

# 中欧新动力混合型证券投资基金（LOF） 更新招募说明书摘要

（2015年第2号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司  
基金托管人：中国光大银行股份有限公司

二〇一五年九月

## 重要提示

本基金经 2010 年 11 月 17 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2010]1646 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2011 年 2 月 10 日正式生效，其中股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 60%~95%。根据原《证券投资基金运作管理办法》规定，本基金为股票型证券投资基金。根据 2014 年 8 月 8 日修订后施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例要求由原来的“百分之六十以上”调整为“百分之八十以上”。基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为混合型证券投资基金，《基金合同》中的相关条款亦做相应修订。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日 2015 年 8 月 9 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、基金管理人.....	5
二、基金托管人.....	9
三、相关服务机构.....	11
四、基金的名称.....	28
五、基金的类型.....	28
六、基金的投资目标.....	29
七、基金的投资方向.....	29
八、基金的投资策略.....	29
九、基金的业绩比较基准.....	33
十、基金的风险收益特征.....	33
十一、基金的投资组合报告.....	33
十二、基金的业绩.....	38
十三、基金的费用与税收.....	39
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	41

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
3. 办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
4. 法定代表人：窦玉明
5. 组织形式：有限责任公司
6. 成立日期：2006年7月19日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：袁维
13. 客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.88亿元人民币
15. 股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资6,580万元人民币，占公司注册资本的35%；

国都证券股份有限公司出资3760万元人民币，占公司注册资本的20%；

北京百骏投资有限公司出资3760万元人民币，占公司注册资本的20%；

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资3,760万元人民币，占公司注册资本的20%；

万盛基业投资有限责任公司出资940万元人民币，占公司注册资本的5%；

上述5个股东共出资18,800万元人民币。

### （二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

**窦玉明先生**，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，民航投资管理有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

**Marco D' Este 先生**，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credito Italiano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

**朱鹏举先生**，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都证券股份有限公司投资银行总部业务董事、投资银行业务内核小组副组长，兼任国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司、大连柏荣工程技术有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理。

**刘建平先生**，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

**David Youngson 先生**，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员、中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

**郭雳先生**，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理、中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

## 2. 基金管理人监事会成员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证

券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

**廖海先生**，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

**黎忆海女士**，中欧基金管理有限公司职工监事，监察稽核部总监，中国籍。南开大学会计学专业硕士。历任湖南省计算机高等专科学校教师，深圳世纪星源股份有限公司财务分析师，华富基金管理有限公司监察稽核员。

**黄峰先生**，中欧基金管理有限公司职工监事，信息技术部总监，中国籍。北京大学信息科学中心信号与信息处理专业硕士。历任中再资产管理有限公司信息技术部主管，海通证券股份有限公司项目经理，微软全球技术中心工程师。

### 3. 公司高级管理人员

**窦玉明先生**，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍，简历同上。

**刘建平先生**，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍，简历同上。

**卢纯青女士**，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，10年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

**许欣先生**，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，13年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

**黄桦先生**，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，24年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司

信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

#### 4. 本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

**袁争光先生**，中欧中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。上海财经大学金融学专业硕士，9年以上证券从业经验。历任上海金信证券研究所有限责任公司研究员，中原证券股份有限公司证券研究所研究员，光大保德信基金管理有限公司研究员，中欧基金管理有限公司研究员、高级研究员、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧货币市场基金基金经理助理、中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理（2013年1月31日起至2015年5月25日）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理（2013年4月11日起至2015年5月18日）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理（2014年5月7日起至2015年7月13日）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理（2014年5月7日起至2015年5月25日）。现任中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2015年5月29日起至今）、中欧价值智选回报混合型证券投资基金基金经理（2015年5月29日起至今）。

##### （2）历任基金经理

**苟开红女士**，于2011年2月10日至2015年5月29日期间担任中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 5. 公司投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、曹剑飞、刘明月、周玉雄、赵国英、曲径，风控部总监卞玺云组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。



## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司（简称“中国光大银行”）  
住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心  
法定代表人：唐双宁  
成立时间：1992年8月18日  
组织形式：股份有限公司  
注册资本：404.3479亿元人民币  
存续期间：持续经营  
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[2002]75号  
联系人：张建春  
电话：010-63639180  
传真：010-63639132  
网址：www.cebbank.com

### （二）主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任（主持工作），中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长，中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记，中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记，中国人民银行信贷管理司司长，中国人民银行货币金银局局长，中国人民银行银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记，中国光大银行董事长、党委书记，光大证券股份有限公司董事长，中国光大控股有限公司董事会主席，中国光大国际有限公司董事会主席。

