

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)
(原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)

2015年半年度报告

2015年06月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2015年08月26日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自2015年3月30日中欧盛世成长分级股票型证券投资基金结束分级运作且盛世A和盛世B份额终止上市起，原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金名称变更为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金本报告期自2015年1月1日至2015年3月30日止，中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)本报告期自2015年3月31日至2015年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
转型后	8
转型前	8
3.2 基金净值表现(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))	9
3.3 基金净值表现(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务报表(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 半年度财务报表(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)(未经审计)	37
7.1 资产负债表(转型前)	37
7.2 利润表(转型前)	39
7.3 所有者权益(基金净值)变动表(转型前)	40
7.4 报表附注	42
§8 投资组合报告(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))	63
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	69
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	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69

§9	投资组合报告(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)	70
9.1	期末基金资产组合情况	71
9.2	期末按行业分类的股票投资组合	71
9.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	72
9.4	报告期内股票投资组合的重大变动	73
9.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	75
9.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	76
9.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	76
9.8	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	76
9.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	76
9.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76
9.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
9.12	投资组合报告附注	77
§10	基金份额持有人信息(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))	78
10.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
10.2	期末上市基金前十名持有人	78
10.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	79
10.4	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	79
§11	基金份额持有人信息(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)	79
11.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
11.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	81
11.4	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	81
§12	开放式基金份额变动	81
§13	重大事件揭示	82
13.1	基金份额持有人大会决议	82
13.2	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	82
13.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
13.4	基金投资策略的改变	82
13.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
13.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	82
13.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))转型后	82
13.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)转型前	83
13.9	其他重大事件	84
§14	备查文件目录	88
14.1	备查文件目录	88
14.2	存放地点	88
14.3	查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)(转型后)	
基金名称	中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	中欧盛世成长股票LOF
基金主代码	166011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015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	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,170,097,466.49
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	2015年04月21日

注：自2015年3月30日中欧盛世成长分级股票型证券投资基金结束分级运作且盛世A和盛世B份额终止上市起，原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金名称变更为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）。

2.1.2 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金(转型前)	
基金名称	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金
基金简称	中欧盛世成长分级股票
基金主代码	166011
基金运作方式	契约型开放式，本基金分级运作期三年，到期转为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF），并将继续在深圳证券交易所上市交易
基金合同生效日	2012年03月29日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,687,185,707.81
基金合同存续期	3年

基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年04月27日		
下属分级基金的基金简称	中欧盛世成长分级股票	盛世 A	盛世 B
下属分级基金的交易代码	166011	150071	150072
报告期末下属分级基金的份额总额	1,635,337,118.81	25,924,294.00	25,924,295.00

2.2 基金产品说明

2.2.1 中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF) (转型后)	
投资目标	把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

注：自2015年3月30日中欧盛世成长分级股票型证券投资基金结束分级运作且盛世A和盛世B份额终止上市起，原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金名称变更为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）。

2.2.2 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金(转型前)	
投资目标	把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。	盛世A份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。	盛世B份额表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	400-830-8003
传真	021-33830351	010-65169555
注册地址	上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层	广东省广州市越秀区东风东路713号
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	北京市东城区大华路2号广发银行大厦四层
邮政编码	200120	100005
法定代表人	窦玉明	董建岳

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

3.1.1 期间数据和指标	2015年03月31日-2015年06月30日
本期已实现收益	626,134,797.58
本期利润	834,016,467.87
加权平均基金份额本期利润	0.2827
本期基金加权平均净值利润率	21.43%
本期基金份额净值增长率	30.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015年06月30日
期末可供分配利润	1,574,633,063.15
期末可供分配基金份额利润	0.4967
期末基金资产净值	4,140,433,019.42
期末基金份额净值	1.306
3.1.3 累计期末指标	2015年06月30日
基金份额累计净值增长率	30.60%

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润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。

转型前

3.1.4 期间数据和指标	2015年01月01日-2015年03月30日
本期已实现收益	189,159,181.15
本期利润	688,850,599.13
加权平均基金份额本期利润	0.3900
本期基金加权平均净值利润率	28.23%
本期基金份额净值增长率	32.66%
3.1.5 期末数据和指标	2015年03月30日
期末可供分配利润	793,177,705.85
期末可供分配基金份额利润	0.4701
期末基金资产净值	2,788,727,285.67
期末基金份额净值	1.653
3.1.6 累计期末指标	2015年03月30日
基金份额累计净值增长率	147.67%

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润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(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))

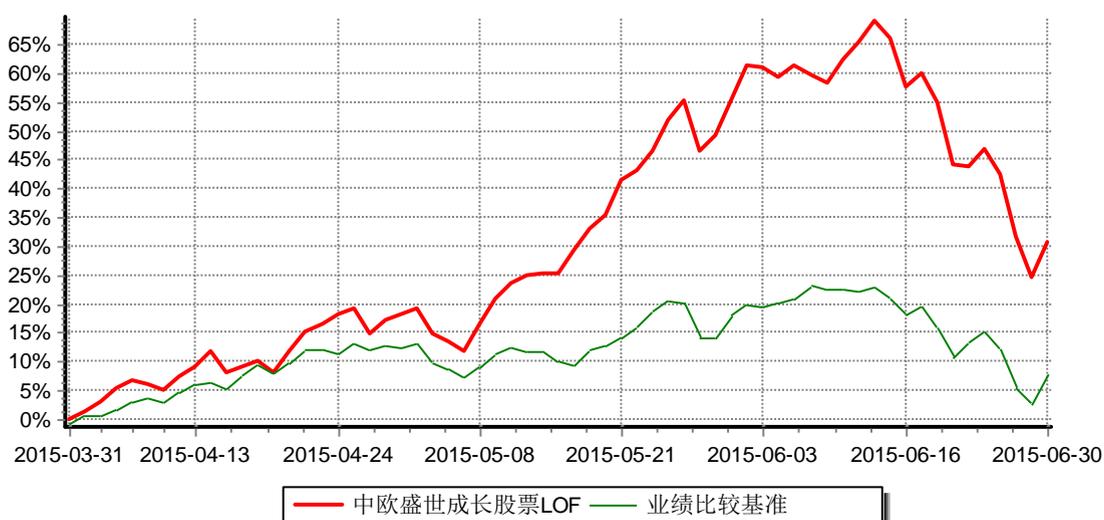
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-12.41%	3.58%	-5.43%	2.62%	-6.98%	0.96%
过去三个月	30.86%	2.84%	8.73%	1.96%	22.13%	0.88%
自基金合同生效日起至今(2015年03月31日-2015年06月30日)	30.60%	2.82%	7.93%	1.95%	22.67%	0.87%

注:本基金大类资产的投资比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%,其中权证资

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现金占基金资产的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%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即股票资产和债券资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上，我们选择了具有较强代表性的沪深300指数和中证全债指数作为两大类资产的标的指数。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分75%，债券部分25%。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 自基金转型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



注：自2015年3月30日中欧盛世成长分级股票型证券投资基金结束分级运作且盛世A和盛世B份额终止上市起，原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金名称变更为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）。截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

3.3 基金净值表现(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)

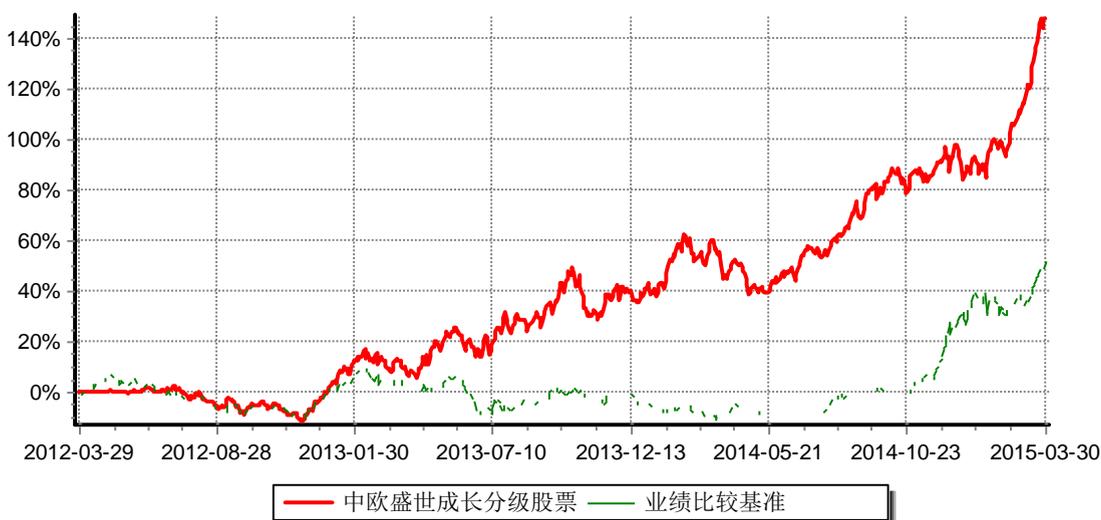
3.3.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	18.75%	1.08%	10.49%	1.02%	8.26%	0.06%

