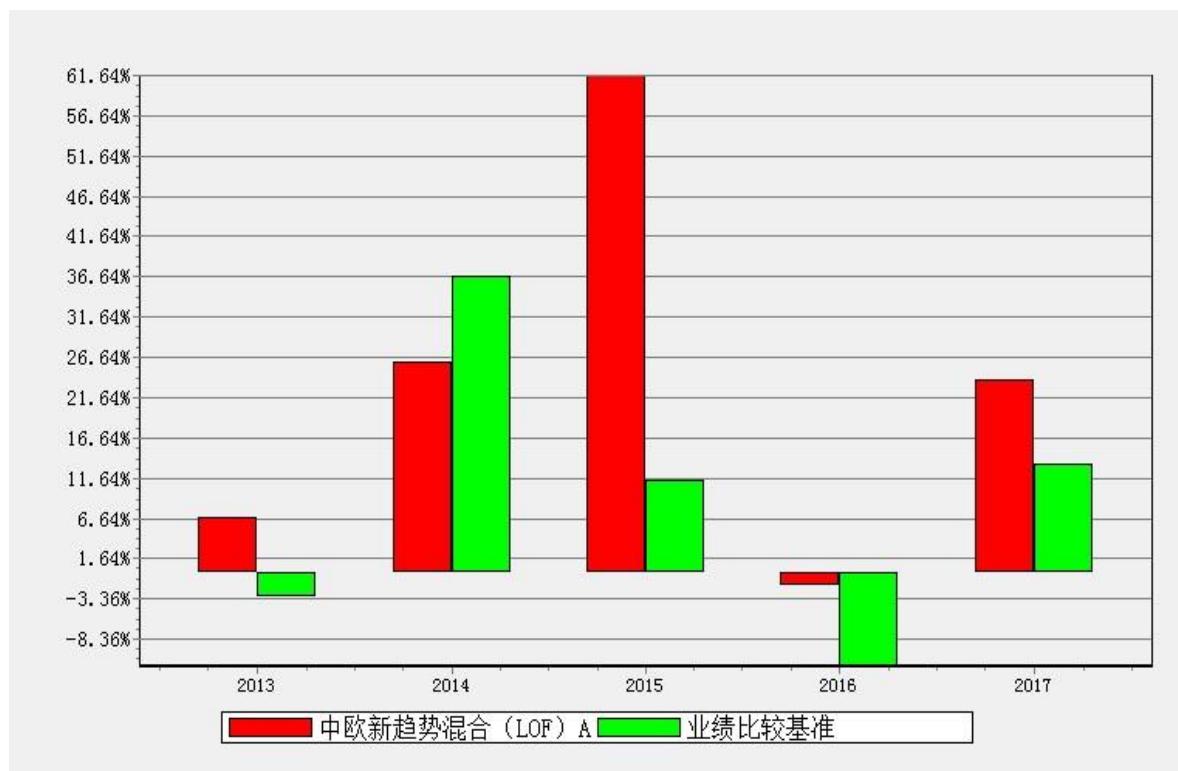


中欧新趋势混合（LOF）E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年10月12日-2017年12月31日)



注：本基金于2015年10月8日新增E类份额，图示日期为2015年10月12日至2017年12月31日。

### 3.2.3 过去五年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:2015 年 10 月 8 日本基金新增 E 类份额,2015 年度数据为 2015 年 10 月 12 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度<br>(中欧<br>新趋势<br>混合<br>(LO<br>F) A) | 每10份<br>基金份<br>额分红<br>数 | 现金形式发放总额         | 再投资形式发放<br>总额  | 年度利润分配合计         | 备注 |
|--|-------------------------|------------------|----------------|------------------|----|
| 2017年                                  | -                       | -                | -              | -                | -  |
| 2016年                                  | 4.32                    | 1,167,387,071.45 | 210,795,095.72 | 1,378,182,167.17 | -  |
| 2015年                                  | -                       | -                | -              | -                | -  |
| 合计                                     | 4.32                    | 1,167,387,071.45 | 210,795,095.72 | 1,378,182,167.17 | -  |

单位：人民币元

| 年度<br>(中欧新<br>趋势混<br>合 (LO<br>F) E) | 每10份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形式发放总<br>额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|-------------------------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2017年                               | -                   | -             | -             | -             | -  |
| 2016年                               | 3.87                | 85,193,748.04 | 272,807.93    | 85,466,555.97 | -  |
| 2015年                               | -                   | -             | -             | -             | -  |
| 合计                                  | 3.87                | 85,193,748.04 | 272,807.93    | 85,466,555.97 | -  |