行长赵欢先生，曾任中国建设银行信贷部业务管理处副处长、处长、公司业务部综合管理处处长，公司业务部副总经理，厦门市分行副行长，公司业务部副总经理、总经理，上海市分行行长，中国建设银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行执行董事、行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行

副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2015 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金，共 42 只证券投资基金，托管基金资产规模 881.83 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### 三、相关服务机构

#### （一）场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

#### （二）场外发售机构

##### 1. 直销机构

###### 1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

###### 2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

##### 2. 代销机构（排名不分先后）

###### 1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：刘秀宇

电话：010-6610860

传真：010-66107571

客服热线：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### 2) 招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

3) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66215533

传真：010-66218888

客服热线：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58766688

传真：021-58798398

客服热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 A 座 6 层

法定代表人：李国华

联系人：杨娟

电话：010-68858076

传真：010-68858057

客服热线：95580

网址：www.psbc.com

6) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

联系人：王媛

电话：010-65556689

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

7) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636388

传真：010-63636713

客服热线：95595

网址：www.cebbank.com

8) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：潘逸

电话：020-38322888

传真：020-87310779

客服热线：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

9) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行 27F

法定代表人：孙建一

联系人：王敏

电话：021-38637673

传真：0755-82080387

客服热线：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

10) 国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

11) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

客服热线：95565、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

12) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130578

传真：0755-82130573

客服热线：400-109-9918

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

13) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87550265

传真：020-87553600

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

14) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服热线：400-888-8108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

15) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：福建省福州市湖东路 268 号；上海市浦东新区民生路 1199 弄证  
大五道口广场 1 号楼 20-22 层

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：0591-38507869

传真：0591-38507538

客服热线：95562c

网址：www.xyzq.com.cn

16) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525、400-888-8788

网址：www.ebscn.com

17) 华福证券有限责任公司

住所：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-96326

传真：010-88085195、010-88085265-8191

客服热线：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

18) 中国银河证券股份有限公司



住所：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568062

传真：010-66568704、010-66568532、010-66568640

客服热线：4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

19) 齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889118

传真：0531-68889093

客服热线：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

20) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：储晓明

联系人：黄莹

电话：4008895523

传真：021-33388224

客服热线：95523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

21) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

法定代表人: 许建平

联系人: 李巍

电话: 010-88085858

传真: 010-88085195

客户服务电话: 400-800-0562

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

22) 海通证券股份有限公司

住所: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

联系人: 王立群

电话: 021-23219000

传真: 021-63410707、021-63410627

客服热线: 95553

网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

23) 国元证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法人代表: 蔡咏

联系人: 李飞

电话: 0551-62207323

传真: 021-38670767

客服热线: 95578、400-888-8777

网址: [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

24) 平安证券有限责任公司

住所: 广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 层

办公地址: 广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 层

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

电话：0755-22622268

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

25) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676798

传真：021-38670798

客服热线：4008888666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

26) 安信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人：牛冠兴

联系人：张晨

电话：021-66581727

传真：010-66581721

客服热线：4008-001-001

网址：[www.essences.com.cn](http://www.essences.com.cn)

27) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

传真：010-63081173

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

28) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：孔晓君

电话：0755-82943666

传真：025-84579938、025-84579778

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

29) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616-8259

传真：021-68761616

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

30) 英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：李欣

电话：0755-83007179

传真：0755-83007167

客服热线：4008-698-698

网址：www.ydsc.com.cn

31) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383

传真：010-60836031；0755-23835525

客服热线：95558

网址：www.citics.com

32) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022313

传真：0532-85022301

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

33) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人：郭林

联系人：戴莉丽

电话：021-32229888

传真：010-60836221

客服热线：021-63340678

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

34) 金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025500

传真：0755-83025625

客服热线：4008-888-228

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

35) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服热线：400-809-6096

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

36) 联讯证券有限责任公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

联系人：宋航

电话：0752-2119391

传真：0931-4890628

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

37) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

38) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

电话：0510-82588168

客服热线：95570

网址：www.glsc.com.cn

39) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人：祝献忠

联系人：黄恒

电话：010-58568235

传真：010-58568140

客服热线：010-58568118

网址：www.hrsec.com.cn

40) 民族证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法人代表人：赵大建

联系人：李微

电话：400-889-5618

传真：010-66553216

客服热线：400-889-5618

网址：www.e5618.com

41) 东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区星阳街5号

办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-62601555

传真：0512-62938812

客服热线：400-860-1555

网址：www.dwzq.com.cn

42) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679535

客服热线：4009101166

公司网站：www.cicc.com.cn

43) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：010-66045152



传真：010-66045518

客服热线：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

44) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

众禄基金销售网：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

45) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

客服热线：400-700-9665

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

46) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-58788678

传真：021-58787698

客服热线：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

47) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

48) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

49) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐映绯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

50) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系人：李广宇

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

51) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

法定代表人：李晓涛

联系人：汪林林

电话：0571-88920810

传真：0571-86800423

客服热线：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

52) 北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

电话：010-62020088

传真：010-62020088-8802

客服热线：400-888-6661

网址：[www.myfp.cn](http://www.myfp.cn)

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（三）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京市西城区太平桥大街17号  
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人：周明  
联系人：朱立元  
电话：010-59378839  
传真：010-59378907

（四）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人：俞卫峰  
经办律师：吕红、黎明  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：吕红

（五）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
法定代表人：杨绍信  
电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：俞伟敏  
经办会计师：单峰、俞伟敏

## 四、基金的名称

中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）。

## 五、基金的类型

上市契约型开放式。

## 六、基金的投资目标

本基金通过投资于促进中国经济发展方式加快转变的新动力行业和上市公司，以求充分分享中国经济未来持续增长的成果并力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的回报。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于80%，权证资产比例不超过基金资产净值的3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%~40%，其中现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

债券等固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（包括分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购、银行存款等固定收益证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

### （一）投资策略

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置方面，自上而下地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在投资品种选择方面，自下而上地选择具有投资价值的证券品种。

## 1. 资产配置策略

本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、上市公司盈利能力、股票市场估值水平、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。

加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分。本基金据此调整股票资产配置策略。

## 2. 新动力主题挖掘

新动力主题是指促进中国经济发展方式加快转变的新动力所带来的主题性投资机会。

在不同时期，新动力主题有不同体现。本基金基于基金管理人研究团队对宏观经济、细分行业的研究成果，持续关注中国经济长期趋势，分析国家行业振兴计划与加快培育和发展战略新兴产业决定，以充分把握促进中国经济发展方式加快转变的新动力主题。根据上述研究方法，本基金认为，目前而言新动力主题主要包括高新技术、新能源和内需拉动三大方面。

### ① 高新技术主题

转变经济发展方式，需增强科技创新能力，攻克一批核心关键技术，抢占未来科技竞争制高点，把技术进步与产业结构优化升级紧密结合。本基金将新一代信息技术、生物技术、高端装备制造技术、新材料技术等带来的投资机会定义为高新技术主题。

### ② 新能源主题

转变经济发展方式，需推动能源生产和利用方式的变革，构建安全、稳定、经济、清洁的现代能源产业体系，加快新能源开发，推进传统能源清洁高效利用。本基金将研发和利用核能、太阳能、风能、生物质能、水电等非传统能源以及智能电网、节能环保、新能源汽车而带来到投资机会定义为新能源主题。

### ③ 内需拉动主题

转变经济发展方式，需坚持扩大国内需求特别是消费需求，促进经济发展由主要依靠投资、出口拉动向依靠消费、投资、出口协调拉动转变。本基金将

扩大居民消费需求或调整优化投资结构而带来的投资机会定义为内需拉动主题。

### 3. 股票投资策略

#### （1）备选股票库

备选股票库由公司投资研究团队负责建立和维护。投资研究团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等，预测上市公司未来盈利前景，并据此申请将股票纳入备选股票库，履行股票入库审批程序；同时，根据行业和上市公司基本面的变化对股票池进行动态维护和更新。

#### （2）新动力行业筛选

同一新动力主题可能关联多个行业、某一行业下属某个子行业或某一行业内少数上市公司。本基金根据申银万国行业分类标准，研究三级行业是否与新动力主题相关联。如日后申银万国行业分类标准有所调整，或日后出现更为科学的行业分类标准，本基金将在审慎的基础上，调整相关行业范围。

对于相关联的行业，本基金将进一步考察该行业的生命周期、景气周期和境内外竞争格局，挖掘该行业内的优质公司并纳入新动力公司（与新动力主题相关联的上市公司）；对于不关联的行业，本基金将分析该行业内上市公司的主营业务、重大事项和发展方向，以考察该上市公司是否可纳入新动力公司。