过去三个月	32.66%	1.22%	13.94%	1.38%	18.72%	-0.16%
过去六个月	33.20%	1.22%	48.91%	1.31%	-15.71%	-0.09%
过去一年	70.11%	1.11%	66.18%	1.03%	3.93%	0.08%
过去三年	147.67%	1.23%	53.35%	1.00%	94.32%	0.23%
自基金合同生效日起 至今(2012年03月29 日-2015年03月30日)	147.67%	1.23%	52.47%	1.00%	95.20%	0.23%

注：本基金大类资产的投资比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%，其中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现金占基金资产的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%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围，我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即股票资产和债券资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上，我们选择了具有较强代表性的沪深300指数和中证全债指数作为两大类资产的标的指数。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分75%，债券部分25%。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。

3.3.2 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



§ 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、国都证券有限责任公司、北京百骏投资有限公司、万盛基业投资有限责任公司、窦玉明先生、刘建平先生、周蔚文先生、许欣先生和陆文俊先生，注册资本为1.88亿元人民币。截至2015年6月30日，本基金管理人共管理25只开放式基金，即中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)、中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)、中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金、中欧价值智选回报混合型证券投资基金、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧明睿新起点混合型证券投资基金、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金和中欧永裕混合型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏博	本基金基金经理, 中欧永裕混合型证券投资基金	2013年03月29日	—	8年	历任中原证券股份有限公司研究员, 东方证券股份有限公司研究员。2009年11月加入中欧基金管理有限公司, 曾任中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理兼研究员、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理, 现任中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧永裕混合型证券投资基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施。公司将以此次现场检查为契机，认真落实上海监管局各项整改意见，进一步提升公司整体内部控制水平。

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，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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

敬畏市场；研究分析，屏蔽信息噪音；重视行业的变化、不轻信偶然，保持思考体系的开放性。面对纷繁复杂的市场，投资是一种边修行边前行的过程，我们仍在这个过程中；资本市场无法避免情绪的波动，我们尽量做到事前事后都客观的衡量自己的选择标的，阶段性清零、不被既有选择羁绊，判断和操作周期保持一致。

组合上以具有长期前景的行业为抓手，在行业由概念转入成长期的阶段介入，对已进入成长后期的行业保持谨慎；对待市场短期热点不过多纠缠。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内（2015.3.31至2015.6.30），中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）

基金份额净值增长率为30.60%，同期业绩比较基准增长率为7.93%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。本报告期内（2015.1.1至2015.3.30），中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金份额净值增长率为32.66%，同期业绩比较基准增长率为13.94%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

转型期和不可知论是盛世展望市场一贯的两个认知前提。宏观经济增速持续缓慢下降，出清过程预计较长；政策取向是调结构，但又兼顾社会承受能力。对内改革和对外拓展是政策和社会经济活动的两个维度，随着国家实力的变化，两者必将并行，未来一段时间内，我们认为对内改革更为重要。没有永远成功的投资策略，市场的不同时期，不同投资风格的投资者都可以取得优异的投资业绩，但随着经济周期的波动，以及市场风格发挥到极致之后的均值回归，过去一段时间看似取得了成功的投资策略一夜间可能就会失灵。我们将把投资视野放得更长、选股标准变得更严格，选取我们认可的真成长，通过挖掘并耐心持有的策略来获取超额收益。经济总量的增长，孕育和衍生了许多新的细分行业，我们将按照我们的理念和方法进行动态筛选并考虑标的价格对组合进行优化，争取取得满意的结果。此外我们也重视公司个体发生的实质性变化和阶段性反转的行业。基金持有人是盛世生存和发展的基础，未来仍将充满波折坎坷，感谢持有人的支持。

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、行业研究等方面的骨干。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验。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

本基金本报告期内未进行利润分配，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

基金托管人依据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》与《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金托管协议》，自2012年3月29日起托管中欧盛世成长分级股票型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、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

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、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基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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半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 半年度财务报表(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)) (未经审计) 转型后:

报告期(2015年03月31日-2015年06月30日)

6.1 资产负债表

会计主体: 中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2015年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)(原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

		2015年06月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	482,701,217.03
结算备付金		6,858,197.87
存出保证金		2,424,371.01
交易性金融资产	6.4.7.2	3,753,222,198.57
其中: 股票投资		3,659,105,819.47
基金投资		—
债券投资		94,116,379.10
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	2,710,780.13
应收股利		—
应收申购款		3,591,699.09
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	30,246.48
资产总计		4,251,538,710.18
负债和所有者权益		本期末 2015年06月30日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.2	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		16,840,231.66
应付赎回款		82,516,828.19
应付管理人报酬		5,791,549.38
应付托管费		965,258.24
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	4,493,473.18

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF) (原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	498,350.11
负债合计		111,105,690.76
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,280,117,668.26
未分配利润	6.4.7.10	2,860,315,351.16
所有者权益合计		4,140,433,019.42
负债和所有者权益总计		4,251,538,710.18

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.306元，基金份额总额3,170,097,466.49份。

6.2 利润表

会计主体：中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年03月31日至2015年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年03月31日至2015年06月30日
一、收入		858,722,464.99
1. 利息收入		2,036,036.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	636,611.97
债券利息收入		1,315,913.78
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		83,510.76
其他利息收入		—
2. 投资收益(损失以“-”填列)		647,586,568.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	637,720,683.03
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	254,754.10
资产支持证券投资收益		—
		—

衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	9,611,131.33
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	207,881,670.29
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,218,189.73
减：二、费用		24,705,997.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,678,152.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,446,358.78
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	7,440,940.83
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	140,544.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		834,016,467.87
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		834,016,467.87

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年03月31日至2015年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30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)	1,126,122,279.91	1,662,605,005.76	2,788,727,285.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	834,016,467.87	834,016,467.87
三、本期基金份额交易产生的	153,995,388.35	363,693,877	517,689,265.88

基金净值变动数(净值减少)		.53	
其中: 1. 基金申购款	455,923,564.89	1,063,356,817.10	1,519,280,381.99
2. 基金赎回款	-301,928,176.54	-699,662,939.57	-1,001,591,116.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	1,280,117,668.26	2,860,315,351.16	4,140,433,019.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘建平

管志斌

郭雅梅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧盛世成长分级股票型证券投资基金(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”)证监许可[2011]第1658号《关于核准中欧盛世成长分级股票型证券投资基金募集的批复》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《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集520,330,319.80元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第075号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为520,524,217.77份基金份额,其中认购资金利息折合193,897.97份基金份额。场外认购的全部份额确认为中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之基础份额(以下简称“中欧盛世份额”)494,590,318.77份,其中认购资金利息折合188,998.97份基金份额;场内认购部分按照基金合同约定的5:5比例份额确认为中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之A类份额(以下简称“中欧盛世A类份额”)12,966,949.00份,其中认购资金利息折合2,449.00份基金份额,和中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之B类份额(以下简称“中欧盛世B类份额”)12,966,950.00份,其中认购资金利息折合2,450.00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,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》和《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金在基金合同生效后三年内分级运作。中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的基金份额数配比始终保持5:5的比率

不变。本基金5份中欧盛世A类份额与5份中欧盛世B类份额构成一对份额组合，一对中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的份额组合的净值之和将等于10份中欧盛世份额的净值。中欧盛世A类份额的约定收益率为6.5%；中欧盛世B类份额的份额净值根据中欧盛世份额的份额净值、中欧盛世A类份额的份额净值以及中欧盛世份额、中欧盛世A类份额、中欧盛世B类份额的份额净值关系计算。在满足一定条件的情况下，本基金的基金管理人将根据基金合同约定，对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到1.000元。本基金合同生效后满三年的对应日(该对应日为非工作日，则顺延到下一个工作日)，为中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的分级运作到期折算日，届时中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额将按照基金合同的约定折算为中欧盛世份额的场内份额，本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。

本基金在分级运作期内，中欧盛世份额接受场外与场内申购和赎回，中欧盛世A类份额、中欧盛世B类份额只上市交易但不接受申购和赎回，并可与中欧盛世份额相互间进行配对转换。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第97号文审核同意，本基金25,933,899.00份基金份额于2012年4月27日在深交所挂牌交易(其中中欧盛世A类份额为12,966,949.00份，中欧盛世B类份额为12,966,950.00份)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%-95%，其中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现金占基金资产的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%。本基金的业绩比较基准为：75% X 沪深300指数收益率+25% X 中证全债指数收益率。