## § 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 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-----------|-----|----|
|    |    |           |     |    |

|     |                  | (助理) 期限    |      | 业年限 |   |
|-----|------------------|------------|------|-----|---|
|     |                  | 任职日期       | 离任日期 |     |   |
| 凌莉  | 基金经理助理           | 2017-03-23 | -    | 9   | 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  | 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遵规守信情况的说明

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非公平交易的情况。

#### 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

回顾2017年，宏观经济的增长情况略超我们年初预期，不过这不是影响2017年的A股的主要因素。政策导致资金分化是使A股二八分化大大超出大家预计的主要原因。一方面，沪股通、深股通使长期P/E偏低、经营竞争力强、业绩增长持续的龙头公司的股票不断得到境外资金增持；另一方面，新股发行加速、重组审核趋严、过去几年并购资产开始露出真相，使得2016年已跌了一年的绝大多数中小股票继续被境内投资者抛弃，从价值的角度看，这些股票大多数直到目前也很难说有绝对投资价值。在2017年一年的分化中，我们有受益的部分也有受损的部分。受益的部分是我们抓住了以茅台、五粮液为代表的白酒行业投资机会，抓住了以中国平安为代表的保险行业投资机会。受损的是我们有一些中小股票在买入时其估值是A股多年来的平均水平附近，股市持续分化的结果是尽管业绩符合预期，股价继续下跌、估值已明显低于类似股票A股多年平均水平。受损的另外一个方面是我们总担心地产销售面积增长的持续性，没有抓住房地产产业链的投资机会。

#### 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23.86%，同期业绩比较基准增长率为13.42%；E类份额净值增长率为23.82%，同期业绩比较基准率为13.42%。

### 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，从宏观经济、股票估值、市场资金面三个角度综合来看，A股市场未来一年总体指数机会平平，存在部分结构性机会。

宏观经济方面，如果说2017年经济增长率是略超预期的话，那么2018年可能略低于大家年初的预期。我们的经济整体还处于新旧动能转换过程中，2016、2017年地产、基建、大宗商品的传统行业作为旧动能代表，增长较好，但2017年下半年地产销售面积已不增长了，2018年估计增长率更低。新动能方面，移动互联网产业发展的高速增长期已过，物联网、自动驾驶、人工智能还处于低基数阶段，对宏观经济的贡献不大。2017年经济略超预期的另外一个原因是出口的强劲，2018年海外经济还将维持较好的增长势头，但增长率难以进一步提高，因此出口增长率也难以明显提高。

股票估值方面，尽管大多数股票在2017年下跌，但目前市场总体估值与2017年是变化不大的，明显下降的是创业板估值。考虑到金融去杠杆、国际、国内市场利率上升、宏观增长趋缓的背景，A股难以有大量新增资金，股市估值提高的可能性不大。

因此在金融去杠杆的政策缓和之前、在市场利率下来之前，2018年的股市难以有明显的指数机会，有的只是结构性机会。以创业板为代表的涉及新兴产业的公司，大多数是靠并购来的新兴产业资产，竞争力强的不多，收购时利润承诺一般偏高，尽管其股价离最高点已跌去大半，但未来大多数这类股票还将继续面临去伪存真的风险，极少部分不靠并购、内生成长性好、行业好转的股票将持续成长，存在长期投资机会。传统产业大多数公司业绩在2017年大幅增长，估值不高，但行业景气持续时间需要认真判断，存在中短期投资机会。以医药、保险为代表的消费行业，市场空间巨大，有不少优秀的公司，其股票估值处于A股历史平均估值附近，存在中长期投资机会。银行、地产行业股票估值不高，经营平稳，存在一定的投资机会。

我们将深入研究，精选行业，寻找存在明显的行业投资逻辑的中长期机会，在合适的价格买入受益行业好转而业绩高增长的股票，尽力创造更大的超额收益率。

#### 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历。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元的情形。

### § 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

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。

#### 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

本托管人认真复核了本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 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年

