

中欧养老产业混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,454,902.44	83.39
其中:股票		53,454,902.44	83.39
2	固定收益投资	3,417,341.70	5.33
其中:债券		3,417,341.70	5.33
资产支持证券		-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产		-	-
6	其他资产	-	-
其中:买入返售金融资产		-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,979,717.29	10.89
8	其他资产	250,642.19	0.39
9	合计	64,102,603.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	33,632,988.08	55.94
C	电力、热力、燃气及生产供应业	2,181,000.00	3.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,247,137.50	8.73
G	交通运输、仓储和邮政业	6,027,526.86	10.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,838,250.00	3.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,806,000.00	4.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,722,000.00	2.86
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药、生物、健康产业服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计		53,454,902.44	88.80

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002024	苏宁电器	220,000	3,097,000.00	5.15
2	300326	奥翔药业	300,000	2,946,000.00	4.80
3	603885	开能健康	189,846	2,925,526.86	4.80
4	002226	大华股份	128,000	2,886,400.00	4.67
5	300079	华测检测	300,000	2,844,000.00	4.73
6	603948	华利新材	220,000	2,806,000.00	4.67
7	600872	中恒集团	100,000	2,800,000.00	4.66
8	603936	海康威视	200,000	2,548,000.00	4.24
9	603678	华彬集团	100,000	2,492,000.00	4.14
10	600886	国投电力	300,000	2,181,000.00	3.63

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,792.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	104,858.85
5	应收申购款	77,960.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	250,642.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因四舍五入原因,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。

§ 6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期初基金份额总额	53,801,603.93
报告期基金申购份额	6,349,335.51
减:报告期基金赎回份额	7,183,840.03
报告期基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	52,967,099.41
报告期末基金份额总额	52,967,099.41

注:总申购份额含红利再投、转换份额,总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人报告期内未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧养老产业混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧养老产业混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧养老产业混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧养老产业混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金管理人报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人办公场所。

8.3 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办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问,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 2018年07月19日

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的对冲股指期货合约,本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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,故不适用。

5.10.2 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,故不适用。

5.10.3 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,故不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中欧兴利债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
其中:股票		-	-
2	固定收益投资	3,000,000.00	100.00
其中:债券		3,000,000.00	100.00
资产支持证券		-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产		-	-
6	其他资产	-	-
其中:银行存款和结算备付金合计		-	-
7	其他资产	-	-
8	合计	3,000,000.00	100.00

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,792.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	104,858.85
5	应收申购款	77,960.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	250,642.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因四舍五入原因,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。

§ 6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期初基金份额总额	4,831,997,865.02
报告期基金申购份额	225,327.47
减:报告期基金赎回份额	66,109.20
报告期基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	4,831,172,719.19
报告期末基金份额总额	4,831,172,719.19

注:总申购份额含红利再投、转换份额,总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人报告期内未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者名称	报告期末持有基金份额变化情况		报告期末持有基金份额	
	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
机构 1	4,831,674,612.25	0.00	0.00	4,831,674,612.25

注:本基金和存在前一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,在市场供求变化的情况下,可能出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,本基金管理人将审慎跟进并审慎的应对,并在基金合同中约定了相应的风险控制措施,敬请投资者留意。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《中欧兴利债券型证券投资基金基金合同》

2、《中欧兴利债券型证券投资基金托管协议》

3、《中欧兴利债券型证券投资基金招募说明书》

4、《中欧兴利债券型证券投资基金法律意见书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金管理人报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人办公场所。

9.3 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办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问,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 2018年07月19日

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的对冲股指期货合约,本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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,故不适用。

5.10.2 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,故不适用。

5.10.3 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,故不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金为债券型基金,不涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,578.80
2	应收证券清算款	25,983,176.69
3	应收股利	-
4	应收利息	111,311,176.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	137,320,929.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因四舍五入原因,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。

§ 6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期初基金份额总额	中收信用增利债券(LOF)C	中收信用增利债券(LOF)E
2,763,565.68	0.00	0.00
15,653,554.44	28.86	28.86
减:报告期基金赎回份额	-	-
报告期基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	69,767,196.18	142,724.42
报告期末基金份额总额	69,767,196.18	142,724.42

注:总申购份额含红利再投、转换份额,总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人报告期内未持有本基金基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者名称	报告期末持有基金份额变化情况		报告期末持有基金份额	
	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
机构 1	51,564,914.29	0.00	0.00	51,564,914.29

注:本基金和存在前一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,在市场供求变化的情况下,可能出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,本基金管理人将审慎跟进并审慎的应对,并在基金合同中约定了相应的风险控制措施,敬请投资者留意。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》

2、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)托管协议》

3、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》

4、《中欧信用增利债券型证券投资基金法律意见书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金管理人报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人办公场所。

9.3 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办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问,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 2018年07月19日

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的对冲股指期货合约,本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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,故不适用。

5.10.2 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,故不适用。

5.10.3 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,故不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金为债券型基金,不涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,300.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,488,697.19
5	应收申购款	1,010.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,498,008.01

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因四舍五入原因,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。

§ 6 开放式基金份额变动 单位:份

报告期初基金份额总额	中收信用增利债券(LOF)C	中收信用增利债券(LOF)E
2,763,565.68	0.00	0.00
15,653,554.44	28.86	28.86
减:报告期基金赎回份额	-	-
报告期基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	69,767,196.18	142,724.42
报告期末基金份额总额	69,767,196.18	142,724.42

注:总申购份额含红利再投、转换份额,总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人报告期内未持有本基金基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者名称	报告期末持有基金份额变化情况		报告期末持有基金份额	
	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
机构 1	51,564,914.29	0.00	0.00	51,564,914.29

注:本基金和存在前一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,在市场供求变化的情况下,可能出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情况,本基金管理人将审慎跟进并审慎的应对,并在基金合同中约定了相应的风险控制措施,敬请投资者留意。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》

2、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)托管协议》

3、《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》

4、《中欧信用增利债券型证券投资基金法律意见书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金管理人报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人办公场所。

9.3 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办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问,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 2018年07月19日

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五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国债债券	3,417,341.70	5.68
2	央行票据		