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2015年8月26日批准报出。

6.4.2 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>》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年3月31日至2015年6月30日止期间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2015年6月30日的财务状况以及2015年3月31日至2015年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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与最近一期年度报告一致。会计估计与最近一期年度报告相比，发生变更。

6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和

私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税
- (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, 股权的股息、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, 暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
活期存款	482,701,217.03
定期存款	—
其他存款	—
合计	482,701,217.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2015年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,850,124,315.20	3,659,105,819.47	808,981,504.27
债券	交易所市场	94,121,398.30	94,116,379.10	-5,019.20
	银行间市场	—	—	—
	合计	94,121,398.30	94,116,379.10	-5,019.20
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,944,245,713.50	3,753,222,198.57	808,976,485.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
应收活期存款利息	95,185.51
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,777.58
应收债券利息	2,605,162.36
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	6,672.78
其他	981.90
合计	2,710,780.13

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
----	----------------

其他应收款	—
待摊费用	30,246.48
合计	30,246.48

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
交易所市场应付交易费用	4,493,473.18
银行间市场应付交易费用	—
合计	4,493,473.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	282,963.76
审计费	49,588.57
信息披露费	148,765.71
应付转换费	1,602.30
其他	15,429.77
合计	498,350.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧盛世成长股票LOF)	本期：2015年03月31日至2015年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上期末	1,687,185,707.81	1,126,122,279.91
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
基金拆分/份额折算前	1,687,185,707.81	1,126,122,279.91
基金拆分/份额折算变动份额	1,101,541,580.65	
本期申购	1,129,078,154.54	455,923,564.89
本期赎回(以“-”号填列)	-747,707,976.51	-301,928,176.54
本期末	3,170,097,466.49	1,280,117,668.26

注：截至2015年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为78,171,788.00份(2014年6月

30日托管在场内未上市交易：145,851.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为3,091,925,678.49份(2014年6月30日：375,457,671.01份)。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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	793,177,705.85	869,427,299.91	1,662,605,005.76
本期利润	626,134,797.58	207,881,670.29	834,016,467.87
本期基金份额交易产生的变动数	155,320,559.72	208,373,317.81	363,693,877.53
其中：基金申购款	478,809,841.50	584,546,975.60	1,063,356,817.10
基金赎回款	-323,489,281.78	-376,173,657.79	-699,662,939.57
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,574,633,063.15	1,285,682,288.01	2,860,315,351.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
活期存款利息收入	573,736.10
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	45,340.87
其他	17,535.00
合计	636,611.97

6.4.7.12 票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
卖出股票成交总额	2,324,356,772.32
减：卖出股票成本总额	1,686,636,089.29

买卖股票差价收入	637,720,683.03
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	41,380,911.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,038,245.90
减：应收利息总额	1,087,911.00
买卖债券差价收入	254,754.10

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,611,131.33
基金投资产生的股利收益	—
合计	9,611,131.33

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
1. 交易性金融资产	207,881,670.29
——股票投资	208,048,965.69

——债券投资	-167,295.40
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	207,881,670.29

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
基金赎回费收入	1,210,023.74
转换费收入	8,165.99
合计	1,218,189.73

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
交易所市场交易费用	7,440,940.83
银行间市场交易费用	—
合计	7,440,940.83

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日
审计费用	25,205.24
信息披露费	75,615.72
银行汇划费用	—
上市费	15,123.70
持有人大会费	—
开户费	—

银行间回购交易费用	—
交易所回购手续费用	—
账户维护费用	24,600.00
银行间交易手续费	—
其他费用	—
合计	140,544.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
广发银行股份有限公司(“广发银行”)	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有任公司(“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.c.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
窦玉明、刘建平、周蔚文、许欣、陆文俊	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年03月31日至2015年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	905,144,508.06	18.07%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年03月31日至2015年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购总量的比例
国都证券	200,000,000.00	47.62%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年03月31日至2015年06月30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	824,040.08	18.07%	824,040.08	18.34%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月31日至2015年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	14,678,152.85
其中：支付销售机构的客户维护费	938,963.48

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年03月31日至2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,446,358.78

注：支付基金托管人广发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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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
	2015年03月31日至2015年06月30日 (中欧盛世成长股票LOF)
期初持有的基金份额	—
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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2015年03月31日至2015年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	482,701,217.03	573,736.10

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

6.4.12 期末（2015年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：									
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
000863	三湘股份	2014-11-28	2015-11-30	非公开发行	5.41	8.71	4974122	26,910,000.02	43,324,602.62

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.12.2 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	期末成本总额	期末估值总额
000665	湖北广电	2015-05-25	筹划重大事项	22.81		—	3549600	69,666,061.16	80,966,376.00
000863	三湘股份	2015-02-13	筹划重大事项	11.13	2015-07-24	8.27	9455658	68,615,368.16	105,241,473.54
000917	电广传媒	2015-05-28	筹划重大事项	42.89		—	2360077	61,894,696.89	101,223,702.53
002166	莱茵生物	2015-05-25	筹划重大事项	40.49	2015-07-02	36.44	940000	30,581,276.66	38,060,600.00
002238	天威视讯	2015-06-29	筹划重大事项	23.76		—	3746556	74,745,049.92	89,018,170.56
002546	新联电子	2015-06-17	筹划重大事项	33.16	2015-07-16	29.84	1277449	25,027,348.92	42,360,208.84
600099	林海股份	2015-04-15	筹划重大事项	13.37		—	1241609	15,002,534.22	16,600,312.33
600246	万通地产	2015-05-25	筹划重大事项	7.21	2015-07-06	5.85	23409708	94,396,538.94	168,783,994.68
600416	湘电股份	2015-05-22	筹划重大事项	17.95	2015-07-20	21.89	4064550	50,487,411.73	72,958,672.50
600515	海岛建设	2015-06-02	筹划重大事项	16.29		—	551401	7,574,999.06	8,982,322.29
600641	万业企业	2015-06-12	筹划重大事项	11.23		—	13053291	85,744,250.47	146,588,457.93

注：本基金截至2015年6月30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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部，负责进行风险的实时监控和定期计算，并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2015年6月30日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	482,701,217.03	—	—	—	482,701,217.03
结算备付金	6,858,197.87	—	—	—	6,858,197.87
存出保证金	2,424,371.01	—	—	—	2,424,371.01
交易性金融资产	94,116,379.10	—	—	3,659,105,819.47	3,753,222,198.57
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收证券清算款	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	2,710,780.13	2,710,780.13
应收申购款	12,980.00	—	—	3,578,719.09	3,591,699.09
其他资产	—	—	—	30,246.48	30,246.48
资产总计	586,113,145.01	—	—	3,665,425,565.17	4,251,538,710.18
负债					
应付证券清算款	—	—	—	16,840,231.66	16,840,231.66
应付赎回款	—	—	—	82,516,828.19	82,516,828.19
应付管理人报酬	—	—	—	5,791,549.38	5,791,549.38
应付托管费	—	—	—	965,258.24	965,258.24
应付交易费用	—	—	—	4,493,473.18	4,493,473.18
其他负债	—	—	—	498,350.11	498,350.11
负债总计	—	—	—	111,105,690.76	111,105,690.76
利率敏感度缺口	586,113,145.01	—	—	3,554,319,874.41	4,140,433,019.42

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为2.27%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末

	2015年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	3,659,105,819.47	88.37
交易性金融资产-债券投资	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	3,659,105,819.47	88.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)
		本期末
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	21,109.62
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-21,109.62

6.4.14 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2015年6月30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2,839,113,304.75元, 属于第二层次的余额为914,108,893.82元, 无属于第三层次的余额。于2015年6月30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负债均属于第一层次。

(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, 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, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注6.4.5.2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015年6月30日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 半年度财务报表(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金) (未经审计)

转型前:

报告期(2015年01月01日-2015年03月30日)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体: 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金

报告截止日: 2015年03月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015年03月30日	上年度末 2014年12月31日
----	-----	--------------------	---------------------