度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-----------------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b>      |                    |                     |
| 银行存款            | 196,931,109.08     | 66,380,911.37       |
| 结算备付金           | 6,777,841.15       | 49,230,109.13       |
| 存出保证金           | 1,137,518.87       | 1,616,647.48        |
| 交易性金融资产         | 2,260,670,393.97   | 3,520,536,992.89    |
| 其中：股票投资         | 2,249,630,493.97   | 3,319,396,992.89    |
| 基金投资            | —                  | —                   |
| 债券投资            | 11,039,900.00      | 201,140,000.00      |
| 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        | 429,700,000.00     | 303,500,305.25      |
| 应收证券清算款         | 19,915,685.55      | 18,197,483.81       |
| 应收利息            | -66,638.08         | 685,719.62          |
| 应收股利            | —                  | —                   |
| 应收申购款           | 1,067,176.85       | 146,012.08          |
| 递延所得税资产         | —                  | —                   |
| 其他资产            | —                  | —                   |
| 资产总计            | 2,916,133,087.39   | 3,960,294,181.63    |
| <b>负债和所有者权益</b> | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
| <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       | 46,862,960.23    | 7,902,214.15     |
| 应付赎回款         | 770,834.00       | 55,937,526.60    |
| 应付管理人报酬       | 3,355,048.30     | 5,358,524.28     |
| 应付托管费         | 559,174.71       | 893,087.38       |
| 应付销售服务费       | -                | -                |
| 应付交易费用        | 1,208,764.52     | 2,439,515.25     |
| 应交税费          | -                | -                |
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 1,487,529.39     | 1,639,966.95     |
| 负债合计          | 54,244,311.15    | 74,170,834.61    |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 2,241,137,750.72 | 3,764,958,990.80 |
| 未分配利润         | 620,751,025.52   | 121,164,356.22   |
| 所有者权益合计       | 2,861,888,776.24 | 3,886,123,347.02 |
| 负债和所有者权益总计    | 2,916,133,087.39 | 3,960,294,181.63 |

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额总额2,241,137,750.72份。其中A类基金份额净值1.2745元，基金份额总额2,156,467,170.55份；E类基金份额净值1.3400元，基金份额总额84,670,580.17份。

## 7.2 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：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期2017年01月01日至2017年12月31 | 上年度可比期间 |
|----|--------------------------|---------|
|----|--------------------------|---------|

|                        | 日                 | 2016年01月01日至2016年12月31日 |
|------------------------|-------------------|-------------------------|
| <b>一、收入</b>            | 765, 606, 254. 07 | 36, 946, 537. 80        |
| 1. 利息收入                | 19, 810, 192. 66  | 18, 098, 481. 37        |
| 其中：存款利息收入              | 1, 710, 434. 15   | 7, 180, 299. 75         |
| 债券利息收入                 | 7, 431, 701. 86   | 3, 549, 400. 70         |
| 资产支持证券利息收入             | —                 | —                       |
| 买入返售金融资产收入             | 10, 668, 056. 65  | 7, 368, 780. 92         |
| 其他利息收入                 | —                 | —                       |
| 2. 投资收益（损失以“-”号填列）     | 495, 624, 138. 42 | 252, 305, 950. 17       |
| 其中：股票投资收益              | 470, 993, 515. 38 | 233, 266, 200. 75       |
| 基金投资收益                 | —                 | —                       |
| 债券投资收益                 | -2, 159, 200. 00  | -1, 696, 515. 09        |
| 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                   | 26, 789, 823. 04  | 20, 736, 264. 51        |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 246, 938, 001. 12 | -234, 796, 127. 25      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | —                 | —                       |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 3, 233, 921. 87   | 1, 338, 233. 51         |
| <b>减：二、费用</b>          | 69, 832, 075. 23  | 84, 499, 439. 86        |
| 1. 管理人报酬               | 48, 171, 083. 67  | 59, 480, 900. 67        |
| 2. 托管费                 | 8, 028, 513. 95   | 9, 913, 483. 44         |
| 3. 销售服务费               | —                 | —                       |
| 4. 交易费用                | 13, 138, 923. 83  | 14, 507, 771. 48        |

|                            |                          |                          |
|----------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 5. 利息支出                    | -                        | -                        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                        | -                        |
| 6. 其他费用                    | 493, 553. 78             | 597, 284. 27             |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | <b>695, 774, 178. 84</b> | <b>-47, 552, 902. 06</b> |
| 减：所得税费用                    | -                        | -                        |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | <b>695, 774, 178. 84</b> | <b>-47, 552, 902. 06</b> |