#### （3）新动力公司定量筛选

本基金认为，新动力公司不仅应属于新动力主题，同时公司本身也应具有持续增长能力，这样才能保证中国经济发展方式加快转变的动力连绵不断。本基金力争在合理的估值水平内，寻找具备持续增长能力的公司。

本基金根据定量指标筛选新动力公司，相关指标既包括净资产收益率等考察公司增长能力的财务指标，也包括市净率等考察股票估值水平的估值指标，同时还包括市盈增长比率等指标，旨在兼顾和平衡公司增长能力和股票估值水平。

净资产收益率是公司利润与股东权益的比率，该比率常用于衡量公司的投资效率；市净率是市值和账面价值的比率，该比例常用于衡量股价是否被高估或者低估；市盈增长比率由股票的未来市盈率除以每股盈余的未来增长率预估值得出，市盈增长比率值越低，股价遭低估的可能性越大。本基金将根据证券

市场实际情况调整定量指标及其权重。

#### （4）新动力公司定性分析

在定量筛选的基础上，本基金对新动力公司进行定性分析。其中行业分析指确认公司是否属于新动力主题及公司在该行业的市场地位和市场份额，战略分析指公司未来的发展方向和预期目标是否明确，经营分析指公司是否在高效运作，竞争优势指公司核心竞争力是否能够持续，公司治理指公司所有者和管理者的权责是否明确及公司是否关注中小股东利益，财务确认指公司的财务数据是否真实及财务数据是否全面反映了公司经营情况等，产品分析指公司主营产品销售收入和成本情况，创新能力指公司的技术研发能力是否和新动力主题匹配。

本基金在新动力公司定性分析的基础上，优化各行业配置比例，并形成最终的投资组合。

#### 4. 固定收益类证券投资策略

本基金根据对利率走势的预判，对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。当预期利率下降时，增加组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；当预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

本基金在确定固定收益类资产组合久期后，针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构，包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整。

#### 5. 权证及其他品种投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

### （二）投资决策

#### 1. 投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势等。

#### 2. 投资决策原则

合法合规、忠于客户、资产分离、保密、责任分离、谨慎投资、公平交易、



严格控制、研究为先等。

### 3. 投资决策机制

（1）投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，投资决策委员会对基金投资的所有重大问题进行决策。

（2）分管投资的副总经理全面负责公司的基金投资管理工作：指导投资研究团队的业务，推动投资研究部内部的沟通与互动，并协调投资研究团队与公司其他部门之间的关系；投资总监负责组织和协调基金投资和研究业务，监控对投资决策委员会所作投资决策的执行情况；研究总监负责管理研究部相关工作。

（3）基金经理依据相关法律、法规、基金合同和公司投资管理规章对日常投资管理负特定责任。基金经理还负责管理组合的流入/流出、向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

### 4. 投资决策程序

本基金的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策流程如下：

（1）投资决策委员会根据相关规定对基金资产配置等重大投资决策形成决议并下达给基金经理；

（2）基金经理根据投资决策委员会的要求，结合股票池及有关研究报告，负责制定具体的投资组合方案；

（3）根据有限授权原则，基金经理在授权范围内的投资组合方案可直接进入执行程序；超出基金经理授权权限但在投资总监授权权限范围内的，经投资总监审批后方可进入执行程序；超出投资总监授权权限的，须经投资决策委员会审批后方可进入执行程序；

（4）金融工程人员基于数量化的风险评估和控制系统对基金投资组合进行日常性的风险测量和业绩归因分析，定期向公司投资决策委员会和风险控制委员会出具相应的风险评估报告，在必要时提出调整投资组合的建议。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中证全债指数收益率}$

×25%

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人光大银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金2015年第2季度报告，所载数据截至2015年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	权益投资	1,438,997,664.81	80.58
	其中：股票	1,438,997,664.81	80.58
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	110,033,000.00	6.16
	其中：债券	110,033,000.00	6.16
	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	—	—
	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	230,744,042.59	12.92
8	其他资产	6,041,474.11	0.34
9	合计	1,785,816,181.51	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	43,490,992.00	2.48
B	采矿业	—	—
C	制造业	613,657,877.06	35.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,302,083.49	3.44
E	建筑业	14,633,500.00	0.83
F	批发和零售业	92,855,286.48	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	6,494,978.35	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,779,597.97	6.83
J	金融业	188,444,000.00	10.75
K	房地产业	96,405,860.00	5.50
L	租赁和商务服务业	88,436,469.60	5.05
M	科学研究和技术服务业	12,827,683.48	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	101,669,336.38	5.80
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	1,438,997,664.81	82.10