中欧盛世成长股票型证券投资基金 (LOF) (原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

资产:			
银行存款	7.4.7.1	190,204,954.09	75,821,291.97
结算备付金		13,022,244.74	15,194,208.12
存出保证金		2,094,772.65	1,601,519.87
交易性金融资产	7.4.7.2	2,581,812,955.56	1,981,007,579.17
其中: 股票投资		2,451,693,684.46	1,852,131,759.87
基金投资		—	—
债券投资		130,119,271.10	128,875,819.30
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	170,000,000.00	263,000,000.00
应收证券清算款		—	5,037,278.79
应收利息	7.4.7.5	2,309,346.05	5,705,577.51
应收股利		—	—
应收申购款		3,561,811.50	10,371,738.04
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		2,963,006,084.59	2,357,739,193.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年03月30日	上年度末 2014年06月30日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		162,684,679.60	1,110,261.76
应付赎回款		4,750,770.27	16,851,662.32
应付管理人报酬		3,204,961.35	3,044,559.58
应付托管费		534,160.24	507,426.59
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	2,900,639.91	2,018,095.67
应交税费		—	—

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)(原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	203,587.55	338,914.36
负债合计		174,278,798.92	23,870,920.28
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,126,122,279.91	1,239,660,043.42
未分配利润	7.4.7.10	1,662,605,005.76	1,094,208,229.77
所有者权益合计		2,788,727,285.67	2,333,868,273.19
负债和所有者权益总计		2,963,006,084.59	2,357,739,193.47

注：截止至2015年3月30日，中欧盛世份额净值1.653元，中欧盛世A类份额净值1.195元，中欧盛世B类份额净值2.111元；基金份额总额1,687,185,707.81份，其中中欧盛世份额1,635,337,118.81份，中欧盛世A类份额25,924,294.00份，中欧盛世B类份额25,924,295.00份。

7.2 利润表（转型前）

会计主体：中欧盛世成长分级股票型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年03月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年01月01日 至2015年03月30 日	上年度可比期间 2014年01月01日至 2014年06月30日
一、收入		704,267,084.83	29,680,176.88
1. 利息收入		2,229,600.19	855,932.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	142,189.74	205,979.98
债券利息收入		1,475,211.79	268,260.98
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		612,198.66	381,691.19
其他利息收入		—	—
2. 投资收益(损失以“-”填列)		202,018,140.41	-1,354,844.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	201,023,509.06	-3,154,939.92

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF) (原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	34,514.20
资产支持证券投资收 益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	994,631.35	1,765,581.34
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.16	499,691,417.98	30,084,374.29
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.17	327,926.25	94,714.82
减：二、费用		15,416,485.70	6,169,791.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,912,824.54	3,155,278.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,485,470.73	525,879.82
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	4,905,877.29	2,275,861.37
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	112,313.14	212,771.41
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		688,850,599.13	23,510,385.88
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		688,850,599.13	23,510,385.88

7.3 所有者权益(基金净值)变动表(转型前)

会计主体：中欧盛世成长分级股票型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年03月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年01月01日至2015年03月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF) (原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

一、期初所有者权益(基金净值)	1,239,660,043.42	1,094,208,229.77	2,333,868,273.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	688,850,599.13	688,850,599.13
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)	-113,537,763.51	-120,453,823.14	-233,991,586.65
其中：1. 基金申购款	38,261,941.37	45,135,459.91	83,397,401.28
2. 基金赎回款	-151,799,704.88	-165,589,283.05	-317,388,987.93
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)	1,126,122,279.91	1,662,605,005.76	2,788,727,285.67
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30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)	131,542,487.77	53,705,036.26	185,247,524.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	23,510,385.88	23,510,385.88
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)	269,265,473.24	143,298,774.50	412,564,247.74
其中：1. 基金申购款	333,685,050.10	173,485,812.17	507,170,862.27
2. 基金赎回款	-64,419,576.86	-30,187,037.67	-94,606,614.53
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)	400,807,961.01	220,514,196.64	621,322,157.65

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

管志斌

郭雅梅

基金管理公司负责人

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

中欧盛世成长分级股票型证券投资基金(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”)证监许可[2011]第1658号《关于核准中欧盛世成长分级股票型证券投资基金募集的批复》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《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集520,330,319.80元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第075号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为520,524,217.77份基金份额,其中认购资金利息折合193,897.97份基金份额。场外认购的全部份额确认为中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之基础份额(以下简称“中欧盛世份额”)494,590,318.77份,其中认购资金利息折合188,998.97份基金份额;场内认购部分按照基金合同约定的5:5比例份额确认为中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之A类份额(以下简称“中欧盛世A类份额”)12,966,949.00份,其中认购资金利息折合2,449.00份基金份额,和中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之B类份额(以下简称“中欧盛世B类份额”)12,966,950.00份,其中认购资金利息折合2,450.00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,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》和《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金在基金合同生效后三年内分级运作。中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的基金份额数配比始终保持5:5的比率不变。本基金5份中欧盛世A类份额与5份中欧盛世B类份额构成一对份额组合,一对中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的份额组合的净值之和将等于10份中欧盛世份额的净值。中欧盛世A类份额的约定收益率为6.5%;中欧盛世B类份额的份额净值根据中欧盛世份额的份额净值、中欧盛世A类份额的份额净值以及中欧盛世份额、中欧盛世A类份额、中欧盛世B类份额的份额净值关系计算。在满足一定条件的情况下,本基金的基金管理人将根据基金合同约定,对本基金所有份额进行折算,所有的基金份额净值调整到1.000元。本基金合同生效后满三年的对应日(该对应日为非工作日,则顺延到下一个工作日),为中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额的分级运作到期折算日,届时中欧盛世A类份额与中欧盛世B类份额将按照基金合同的约定折算为中欧盛世份额的场内份额,本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。

本基金在分级运作期内,中欧盛世份额接受场外与场内申购和赎回,中欧盛世A类份额、中欧盛世B类份额只上市交易但不接受申购和赎回,并可与中欧盛世份额相互间进行配对转换。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第97号文审核同意,本基金25,933,899.00份基金份额于2012年4月27日在深交所挂牌交易(其中中欧盛

世A类份额为12,966,949.00份,中欧盛世B类份额为12,966,950.00份)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中:股票、权证等权益类资产占基金资产的60%-95%,其中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现金占基金资产的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%。本基金的业绩比较基准为:75% X 沪深300指数收益率+25% X 中证全债指数收益率。

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2015年8月26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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年1月1日至2015年3月30日(基金转型日前一日)止期间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2015年3月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年3月30日(基金转型日前一日)止期间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与最近一期年度报告一致。会计估计与最近一期年度报告相比,发生变更。

7.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资

基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票、

债券的差价收入不予征收营业税

(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,股权的股息、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,暂减按25%计入应纳税所得额。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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年03月30日
活期存款	190,204,954.09
定期存款	—
其他存款	—
合计	190,204,954.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末2015年03月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,850,761,145.88	2,451,693,684.46	600,932,538.58
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	129,956,994.90	130,119,271.10
	银行间市场	—	—
	合计	129,956,994.90	130,119,271.10
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—

合计	1,980,718,140.78	2,581,812,955.56	601,094,814.78
----	------------------	------------------	----------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2015年03月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	170,000,000.00	—
合计	170,000,000.00	—

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2015年03月30日
应收活期存款利息	6,557.38
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	5,274.00
应收债券利息	2,296,558.30
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	108.03
其他	848.34
合计	2,309,346.05

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2015年03月30日
交易所市场应付交易费用	2,900,039.91
银行间市场应付交易费用	600.00

合计	2,900,639.91
----	--------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2015年03月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	15,990.48
审计费	84,383.33
信息披露费	73,149.99
应付转换费	4.16
预提上市费	14,629.82
其他	15,429.77
合计	203,587.55

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧盛世成长分级股票)	本期 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 03 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,757,970,848.20	1,165,754,871.07
本期申购	104,790,810.38	73,584,080.78
本期赎回(以“-”号填列)	-227,424,539.77	-151,799,704.88
本期末	1,635,337,118.81	1,087,539,246.97
盛世 A	基金份额(份)	账面金额
上年度末	49,657,564.00	36,952,585.67
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-23,733,270.00	-17,661,069.70
本期末	25,924,294.00	19,291,515.97
盛世 B	基金份额(份)	账面金额
上年度末	49,657,565.00	36,952,586.67
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-23,733,270.00	-17,661,069.70
本期末	25,924,295.00	19,291,516.97

注：截至 2015 年 3 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 51,848,589.00 份(2014 年 6 月 30 日：25,204,439.00 份)，其中盛世 A 为 25,924,294.00 份(2014 年 6 月 30 日：12,602,219.00 份)，盛世 B 为 25,924,295.00 份(2014 年 6 月 30 日：12,602,220.00 份)。托管在场内未上市交易的基金份额为

25,099,360.00 份(2014年6月30日: 145,851.00 份), 托管在场外未上市交易的基金份额为 1,610,237,758.81 份(2014年6月30日: 375,457,671.01 份), 均为中欧盛世份额。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。