### 7.3 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：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2017年01月01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)                        | 3, 764, 958, 99<br>0. 80      | 121, 164, 356. 2<br>2 | 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)               | -                             | 695, 774, 178. 8<br>4 | 695, 774, 178. 84         |
| 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, 523, 821, 24<br>0. 08     | -196, 187, 509.<br>54 | -1, 720, 008, 749. 6<br>2 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1, 431, 606, 44<br>9. 24      | 226, 419, 935. 9<br>2 | 1, 658, 026, 385. 16      |
| 2. 基金赎回款                               | -2, 955, 427, 68<br>9. 32     | -422, 607, 445.<br>46 | -3, 378, 035, 134. 7<br>8 |
| 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, 241, 137, 75<br>0. 72      | 620, 751, 025. 5<br>2 | 2, 861, 888, 776. 24      |
| 项 目                                    | 上年度可比期间                       |                       |                           |

|  | 2016年01月01日至2016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)<br>值)                  | 2,681,607.54<br>1.96    | 1,392,869.88<br>3.51 | 4,074,477,425.47  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                       | -47,552,902.06       | -47,552,902.06    |
| 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)      | 1,083,351.44<br>8.84    | 239,496,097.91       | 1,322,847,546.75  |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,565,111.71<br>2.86    | 526,102,834.19       | 3,091,214,547.05  |
| 2.基金赎回款                                | -1,481,760.26<br>4.02   | -286,606,736.28      | -1,768,367,000.30 |
| 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) | -                       | -1,463,648,723.14    | -1,463,648,723.14 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 3,764,958.99<br>0.80    | 121,164,356.22       | 3,886,123,347.02  |

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。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。

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)。

根据基金管理人中欧基金管理有限公司2015年10月8日《关于旗下部分开放式基金增加E类份额并相应修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2015年10月8日起对本基金增加E类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为A类基金份额，新增的基金份额类别命名为E类基金份额。A类基金份额的业务规则与现行规则相同；新增E类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司，只接受场外申赎，不参与上市交易。

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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4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。

#### **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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 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 |
| 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     |
| 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投资管理（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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |              |
|-------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                          | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国都证券  | -                             | -            | 73,457,932.06                      | 0.76%        |

###### 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<br>2017年01月01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  | -                                  | -          | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016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 | 68,411.84 | 0.76%      | -        | -            |

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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |                | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |                |
|-------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国都证券  | -                             | -              | 920,000.00<br>0.00                 | 1.48%          |

#### 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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 48,171,083.67                 | 59,480,900.67                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,570,714.73                  | 2,196,917.09                       |

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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2017年01月01日至2017年12月31日 | 2016年01月01日至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,028,513.95            | 9,913,483.44            |

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。

### 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                      |                       | 上年度可比期间                 |                       |
|---------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                     | 2017年01月01日至2017年12月31日 |                       | 2016年01月01日至2016年12月31日 |                       |
|                     | 中欧新趋势<br>混合（LOF）<br>A   | 中欧新趋势<br>混合（LOF）<br>E | 中欧新趋势<br>混合（LOF）<br>A   | 中欧新趋势<br>混合（LOF）<br>E |
| 报告期初持有的基金份额         | —                       | 149,943.01            | —                       | 108,036.59            |
| 报告期内申购/买入总份额        | —                       | —                     | —                       | 41,906.42             |
| 报告期内因拆分变动份额         | —                       | —                     | —                       | —                     |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额      | —                       | —                     | —                       | —                     |
| 报告期内持有的基金份额         | —                       | 149,943.01            | —                       | 149,943.01            |
| 报告期内持有的基金份额占基金总份额比例 | —                       | 0.18%                 | —                       | 0.07%                 |

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。

#### 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

## 中欧新趋势混合（LOF）A

| 关联方名称 | 本期末<br>2017年12月31日 |                          | 上年度末<br>2016年12月31日 |                          |
|-------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|       | 持有的基金份<br>额        | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金份<br>额         | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 自然人股东 | 42,443.98          | 0.00%                    | -                   | -                        |

## 中欧新趋势混合（LOF）E

| 关联方名称 | 本期末<br>2017年12月31日 |                          | 上年度末<br>2016年12月31日 |                          |
|-------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|       | 持有的基金份<br>额        | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金份<br>额         | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 自然人股东 | 87,618.66          | 0.10%                    | -                   | -                        |

注：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0.0020%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