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

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	300113	顺网科技	1,259,889	67,530,050.40	3.85
2	601988	中国银行	13,600,000	66,504,000.00	3.79
3	601588	北辰实业	7,683,100	59,159,870.00	3.38
4	600511	国药股份	1,062,297	53,529,145.83	3.05

5	600016	民生银行	5,000,000	49,700,000.00	2.84
6	300041	回天新材	1,255,763	45,169,795.11	2.58
7	600761	安徽合力	2,537,995	42,460,656.35	2.42
8	600612	老凤祥	773,287	41,401,785.98	2.36
9	601166	兴业银行	2,400,000	41,400,000.00	2.36
10	600521	华海药业	1,317,341	41,166,906.25	2.35

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（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	110,033,000.00	6.28
	其中：政策性金融债	110,033,000.00	6.28
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	110,033,000.00	6.28

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（%）
1	120229	12国开29	1,100,000	110,033,000.00	6.28
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11、投资组合报告附注

本基金投资的前十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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,097,851.25
2	应收证券清算款	963,813.53
3	应收股利	—
4	应收利息	3,666,962.73
5	应收申购款	312,846.60

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,041,474.11

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300113	顺网科技	67,530,050.40	3.85	停牌

(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。

## 十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日2010年2月10日，基金业绩截止日2015年6月30日。

### 1. 本报告期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	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率	①-③	②-④

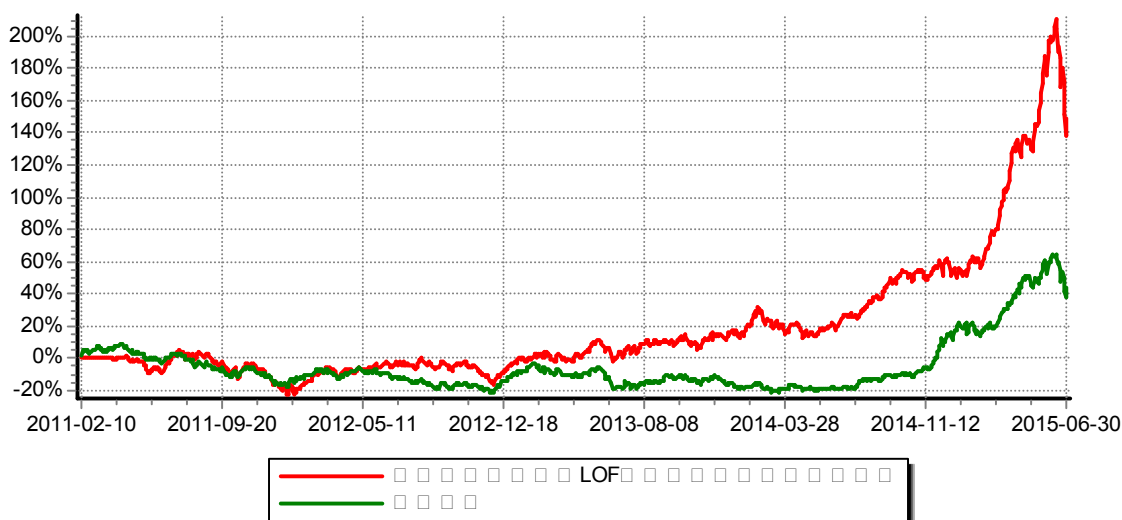
				标准 差		
2011.02.10-2011.12.31	-17.70%	1.13%	-16.07%	0.95%	-1.63%	0.18%
2012.01.01-2012.12.31	16.95%	1.19%	6.94%	0.96%	10.01%	0.23%
2013.01.01-2013.12.31	20.42%	1.23%	-5.64%	1.05%	26.06%	0.18%
2014.01.01-2014.12.31	30.38%	1.17%	40.69%	0.91%	-10.31%	0.26%
2015.01.01-2015.06.30	65.08%	1.98%	20.97%	1.70%	44.11%	0.28%
2011.2.10-2015.06.30	149.45%	1.30%	44.14%	1.08%	105.31%	0.22%

数据来源：中欧基金 中证指数

## 2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年2月10日至2015年6月30日)



数据来源：中欧基金 中证指数

## 十三、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

#### 1. 基金管理人的管理费；

2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市费；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费、托管费外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。



### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

### （五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2015 年 3 月刊登的《中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