7.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	668,331,118.55	425,877,111.22	1,094,208,229.77
本期利润	189,159,181.15	499,691,417.98	688,850,599.13
本期基金份额交易产生的变动数	-64,312,593.85	-56,141,229.29	-120,453,823.14
其中: 基金申购款	22,688,498.59	22,446,961.32	45,135,459.91
基金赎回款	-87,001,092.44	-78,588,190.61	-165,589,283.05
本期已分配利润	—	—	—
本期末	793,177,705.85	869,427,299.91	1,662,605,005.76

7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年03月30日
活期存款利息收入	65,748.69
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	67,119.87
其他	9,321.18
合计	142,189.74

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年03月30日
卖出股票成交总额	1,643,514,654.96
减: 卖出股票成本总额	1,442,491,145.90

买卖股票差价收入	201,023,509.06
----------	----------------

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年03月30日
股票投资产生的股利收益	994,631.35
基金投资产生的股利收益	—
合计	994,631.35

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年01月01日至2015年03月30日
1. 交易性金融资产	499,691,417.98
——股票投资	499,971,855.48
——债券投资	-280,437.50
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	499,691,417.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日至2015年03月30日
基金赎回费收入	325,570.57
转换费收入	2,355.68
合计	327,926.25

注：1.本基金的场内赎回费率为赎回金额的0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2.基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日至2015年03月30日
交易所市场交易费用	4,905,877.29
银行间市场交易费用	—
合计	4,905,877.29

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年01月01日至2015年03月30日
审计费用	24,383.33
信息披露费	73,149.99
银行汇划费用	—
上市费	14,629.82
持有人大会费	—
开户费	—
银行间回购交易费用	150.00
交易所回购手续费用	—
账户维护费用	—
银行间交易手续费	—
其他费用	—
银行汇划费用	—

合计	112,313.14
----	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
广发银行股份有限公司(“广发银行”)	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有任公司(“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.c.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
窦玉明、刘建平、周蔚文、许欣、陆文俊	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日至2015年03月30 日		上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30 日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的 比例		成交总额的 比例
国都证券	680,407,903.15	21.37%	223,651,593.17	14.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日至2015年03月30 日		上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30 日	
	成交金额	占当期债券 交易总量的 比例	成交金额	占当期债券 交易总量的 比例
国都证券	-	-	31,274,774.60	96.50%

7.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日至2015年03月30 日		上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30 日	
	成交金额	占当期债券 回购总量的 比例	成交金额	占当期债券 回购总量的 比例
国都证券	2,801,800,000.00	64.51%	2,495,000,000.00	82.07%

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年3月30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	620,195.59	21.39%	620,195.59	21.39%
关联方名称	上年度可比期间			

	2014年1月1日-2014年6月30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	203,613.30	14.00%	—	—

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年03月30日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,912,824.54	3,155,278.40
其中：支付销售机构的客户维护费	204,005.74	237,581.27

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年03月30日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,485,470.73	525,879.82

注：支付基金托管人广发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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 (中欧盛世成长分级股票)	本期 2015年01月01日至2015年03月30日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日
期初持有的基金份额	376,347.51	251,185.51
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	376,347.51	—
期末持有的基金份额	—	251,185.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.07%

注：本基金的基金管理人于2015年2月9日通过国都证券赎回376,347.51份，赎回费为1,213.72元，符合本基金招募说明书规定的赎回费率。

份额单位：份

项目 (盛世A)	本期 2015年01月01日至2015年03月30日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—

份额单位：份

项目 (盛世B)	本期 2015年01月01日至2015年03月30日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日
-------------	-------------------------------	------------------------------------

期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—

7.4.10.4.2 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

本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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2015年01月01日至2015年03月30日		上年度可比期间 2014年01月01日至2014年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行	190,204,954.09	65,748.69	865,544.31	159,467.49

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

7.4.12 期末（2015年03月30日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：

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
000863	三湘股份	2014-11-28	2015-11-30	非公开发行	5.41	6.09	4974122	26,910,000.02	30,292,402.98
300043	互动娱乐	2014-04-08	2015-04-08	非公开发行	14.40	27.73	363518	5,234,659.20	10,080,354.14
300386	飞天诚信	2014-06-20	2015-06-26	新股锁定期	33.13	161.38	25609	848,426.17	4,132,780.42

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.12.2 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	期末成本总额	期末估值总额
000616	海航投资	2014-12-10	筹划重大事项	4.77	2015-04-17	5.25	20569914	84,298,504.42	98,118,489.78
000863	三湘股份	2015-02-13	筹划重大事项	7.52	2015-07-24	8.27	9455658	68,615,368.16	71,106,548.16
600238	海南椰岛	2014-12-26	筹划重大事项	17.36	2015-04-22	12.31	6509867	62,344,442.85	113,011,291.12
600246	万通地产	2015-01-06	筹划重大事项	6.35	2015-07-06	5.85	23409708	94,396,538.94	148,651,645.80

注:本基金截至2015年3月30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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本期末,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其中，中欧盛世A类份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；中欧盛世B类份额表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部，负责进行风险的实时监控和定期计算，并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行广发银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收

和款项清算, 违约风险可能性很小; 在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险, 且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年3月30日, 本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2014年12月31日: 同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险, 本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析, 包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市, 因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外, 其余均能以合理价格适时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2015年3月30日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响

的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015 年 3 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	190,204,954.09	-	-	-	190,204,954.09
结算备付金	13,022,244.74	-	-	-	13,022,244.74
存出保证金	2,094,772.65	-	-	-	2,094,772.65
交易性金融资产	130,119,271.10	-	-	2,451,693,684.46	2,581,812,955.56
买入返售金融资产	170,000,000.00	-	-	-	170,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,309,346.05	2,309,346.05
应收申购款	-	-	-	3,561,811.50	3,561,811.50
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	505,441,242.58	-	-	2,457,564,842.01	2,963,006,084.59
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	162,684,679.60	162,684,679.60
应付赎回款	-	-	-	4,750,770.27	4,750,770.27
应付管理人报酬	-	-	-	3,204,961.35	3,204,961.35
应付托管费	-	-	-	534,160.24	534,160.24
应付交易费用	-	-	-	2,900,639.91	2,900,639.91
其他负债	-	-	-	203,587.55	203,587.55
负债总计	-	-	-	174,278,798.92	174,278,798.92
利率敏感度缺口	505,441,242.58	-	-	2,283,286,043.09	2,788,727,285.67
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	75,821,291.97	-	-	-	75,821,291.97
结算备付金	15,194,208.12	-	-	-	15,194,208.12
存出保证金	1,601,519.87	-	-	-	1,601,519.87
交易性金融资产	42,494,271.50	86,381,547.80	-	1,852,131,759.87	1,981,007,579.17
买入返售金融资产	263,000,000.00	-	-	-	263,000,000.00

应收证券清算款	—	—	—	5,037,278.79	5,037,278.79
应收利息	—	—	—	5,705,577.51	5,705,577.51
应收申购款	9,998,000.00	—	—	373,738.04	10,371,738.04
资产总计	408,109,291.46	86,381,547.80	—	1,863,248,354.21	2,357,739,193.47
负债					
应付证券清算款	—	—	—	1,110,261.76	1,110,261.76
应付赎回款	—	—	—	16,851,662.32	16,851,662.32
应付管理人报酬	—	—	—	3,044,559.58	3,044,559.58
应付托管费	—	—	—	507,426.59	507,426.59
应付交易费用	—	—	—	2,018,095.67	2,018,095.67
其他负债	—	—	—	338,914.36	338,914.36
负债总计	—	—	—	23,870,920.28	23,870,920.28
利率敏感度缺口	408,109,291.46	86,381,547.80	—	1,839,377,433.93	2,333,868,273.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年3月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.67%(2014年12月31日：5.52%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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、利率走势、证券市场收益率、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。本基金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并据此调整大类资产的配置比例；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的60%-95%，其中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现金占基金资产的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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年03月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,451,693,684.46	87.91	1,852,131,759.87	79.36
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,451,693,684.46	87.91	1,852,131,759.87	79.36

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末	上年度末
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	8,383.97	8,024.70
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-8,383.97	-8,024.70

7.4.14 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2015年3月30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1,976,300,172.06元，属于第二层次的余额为605,512,783.50元，无属于第三层次的余额。(2014年12月31日：第一层级1,690,186,968.18元，第二层级290,820,610.99元，无属于第三层级的余额)。于2015年3月30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负债均属于第一层次。

(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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015年3月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014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) 除公允价值外，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(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))