## 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<br>2017年01月01日至2017年12<br>月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12<br>月31日 |                  |
|------------|-----------------------------------|------------------|--|------------------|
|            | 期末余额                              | 当期利息收<br>入       | 期末余额                                   | 当期利息收<br>入       |
| 兴业银行股份有限公司 | 196,931,10<br>9.08                | 1,121,106.<br>80 | 66,380,911.3<br>7                      | 6,659,711.8<br>6 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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

金额单位：人民币元

| 7.4.9.1.1 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 |
| 300664              | 鹏鹞环保 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 未上市    | 8.88  | 8.88   | 3,640    | 32,300    | 32,300    | -  |
| 603161              | 科华控股 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 未上市    | 16.75 | 16.75  | 1,239    | 20,753.25 | 20,753.25 | -  |
| 002923              | 润都股份 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 未上市    | 17.01 | 17.01  | 954      | 16,27.54  | 16,27.54  | -  |
| 603080              | 新疆火炬 | 2017-12-25 | 2018-01-03 | 未上市    | 13.60 | 13.60  | 1,187    | 16,143.20 | 16,143.20 | -  |

### 7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

| 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：张) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 123003 | 蓝思转债 | 2017-12-08 | 2018-01-17 | 未上市    | 100.00 | 100.00 | 65,452   | 6,545,200.00 | 6,545,200.00 | -  |
| 128024 | 宁行转债 | 2017-12-05 | 2018-01-12 | 未上市    | 100.00 | 100.00 | 44,947   | 4,494,700.00 | 4,494,700.00 | -  |

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|      |      |      |      |        |      |        |       |        |        |    |

|            |          |                    |                |            |                    |            |     |                     |                     |   |
|------------|----------|--------------------|----------------|------------|--------------------|------------|-----|---------------------|---------------------|---|
| 3007<br>30 | 科创<br>信息 | 2017<br>-12-<br>25 | 交易<br>异常<br>波动 | 41. 5<br>5 | 2018<br>-01-<br>02 | 45. 7<br>1 | 821 | 6, 86<br>3. 56      | 34, 1<br>12. 5<br>5 | - |
| 0029<br>19 | 名臣<br>健康 | 2017<br>-12-<br>28 | 交易<br>异常<br>波动 | 35. 2<br>6 | 2018<br>-01-<br>02 | 38. 7<br>9 | 821 | 10, 3<br>11. 7<br>6 | 28, 9<br>48. 4<br>6 | - |

注：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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2,249,481,985.77元，属于第二层次的余额为11,188,408.20元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次3,318,926,715.35元，第二层次201,610,277.54元，无属于第三层次的余额)。

###### (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(2016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。

## (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。

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日的财务状况和2017年度的经营成果无影响。

(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              | 2, 249, 630, 493. 97 | 77. 14       |
|    | 其中：股票             | 2, 249, 630, 493. 97 | 77. 14       |
| 2  | 基金投资              | -                    | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 11, 039, 900. 00     | 0. 38        |
|    | 其中：债券             | 11, 039, 900. 00     | 0. 38        |
|    | 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          | 429, 700, 000. 00    | 14. 74       |
|    | 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      | 203, 708, 950. 23    | 6. 99        |
| 8  | 其他各项资产            | 22, 053, 743. 19     | 0. 76        |
| 9  | 合计                | 2, 916, 133, 087. 39 | 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              | 1, 472, 095, 175. 94 | 51. 44       |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16, 143. 20          | 0. 00        |
| E  | 建筑业              | -                    | -            |
| F  | 批发和零售业           | 147, 897, 157. 69    | 5. 17        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17, 957. 94          | 0. 00        |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                    | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34, 112. 55          | 0. 00        |
| J  | 金融业              | 568, 482, 237. 85    | 19. 86       |
| K  | 房地产业             | -                    | -            |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 61,055,385.60    | 2.13  |
| M | 科学研究和技术服务业    | -                | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 32,323.20        | 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       | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 2,249,630,493.97 | 78.61 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告本期末未持有沪港通股票投资。