#### （一）“重要提示”部分

- 1、新增了因《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定将本基金类型变更为混合型的相关说明并对应调整本招募说明书中相关表述；
- 2、更新了招募说明书所载内容的截止时间。

#### （二）“二、释义”部分

更新了《基金法》的释义。

#### （三）“三、基金管理人”部分

更新了基金管理人股权结构、董事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理、公司投资决策委员会成员基本信息。

#### （四）“四、基金托管人”

更新了托管人的相关信息。

（五）“五、相关服务机构”部分

更新了直销机构的网站信息和代销机构的基本信息。

（六）“九、基金份额的场外申购、转换与赎回”部分

1、更新了场外申购与赎回的限制部分的信息；

2、更新了场外申购费用和赎回费用部分的信息，新增了养老金客户的费率信息。

（七）“十二、基金的投资”部分

更新了“（十）基金投资组合报告”的内容，数据截至2015年6月30日。

（八）“十三、基金的业绩”部分

更新了“本报告期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”和“基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至2015年6月30日。

（九）“二十四、对基金份额持有人的服务”部分

更新了基金管理人的网站信息。

（十）“二十五、其他应披露事项”部分

更新了本期本基金相关的公告。

以下为本基金管理人自2015年2月10日至2015年8月9日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	事项名称	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	2015.3.6
2	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中元华电”股票估值方法的公告	2015.3.17
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“中泰桥梁”股票估值方法的公告	2015.3.18
4	中欧基金管理有限公司关于新增中国国际金融有限公司为旗下基金代销机构的公告	2015.3.19

5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的申购费率优惠活动的公告	2015.3.20
6	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2015年第1号）	2015.3.26
7	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2015年第1号）	2015.3.26
8	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（正文）	2015.3.27
9	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）2014年年度报告（摘要）	2015.3.27
10	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	2015.3.28
11	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	2015.4.1
12	关于调整旗下部分基金持有“西安饮食”股票估值方法的公告	2015.4.1
13	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）场内交易价格波动的提示公告	2015.4.3
14	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）场内交易价格波动的提示公告	2015.4.8
15	关于调整旗下部分基金持有“银润投资”股票估值方法的公告	2015.4.14
16	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）2015年第1季度报告	2015.4.22
17	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“远望谷”股票估值方法的公告	2015.5.5
18	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“奥维通信”股票估值方法的公告	2015.5.9
19	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“顺网科技”股票估值方法的公告	2012.5.12
20	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“洲明科技”股票估值方法的公告	2015.5.12
21	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“富邦股份”股票估值方法的公告	2015.5.15
22	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“航天机电”股票估值方法的公告	2015.5.21
23	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“金龙机电”股票估值方法的公告	2015.5.21

24	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“上海佳豪”股票估值方法的公告	2015.5.23
25	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“万邦达”股票估值方法的公告	2015.5.23
26	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“信维通信”股票估值方法的公告	2015.5.23
27	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“世纪游轮”股票估值方法的公告	2015.5.27
28	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	2015.5.29
29	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）恢复申购、转换转入、定期定额投资公告	2015.6.4
30	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告	2015.6.10
31	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购金额的公告	2015.6.10
32	中欧基金管理有限公司关于网上直销平台支付宝客户费率优惠活动的公告	2015.6.10
33	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“华资实业”股票估值方法的公告	2015.6.11
34	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“永太科技”股票估值方法的公告	2015.6.12
35	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	2015.6.30
36	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“友好集团”股票估值方法的公告	2015.6.30
37	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长江电力”股票估值方法的公告	2015.6.30
38	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2015年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2015.7.1
39	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“桂东电力”股票估值方法的公告	2015.7.4
40	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的公告	2015.7.11

41	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的公告	2015.7.14
42	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券有限责任公司费率优惠活动的公告	2015.7.17
43	中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告	2015.7.17
44	中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同(更新)	2015.7.17
45	中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）托管协议(更新)	2015.7.17
46	中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）2015年第2季度报告	2015.7.20
47	中欧基金管理有限公司关于网上直销系统开通通联支付渠道并实施费率优惠的公告	2015.7.28
48	中欧基金管理有限公司关于官方淘宝店上线基金费率优惠活动调整的公告	2015.7.30
49	中欧基金管理有限公司关于中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）开通转换、定期定额投资和费率优惠业务的公告	2015.7.31
50	中欧基金管理有限公司关于网上直销系统通联支付渠道实施费率优惠调整的公告	2015.7.31

上述内容仅为摘要，须与本基金《更新招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

中欧基金管理有限公司  
2015年9月23日