转型后：

报告期（2015年03月31日-2015年06月30日）

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	3,659,105,819.47	86.07
	其中：股票	3,659,105,819.47	86.07
2	固定收益投资	94,116,379.10	2.21
	其中：债券	94,116,379.10	2.21
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	489,559,414.90	11.51
6	其他各项资产	8,757,096.71	0.21
7	合计	4,251,538,710.18	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	40,243,832.40	0.97
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,861,347,936.65	44.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,937,681.65	1.81

E	建筑业	47,945,680.00	1.16
F	批发和零售业	143,807,744.13	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	21,187,246.71	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	441,137,171.21	10.65
J	金融业	—	—
K	房地产业	859,016,150.72	20.75
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	11,096,000.00	0.27
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	158,386,376.00	3.83
S	综合	—	—
	合计	3,659,105,819.47	88.37

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002042	华孚色纺	20,208,997	275,246,539.14	6.65
2	600246	万通地产	23,409,708	168,783,994.68	4.08
3	002539	新都化工	4,884,829	160,710,874.10	3.88
4	600238	海南椰岛	10,839,807	159,995,551.32	3.86
5	300186	大华农	3,437,527	149,876,177.20	3.62
6	000863	三湘股份	14,429,780	148,566,076.16	3.59
7	600641	万业企业	13,053,291	146,588,457.93	3.54
8	000911	南宁糖业	7,876,669	135,006,106.66	3.26
9	002351	漫步者	3,759,851	134,151,483.68	3.24
10	300408	三环集团	3,397,482	118,436,222.52	2.86
11	300337	银邦股份	4,220,549	111,338,082.62	2.69
12	000002	万科A	7,250,933	105,283,547.16	2.54

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)(原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

13	601929	吉视传媒	6,805,334	102,896,650.08	2.49
14	000917	电广传媒	2,360,077	101,223,702.53	2.44
15	002238	天威视讯	3,746,556	89,018,170.56	2.15
16	000665	湖北广电	3,549,600	80,966,376.00	1.96
17	300223	北京君正	2,180,838	77,637,832.80	1.88
18	600633	浙报传媒	3,950,000	77,420,000.00	1.87
19	600037	歌华有线	2,355,873	74,209,999.50	1.79
20	600831	广电网络	4,348,182	73,788,648.54	1.78
21	600416	湘电股份	4,064,550	72,958,672.50	1.76
22	603306	华懋科技	1,634,228	68,572,206.88	1.66
23	002381	双箭股份	4,381,329	67,516,279.89	1.63
24	002117	东港股份	1,842,003	61,688,680.47	1.49
25	000722	湖南发展	2,505,839	56,005,501.65	1.35
26	600730	中国高科	1,741,004	46,972,287.92	1.13
27	002546	新联电子	1,277,449	42,360,208.84	1.02
28	600844	丹化科技	3,699,939	39,515,348.52	0.95
29	600822	上海物贸	2,757,005	38,542,929.90	0.93
30	002166	莱茵生物	940,000	38,060,600.00	0.92
31	600833	第一医药	1,654,016	38,042,368.00	0.92
32	600729	重庆百货	1,159,901	37,325,614.18	0.90
33	600215	XD长春经	3,056,110	33,219,915.70	0.80
34	002447	壹桥海参	2,506,102	31,326,275.00	0.76
35	000488	晨鸣纸业	2,950,400	26,465,088.00	0.64
36	600823	世茂股份	2,029,893	26,449,505.79	0.64
37	600581	八一钢铁	2,000,000	26,060,000.00	0.63
38	600209	罗顿发展	1,900,000	24,852,000.00	0.60
39	600189	吉林森工	1,300,000	23,868,000.00	0.58
40	600630	龙头股份	1,523,200	23,853,312.00	0.58
41	000736	中房地产	1,491,102	23,156,814.06	0.56
42	002186	全聚德	811,461	21,187,246.71	0.51
43	002014	永新股份	850,000	20,587,000.00	0.50
44	600847	万里股份	599,922	16,893,803.52	0.41
45	600099	林海股份	1,241,609	16,600,312.33	0.40

46	600992	贵绳股份	1,008,600	16,520,868.00	0.40
47	600328	兰太实业	1,052,600	16,315,300.00	0.39
48	002485	希努尔	855,297	13,539,351.51	0.33
49	600148	长春一东	561,200	13,508,084.00	0.33
50	000037	深南电 A	1,000,000	13,280,000.00	0.32
51	600846	同济科技	1,000,000	12,390,000.00	0.30
52	002360	同德化工	685,216	12,196,844.80	0.29
53	600605	汇通能源	560,000	12,040,000.00	0.29
54	000533	万家乐	930,900	11,626,941.00	0.28
55	000968	煤气化	924,014	11,577,895.42	0.28
56	000978	桂林旅游	730,000	11,096,000.00	0.27
57	600463	空港股份	539,500	10,703,680.00	0.26
58	300211	亿通科技	499,910	10,338,138.80	0.25
59	002579	中京电子	645,000	10,191,000.00	0.25
60	000985	大庆华科	356,687	9,181,123.38	0.22
61	600515	海岛建设	551,401	8,982,322.29	0.22
62	300160	秀强股份	390,000	8,931,000.00	0.22
63	000713	丰乐种业	627,997	8,917,557.40	0.22
64	600861	北京城乡	464,148	8,874,509.76	0.21
65	000595	宝塔实业	571,800	7,290,450.00	0.18
66	002534	杭锅股份	314,101	6,618,108.07	0.16
67	600302	标准股份	500,000	6,110,000.00	0.15
68	600864	哈投股份	348,900	5,652,180.00	0.14

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300186	大华农	134,549,311.68	3.25
2	002117	东港股份	121,853,848.24	2.94
3	000166	申万宏源	110,538,627.34	2.67
4	601929	吉视传媒	105,900,452.83	2.56

5	600633	浙报传媒	102,512,343.21	2.48
6	000002	万科A	101,803,727.04	2.46
7	002238	天威视讯	74,745,049.92	1.81
8	601318	中国平安	71,539,468.59	1.73
9	600238	海南椰岛	70,991,271.39	1.71
10	600831	广电网络	70,988,353.40	1.71
11	000665	湖北广电	62,588,439.54	1.51
12	601198	东兴证券	62,276,125.37	1.50
13	600643	爱建股份	62,125,753.87	1.50
14	600833	第一医药	61,367,658.96	1.48
15	603306	华懋科技	57,354,569.03	1.39
16	600037	歌华有线	57,324,333.42	1.38
17	000722	湖南发展	56,867,087.41	1.37
18	000917	电广传媒	54,041,435.48	1.31
19	000554	泰山石油	48,156,516.61	1.16
20	002351	漫步者	44,253,050.68	1.07

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000616	海航投资	277,845,158.25	6.71
2	300357	我武生物	131,258,583.32	3.17
3	002699	美盛文化	109,453,858.02	2.64
4	601199	江南水务	108,176,896.62	2.61
5	000166	申万宏源	105,949,320.06	2.56
6	600518	康美药业	96,426,503.07	2.33
7	000661	长春高新	88,513,134.72	2.14
8	002022	科华生物	86,062,192.98	2.08
9	002292	奥飞动漫	77,110,745.74	1.86
10	300146	汤臣倍健	75,840,579.92	1.83
11	601318	中国平安	74,982,233.75	1.81

12	600620	天宸股份	73,084,625.76	1.77
13	002400	省广股份	70,546,193.54	1.70
14	002117	东港股份	67,559,798.09	1.63
15	601198	东兴证券	64,252,960.00	1.55
16	600643	爱建股份	59,794,543.77	1.44
17	300221	银禧科技	58,047,682.97	1.40
18	600822	上海物贸	52,011,434.50	1.26
19	002604	龙力生物	51,468,675.96	1.24
20	000554	泰山石油	43,180,599.69	1.04

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

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	2,685,999,258.61
卖出股票收入（成交）总额	2,324,356,772.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	7,953,454.90	0.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	86,162,924.20	2.08
	其中：政策性金融债	86,162,924.20	2.08
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	94,116,379.10	2.27

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018001	国开1301	840,860	86,162,924.20	2.08
2	019414	14国债14	50,040	5,006,001.60	0.12
3	010603	06国债(3)	18,430	1,848,713.30	0.04
4	019217	12国债17	10,960	1,098,740.00	0.03

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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名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。

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	2,424,371.01
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,710,780.13
5	应收申购款	3,591,699.09
6	其他应收款	—
7	待摊费用	30,246.48
8	其他	—
9	合计	8,757,096.71