### 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  | 601318 | 中国平安 | 3,283,223 | 229,759,945.54 | 8.03         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 2,396,311 | 191,417,322.68 | 6.69         |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 2,233,171 | 156,768,604.20 | 5.48         |
| 4  | 000661 | 长春高新 | 829,872   | 151,866,576.00 | 5.31         |
| 5  | 601601 | 中国太保 | 2,920,001 | 120,946,441.42 | 4.23         |
| 6  | 000538 | 云南白药 | 1,188,032 | 120,929,777.28 | 4.23         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 161,132   | 112,387,958.68 | 3.93         |
| 8  | 300433 | 蓝思科技 | 3,569,801 | 106,558,559.8  | 3.72         |

|    |        |      |            |                    |      |
|----|--------|------|------------|--------------------|------|
|    |        |      |            | 5                  |      |
| 9  | 002185 | 华天科技 | 11,878,598 | 101,205,654.9<br>6 | 3.54 |
| 10 | 600498 | 烽火通信 | 3,318,445  | 95,670,769.35      | 3.34 |

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  | 601318 | 中国平安 | 195,468,391.51 | 5.03           |
| 2  | 601997 | 贵阳银行 | 195,182,570.63 | 5.02           |
| 3  | 000538 | 云南白药 | 144,032,025.74 | 3.71           |
| 4  | 601336 | 新华保险 | 130,224,066.41 | 3.35           |
| 5  | 600498 | 烽火通信 | 121,064,192.19 | 3.12           |
| 6  | 000709 | 河钢股份 | 118,457,240.34 | 3.05           |
| 7  | 002027 | 分众传媒 | 115,085,331.54 | 2.96           |
| 8  | 300433 | 蓝思科技 | 110,610,871.20 | 2.85           |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 101,356,793.18 | 2.61           |
| 10 | 002185 | 华天科技 | 94,821,673.69  | 2.44           |
| 11 | 603993 | 洛阳钼业 | 91,899,471.53  | 2.36           |
| 12 | 603626 | 科森科技 | 85,551,877.89  | 2.20           |
| 13 | 600595 | 中孚实业 | 84,650,544.19  | 2.18           |
| 14 | 600742 | 一汽富维 | 83,191,600.05  | 2.14           |
| 15 | 601100 | 恒立液压 | 81,482,647.32  | 2.10           |
| 16 | 000581 | 威孚高科 | 80,189,093.23  | 2.06           |
| 17 | 600976 | 健民集团 | 79,464,741.33  | 2.04           |
| 18 | 600266 | 北京城建 | 77,761,624.80  | 2.00           |
| 19 | 002142 | 宁波银行 | 77,010,357.40  | 1.98           |
| 20 | 600219 | 南山铝业 | 74,570,811.76  | 1.92           |

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

#### 8.4.2 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  | 600519 | 贵州茅台 | 353,516,683.27 | 9.10           |
| 2  | 600409 | 三友化工 | 240,316,348.99 | 6.18           |
| 3  | 600970 | 中材国际 | 181,332,061.45 | 4.67           |
| 4  | 002507 | 涪陵榨菜 | 179,239,152.35 | 4.61           |
| 5  | 300122 | 智飞生物 | 177,188,756.07 | 4.56           |
| 6  | 601997 | 贵阳银行 | 172,718,096.05 | 4.44           |
| 7  | 600643 | 爱建集团 | 154,235,145.59 | 3.97           |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 144,592,441.59 | 3.72           |
| 9  | 002223 | 鱼跃医疗 | 134,185,172.32 | 3.45           |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 133,727,183.48 | 3.44           |
| 11 | 002041 | 登海种业 | 128,579,611.26 | 3.31           |
| 12 | 000709 | 河钢股份 | 115,202,231.91 | 2.96           |
| 13 | 603993 | 洛阳钼业 | 107,088,616.75 | 2.76           |
| 14 | 600683 | 京投发展 | 98,364,208.40  | 2.53           |
| 15 | 300144 | 宋城演艺 | 98,044,577.94  | 2.52           |
| 16 | 600595 | 中孚实业 | 92,637,734.91  | 2.38           |
| 17 | 600109 | 国金证券 | 92,319,135.20  | 2.38           |
| 18 | 002321 | 华英农业 | 91,623,455.13  | 2.36           |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 87,747,584.48  | 2.26           |
| 20 | 000983 | 西山煤电 | 83,720,900.84  | 2.15           |
| 21 | 600502 | 安徽水利 | 82,983,858.01  | 2.14           |
| 22 | 600276 | 恒瑞医药 | 82,762,276.23  | 2.13           |
| 23 | 002672 | 东江环保 | 82,673,461.13  | 2.13           |
| 24 | 000996 | 中国中期 | 81,980,284.88  | 2.11           |
| 25 | 603626 | 科森科技 | 80,806,830.32  | 2.08           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 26 | 000581 | 威孚高科 | 78,691,742.68 | 2.02 |
|----|--------|------|---------------|------|