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金额单位：人民币元

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	600246	万通地产	168,783,994.68	4.08	停牌
2	600641	万业企业	146,588,457.93	3.54	停牌
3	000863	三湘股份	105,241,473.54	2.54	停牌
4	000863	三湘股份	43,324,602.62	1.05	非公开发行

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 投资组合报告(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)

转型前

报告期(2015年01月01日-2015年03月30日)

9.1 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	2,451,693,684.46	82.74
	其中：股票	2,451,693,684.46	82.74
2	固定收益投资	130,119,271.10	4.39
	其中：债券	130,119,271.10	4.39
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	170,000,000.00	5.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	203,227,198.83	6.86
6	其他各项资产	7,965,930.20	0.27
7	合计	2,963,006,084.59	100.00

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,454,992,874.26	52.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,846,181.01	3.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	73,495,164.06	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	4,670,000.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,921,395.31	1.57
J	金融业	—	—
K	房地产业	559,089,106.28	20.05
L	租赁和商务服务业	75,408,199.56	2.70
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	101,078,511.08	3.62
S	综合	55,192,252.90	1.98
	合计	2,451,693,684.46	87.91

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002042	华孚色纺	20,208,997	157,428,086.63	5.65
2	600246	万通地产	23,409,708	148,651,645.80	5.33
3	002539	新都化工	4,884,829	131,890,383.00	4.73
4	300357	我武生物	2,580,844	118,486,548.04	4.25
5	600238	海南椰岛	6,509,867	113,011,291.12	4.05
6	000911	南宁糖业	7,838,759	108,645,199.74	3.90
7	000863	三湘股份	14,429,780	101,398,951.14	3.64
8	000616	海航投资	20,569,914	98,118,489.78	3.52
9	600416	湘电股份	5,119,789	96,968,803.66	3.48
10	300408	三环集团	1,639,806	94,616,806.20	3.39
11	600641	万业企业	12,053,384	93,534,259.84	3.35
12	002699	美盛文化	3,518,524	90,320,511.08	3.24
13	600518	康美药业	2,729,911	84,599,941.89	3.03
14	601199	江南水务	3,226,051	83,845,065.49	3.01
15	002351	漫步者	3,516,851	80,500,719.39	2.89
16	002381	双箭股份	4,243,953	77,452,142.25	2.78
17	002292	奥飞动漫	1,740,970	75,627,736.80	2.71
18	000661	长春高新	650,994	75,450,204.60	2.71
19	002400	省广股份	1,840,122	75,408,199.56	2.70
20	002022	科华生物	2,324,860	74,581,508.80	2.67
21	600822	上海物贸	6,329,875	73,489,848.75	2.64
22	300146	汤臣倍健	1,809,994	72,978,958.08	2.62

23	300223	北京君正	1,339,899	54,373,101.42	1.95
24	300337	银邦股份	3,099,849	52,821,426.96	1.89
25	300221	银禧科技	2,100,000	51,975,000.00	1.86
26	600620	天宸股份	3,338,552	51,580,628.40	1.85
27	002096	南岭民爆	1,000,000	17,980,000.00	0.64
28	000917	电广传媒	500,000	11,575,000.00	0.42
29	000665	湖北广电	600,000	10,758,000.00	0.39
30	601929	吉视传媒	700,000	10,234,000.00	0.37
31	300043	互动娱乐	363,518	10,080,354.14	0.36
32	600831	广电网络	600,000	9,774,000.00	0.35
33	600037	歌华有线	300,000	8,205,000.00	0.29
34	002202	金风科技	410,737	7,894,365.14	0.28
35	002297	博云新材	304,998	5,608,913.22	0.20
36	603005	晶方科技	90,597	4,990,082.76	0.18
37	002186	全聚德	200,000	4,670,000.00	0.17
38	600064	南京高科	172,275	4,374,062.25	0.16
39	300386	飞天诚信	25,609	4,132,780.42	0.15
40	000421	南京中北	380,171	3,611,624.50	0.13
41	603020	爱普股份	1,000	39,240.00	—
42	000028	国药一致	91	5,315.31	—
43	600161	天坛生物	51	1,947.69	—
44	000722	湖南发展	80	1,106.40	—
45	000048	康达尔	63	985.95	—
46	002253	川大智胜	17	614.89	—
47	600730	中国高科	27	406.35	—
48	000049	德赛电池	9	369.36	—
49	002632	道明光学	1	29.53	—
50	600177	雅戈尔	1	19.01	—
51	600995	文山电力	1	9.12	—

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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	600518	康美药业	99,202,955.52	4.25
2	300408	三环集团	88,456,977.47	3.79
3	600822	上海物贸	80,160,135.02	3.43
4	600416	湘电股份	72,414,155.93	3.10
5	601199	江南水务	71,286,465.66	3.05
6	002292	奥飞动漫	69,947,595.96	3.00
7	000049	德赛电池	66,475,217.45	2.85
8	002400	省广股份	64,702,561.36	2.77
9	300146	汤臣倍健	62,520,468.46	2.68
10	600620	天宸股份	60,747,072.74	2.60
11	300337	银邦股份	53,863,104.29	2.31
12	300223	北京君正	51,990,089.99	2.23
13	601336	新华保险	49,936,435.58	2.14
14	300221	银禧科技	47,922,393.69	2.05
15	002042	华孚色纺	44,322,345.14	1.90
16	000048	康达尔	38,200,638.27	1.64
17	600730	中国高科	35,469,527.39	1.52
18	601233	桐昆股份	33,761,381.18	1.45
19	601928	凤凰传媒	32,495,492.20	1.39
20	600641	万业企业	30,512,982.20	1.31

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

9.4.2 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	000722	湖南发展	125,817,836.54	5.39
2	600064	南京高科	113,942,356.70	4.88
3	600509	天富能源	91,983,734.71	3.94
4	600995	文山电力	84,604,437.54	3.63
5	600270	外运发展	77,536,219.52	3.32

6	000049	德赛电池	77,054,147.79	3.30
7	600787	中储股份	70,391,215.45	3.02
8	600161	天坛生物	67,776,702.69	2.90
9	002501	利源精制	61,512,004.17	2.64
10	000513	丽珠集团	60,671,972.70	2.60
11	002666	德联集团	59,502,806.02	2.55
12	600518	康美药业	56,976,363.89	2.44
13	601336	新华保险	49,809,169.50	2.13
14	002087	新野纺织	44,036,365.14	1.89
15	000048	康达尔	41,486,041.51	1.78
16	600730	中国高科	37,504,487.15	1.61
17	002699	美盛文化	34,887,388.88	1.49
18	601233	桐昆股份	33,214,089.59	1.42
19	601928	凤凰传媒	32,484,001.50	1.39
20	600641	万业企业	31,624,386.88	1.36

9.4.3 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	1,542,081,215.01
卖出股票收入（成交）总额	1,643,514,654.96

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

9.5 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	44,015,207.10	1.58
2	央行票据	—	—
3	金融债券	86,104,064.00	3.09
	其中：政策性金融债	86,104,064.00	3.09
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	130,119,271.10	4.67

9.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018001	国开1301	840,860	86,104,064.00	3.09
2	019008	10国债08	402,930	40,276,882.80	1.44
3	019414	14国债14	20,040	2,006,404.80	0.07
4	019217	12国债17	10,960	1,095,342.40	0.04
5	010603	06国债(3)	6,410	636,577.10	0.02

9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

9.8 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。

9.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.10.1 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。

9.10.2 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。

9.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.11.1 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。

9.11.2 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。

9.11.3 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。

9.12 投资组合报告附注

9.12.1 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。

9.12.2 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。

9.12.3 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	2,094,772.65
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,309,346.05
5	应收申购款	3,561,811.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,965,930.20

9.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600246	万通地产	148,651,645.80	5.33	停牌
2	600238	海南椰岛	113,011,291.12	4.05	停牌
3	000616	海航投资	98,118,489.78	3.52	停牌
4	000863	三湘股份	71,106,548.16	2.55	非公开发行
5	000863	三湘股份	30,292,402.98	1.09	停牌

9.12.6 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。

§ 10 基金份额持有人信息(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))

转型后

报告期(2015年03月31日-2015年06月30日)

10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧盛世成长股票	21,067	150,476.93	2,660,654,120.08	83.93%	509,443,346.41	16.07%

10.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	南方工业资产管理有限责任公司	28,888,888.00	36.96%
2	游瑞林	3,965,240.00	5.07%
3	广发资管玺智量化期权集合资产管理计划	3,258,826.00	4.17%
4	中银保险有限公司—传统保险产品	1,573,484.00	2.01%
5	柯伟武	1,201,665.00	1.54%
6	中银保险有限公司	891,676.00	1.14%
7	方晨	884,736.00	1.13%
8	招商银行股份有限公司企业年金计划—招商银行股份有限公司	855,616.00	1.09%
9	中国人寿保险(集团)公司企业年金计划—中国农	836,160.00	1.07%