#### 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 | 3,136,071,215.77 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,922,750,031.19 |

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

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) | 11,039,900.00 | 0.39         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 11,039,900.00 | 0.39         |

#### 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

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  | 123003 | 蓝思转债 | 65,452 | 6,545,200.00 | 0.23         |
| 2  | 128024 | 宁行转债 | 44,947 | 4,494,700.00 | 0.16         |

#### 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**  
股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### **8.10.2 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。

**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   | 1,137,518.87  |
| 2  | 应收证券清算款 | 19,915,685.55 |
| 3  | 应收股利    | -             |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息  | -66,638.08    |
| 5 | 应收申购款 | 1,067,176.85  |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 22,053,743.19 |

#### 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

| 份额<br>级别                      | 持<br>有<br>人户<br>数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构                |                |                    |                |
|-------------------------------|--------------------------|---------------|----------------------|----------------|--------------------|----------------|
|                               |                          |               | 机构投资者                |                | 个人投资者              |                |
|                               |                          |               | 持有份额                 | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额               | 占总<br>份额<br>比例 |
| 中欧<br>新趋<br>势混<br>合(L<br>OF)A | 79,08<br>6               | 27,267.37     | 1,435,564.22<br>7.42 | 66.5<br>7%     | 720,902,943.1<br>3 | 33.4<br>3%     |

|                                |            |            |                      |            |                    |            |
|--------------------------------|------------|------------|----------------------|------------|--------------------|------------|
| 中欧<br>新趋<br>势混<br>合(L<br>OF) E | 240        | 352,794.08 | 64,702,909.25        | 76.4<br>2% | 19,967,670.92      | 23.5<br>8% |
| 合计                             | 79,32<br>6 | 28,252.25  | 1,500,267,13<br>6.67 | 66.9<br>4% | 740,870,614.0<br>5 | 33.0<br>6% |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                    | 持有份额<br>(份)      | 占上市总份额<br>比例(%) |
|----|--------------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 云南国际信托有限公司—笙岚集合资金信托计划    | 4,452,56<br>9.00 | 13.87           |
| 2  | 云南国际信托有限公司—云霞17期集合资金信托计划 | 600,948.0<br>0   | 1.87            |
| 3  | 欧阳钢                      | 495,198.0<br>0   | 1.54            |
| 4  | 罗颖                       | 351,270.0<br>0   | 1.09            |
| 5  | 方德春                      | 328,751.0<br>0   | 1.02            |
| 6  | 北京瑞和投资咨询有限责任公司           | 288,507.0<br>0   | 0.90            |
| 7  | 黄伟民                      | 260,000.0<br>0   | 0.81            |
| 8  | 梁勇                       | 240,282.0<br>0   | 0.75            |
| 9  | 张艳                       | 208,879.0<br>0   | 0.65            |
| 10 | 罗惠仪                      | 201,957.0<br>0   | 0.63            |

注：以上均为中欧新趋势混合(LOF)A的场内持有人。

### 9.3 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<br>(份) | 占基金总份<br>额比例 |
|----------------------|-------------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持<br>有本基金 | 中欧新趋势混合（LO<br>F）A | 164,662.57    | 0.01%        |
|                      | 中欧新趋势混合（LO<br>F）E | 5,831,757.67  | 6.89%        |
|                      | 合计                | 5,996,420.24  | 0.27%        |

### 9.4 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<br>间（万份） |
|--|-------------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资<br>和研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 中欧新趋势混合（L<br>OF）A | 0~10                  |
|  | 中欧新趋势混合（L<br>OF）E | >100                  |
|  | 合计                | >100                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 中欧新趋势混合（L<br>OF）A | 0                     |
|  | 中欧新趋势混合（L<br>OF）E | >100                  |
|  | 合计                | >100                  |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 中欧新趋势混合（LOF）<br>A | 中欧新趋势混合（LOF）<br>E |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2007年01月29<br>日)基金份额总额 | 6,874,704,054.16  | -                 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 3,542,996,088.52  | 221,962,902.28    |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,410,688,567.13  | 20,917,882.11     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 2,797,217,485.10  | 158,210,204.22    |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                 | -                 |

|              |                  |               |
|--------------|------------------|---------------|
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,156,467,170.55 | 84,670,580.17 |
|--------------|------------------|---------------|