	业银行股份有限		
10	吴昊	758,069.00	0.97%

10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	中欧盛世成长股票LOF	1,391,680.94	0.04%
	合计	1,391,680.94	0.04%

10.4 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 11 基金份额持有人信息(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)

转型前:

报告期(2015年01月01日-2015年03月30日)

11.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧盛世成长分级股票	4,307	379,692.85	1,565,380,037.63	95.72%	69,957,081.18	4.28%
盛世A	201	128,976.59	13,876,954.00	53.53%	12,047,340.00	46.47%
盛世B	953	27,202.83	5,252,162.00	20.26%	20,672,133.00	79.74%
合计	5,461	308,951.79	1,584,509,153.63	93.91%	102,676,554.18	6.09%

11.2 期末上市基金前十名持有人

序号(盛世A)	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国泰君安证券股份有限公司	4,605,517.00	17.77%
2	宁波鼎锋海川投资管理中心(有限合伙)一鼎锋诺亚证券投资母基	3,652,372.00	14.09%
3	泰康人寿保险股份有限公司一分红一个人分红-019L-FH002深	1,563,855.00	6.03%
4	任红	1,543,700.00	5.95%
5	中银保险有限公司一传统保险产品	1,316,331.00	5.08%
6	陈碧珍	960,099.00	3.70%
7	泰康资产管理有限责任公司一自有资金	904,300.00	3.49%
8	卢小松	835,005.00	3.22%
9	叶湘爱	824,500.00	3.18%
10	中银保险有限公司	745,950.00	2.88%

序号(盛世B)	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海大正投资有限公司	2,700,000.00	10.41%
2	游瑞林	2,050,800.00	7.91%
3	紫金财产保险股份有限公司一自有资金	1,019,200.00	3.93%
4	刘红	731,800.00	2.82%
5	王斌	620,000.00	2.39%
6	陆唯	576,990.00	2.23%
7	上海国际信托有限公司一多元凯利证券投资集合资	500,000.00	1.93%

	金信托		
8	招商银行股份有限公司企业年金计划—招商银行股份有限公司	405,425.00	1.56%
9	中国人寿保险(集团)公司企业年金计划—中国农业银行股份有限公司	396,206.00	1.53%
10	游瑞东	390,200.00	1.51%

11.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	中欧盛世成长分级股票	1,234,283.65	0.08%
	盛世A	—	—
	盛世B	—	—
	合计	1,234,283.65	0.07%

11.4 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 12 开放式基金份额变动

12.1 开放式基金份额变动(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF))

单位:份

项目	中欧盛世成长股票LOF
基金合同生效日(2015年03月31日) 基金份额总额	1,687,185,707.81
本报告期期间基金总申购份额	1,129,078,154.54
减:本报告期期间基金总赎回份额	747,707,976.51
本报告期期间基金拆分变动份额	1,101,541,580.65
本报告期期末基金份额总额	3,170,097,466.49

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。

§ 13 重大事件揭示

13.1 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。

13.2 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

13.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2015年6月20日发布公告，卢纯青女士自2015年6月18日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务，周蔚文先生不再担任副总经理一职。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中国证监会和上海证监局报告。

13.2.2 基金托管人的重大人事变动

本基金托管人于2015年2月10日发布公告，聘任蒋柯先生为广发银行股份有限公司资产托管部副总经理。

13.3 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。

13.4 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。

13.5 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。

13.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

13.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)转型后)

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商		备注
		成交金额	占股票	成交金额	占债券	成交金额	占债券回	成交金额	占权证	佣金	占当期佣	

			成交 总额 比例		成交 总额 比例		购 成交 总额 比例		成交 总额 比例		金 总量 的比 例	
方正 证券	1	1,549, 355.5 20.84	30.92 %	—	—	—	—	—	—	1,410, 534.0 6	30.92 %	
华创 证券	2	1,444, 434.9 10.34	28.83 %	4,202, 649.3 0	100.0 0%	220,0 00,00 0.00	52.38 %	—	—	1,315, 013.5 3	28.83 %	
国都 证券	1	905,1 44,50 8.06	18.07 %	—	—	200,0 00,00 0.00	47.62 %	—	—	824,0 40.08	18.07 %	
西南 证券	1	599,5 09,82 6.26	11.97 %	—	—	—	—	—	—	545,7 94.55	11.97 %	
中邮 证券	1	414,3 17,16 2.07	8.27%	—	—	—	—	—	—	377,1 95.08	8.27%	
中投 证券	1	97,42 8,403. 36	1.94%	—	—	—	—	—	—	88,69 8.76	1.94%	
宏源 证券	1		—		—		—	—	—		—	

注：根据中国证监会的有关规定，我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。

13.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况(中欧盛世成长分级股票型证券投资基金)转型前

金额单位：人民币元

券商 名称	交易 单元 数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商 的佣金		备 注
		成交 金额	占股 票 成交	成交 金额	占债 券 成交	成交 金额	占债 券回 购	成交 金额	占权 证 成交	佣金	占当 期佣 金	

中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)(原中欧盛世成长分级股票型证券投资基金转型)
2015年半年度报告

			总额 比例		总额 比例		成交 总额 比例		总额 比例		总量 的比 例
方正 证券	1	819,8 91,24 3.87	25.75 %	—	—	—	—	—	—	746,4 29.97	25.74 %
华创 证券	2	1,193, 037,1 05.23	37.46 %	1,523, 889.3 0	100.0 0%	1,541, 100,0 00.00	35.49 %	—	—	1,086, 137.9 4	37.45 %
国都 证券	1	680,4 07,90 3.15	21.37 %	—	—	2,801, 800,0 00.00	64.51 %	—	—	620,1 95.59	21.39 %
西南 证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中邮 证券	1	351,3 41,57 9.53	11.03 %	—	—	—	—	—	—	319,8 62.47	11.03 %
中投 证券	1	139,9 53,61 1.13	4.39%	—	—	—	—	—	—	127,4 13.94	4.39%
宏源 证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：根据中国证监会的有关规定，我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。

13.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下基金2014年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	公司网站	2015-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“万通地产”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-01-09
3	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金2014年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2015-01-20

		公司网站	
4	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-01-27
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与诺亚正行开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-01-30
6	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-02-10
7	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-06
8	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-19
9	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-20
10	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-24
11	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之盛世A份额与盛世B份额终止上市的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-25
12	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金暂停申购、赎回、转换转入、转换转出、定期定额投资等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-26
13	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金分级期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2015-03-26
14	中欧盛世成长分级股票型证券投资基金2014年年度报告(正文)	公司网站	2015-03-27
15	中欧盛世成长分级股票型证券投资	《中国证券报》、《上海	2015-03-27

	资基金2014年年度报告(摘要)	证券报》、《证券时报》、 公司网站	
16	中欧盛世成长分级股票型证券投资 基金之盛世A份额与盛世B份额 终止上市的提示性公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-03-27
17	关于旗下基金调整交易所固定收 益品种估值方法的公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-03-28
18	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	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-01
19	中欧盛世成长股票型证券投资基 金(LOF)暂停大额申购、转换转 入、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-01
20	关于中欧盛世成长分级股票型证 券投资基金份额转换结果的公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-02
21	关于中欧盛世成长股票型证券 投资基金(LOF)调整交易限额的 公告	《中国证券报》、《上 海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-15
22	关于调整旗下部分基金持有“三 湘股份”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-15
23	中欧盛世成长股票型证券投资基 金(LOF)上市交易公告书	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-16
24	关于《中欧盛世成长股票型证券 投资基金(LOF)上市交易公告书》 的更正公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-18
25	中欧盛世成长股票型证券投资基 金(LOF)上市交易提示性公告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-21
26	中欧盛世成长股票型证券投资基 金(LOF)2015年第1季度报告	《中国证券报》、《上海 证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-04-22
27	中欧盛世成长股票型证券投资基	公司网站	2015-05-12

	金(LOF)更新招募说明书(2015年第1号)		
28	中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要(2015年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-05-12
29	中欧基金管理有限公司关于官网上直销平台支付宝客户费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-05-26
30	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销单笔最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-05-26
31	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“广电网络”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-03
32	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“湘电股份”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-03
33	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-10
34	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-10
35	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“湖北广电”股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-13
36	中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)恢复大额申购、转换转入、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-19
37	中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、转换转入、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-25
38	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2015-06-30

§ 14 备查文件目录

14.1 备查文件目录

- 1、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

14.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

14.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一五年八月二十六日