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。

## § 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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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110,000.00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<br>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<br>股票成<br>交总额<br>比例 | 佣金        | 占当期<br>佣金总<br>量的比<br>例 |    |
|      |            |      |                         |           |                        |    |

|      |   |                  |        |              |        |   |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 国金证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 国信证券 | 1 | 15,713,748.51    | 0.20%  | 14,633.36    | 0.20%  | - |
| 中银国际 | 1 | 837,225,193.56   | 10.39% | 779,710.99   | 10.39% | - |
| 长城证券 | 1 | 172,636,972.88   | 2.14%  | 160,775.82   | 2.14%  | - |
| 瑞银证券 | 1 | 1,163,914,409.71 | 14.45% | 1,083,957.36 | 14.45% | - |
| 海通证券 | 1 | 118,338,648.62   | 1.47%  | 110,208.42   | 1.47%  | - |
| 国海证券 | 1 | 15,921,789.28    | 0.20%  | 14,828.83    | 0.20%  | - |
| 长江证券 | 1 | 1,602,739,426.46 | 19.90% | 1,492,633.96 | 19.90% | - |
| 招商证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 西部证券 | 1 | 1,820,504,431.73 | 22.60% | 1,695,435.51 | 22.60% | - |
| 申银万国 | 1 | 104,032,795.25   | 1.29%  | 96,885.34    | 1.29%  | - |
| 光大证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中金公司 | 1 | 984,521,486.10   | 12.22% | 916,890.09   | 12.22% | - |
| 中信证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 337,346,112.29   | 4.19%  | 314,170.98   | 4.19%  | - |
| 东方证券 | 1 | 201,337,111.94   | 2.50%  | 187,505.95   | 2.50%  | - |
| 银河证券 | 1 | 223,032,031.44   | 2.77%  | 207,705.80   | 2.77%  | - |
| 广发证券 | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 华泰证券 | 2 | 457,648,005.30   | 5.68%  | 426,207.76   | 5.68%  | - |
| 国都证券 | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中信建投 | 2 | -                | -      | -            | -      | - |

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我公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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

### 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   | 占当期 | 成交金    | 占当期 | 成交   | 占当期 | 成交   | 占当期 |
|      |      |     |        |     |      |     |      |     |

|      | 金额 | 债券成<br>交总量<br>的比例 | 额                         | 债券回<br>购交易<br>成交总<br>额的比<br>例 | 金额 | 权证交<br>易成交<br>总额的<br>比例 | 金额 | 基金交<br>易成交<br>总额的<br>比例 |
|------|----|-------------------|---------------------------|-------------------------------|----|-------------------------|----|-------------------------|
| 国金证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 国信证券 | -  | -                 | 2,750,0<br>00,000.<br>00  | 4.47%                         | -  | -                       | -  | -                       |
| 中银国际 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 长城证券 | -  | -                 | 1,490,0<br>00,000.<br>00  | 2.42%                         | -  | -                       | -  | -                       |
| 瑞银证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 海通证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 国海证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 长江证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 招商证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 西部证券 | -  | -                 | 24,277,<br>300,00<br>0.00 | 39.49%                        | -  | -                       | -  | -                       |
| 申银万国 | -  | -                 | 930,00<br>0,000.0<br>0    | 1.51%                         | -  | -                       | -  | -                       |
| 光大证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 中金公司 | -  | -                 | 20,265,<br>000,00<br>0.00 | 32.97%                        | -  | -                       | -  | -                       |
| 中信证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |
| 齐鲁证券 | -  | -                 | 3,680,0<br>00,000.<br>00  | 5.99%                         | -  | -                       | -  | -                       |
| 东方证券 | -  | -                 | -                         | -                             | -  | -                       | -  | -                       |

|      |   |   |                  |       |   |   |   |   |
|------|---|---|------------------|-------|---|---|---|---|
| 银河证券 | - | - | 2,420,000,000.00 | 3.94% | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | -                | -     | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | 5,660,000,000.00 | 9.21% | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | -                | -     | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | -                | -     | - | - | - | - |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2017年1<br>2月25日        | 354,528,145.1<br>3 | 50,543,443.1<br>0 | 8,505,493.08 | 396,566,095.1<br>5 | 17.6<br>9% |
| 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，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。

### 12.2 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  
二〇一八年三月三十日