中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 07 月 19 日

§ 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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 7 月 18 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。
本报告期自 2018 年 04 月 01 日起至 2018 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧电子信息产业沪港深股票	
基金主代码	004616	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017年 07 月 07 日	
报告期末基金份额总额	98,460,155.85 份	
投资目标	本基金主要投资于电子信息产业相关行业股票,在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置,确定股票、债券、现金的投资比例,重点通过跟踪宏观经济数据、包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等)和政策环境的变化趋势,采摘首题性的战略判断,本基金为股票型基金,长期来看将以权益性资产为主要配置,同时结合资金面情况,市场情绪面因素,进行短期的战术避险选择。	
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率× 65%+ 恒生指数收益率× 20%+ 中证综合债券指数收益率× 15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金和混合型基金,属于较高预期收益和较高预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧电子信息产业沪港深股票 A	中欧电子信息产业沪港深股票 C
下属分级基金的交易代码	004616	005763
报告期末下属分级基金的份额总额	98,314,210.90 份	145,944.95 份

注:自 2018 年 4 月 23 日起,本基金在现有份额的基础上增加 C 类基金份额,原份额转为 A 类基金份额。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 04 月 01 日 - 2018 年 06 月 30 日)	
	中欧电子信息产业沪港深股票 A	中欧电子信息产业沪港深股票 C
1.本期已实现收益	- 1,319,463.56	1,098.73
2.本期利润	- 12,981,387.23	- 29,578.34
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.1968	- 0.0631
4.期末基金资产净值	96,059,696.67	150,173.84
5.期末基金份额净值	0.9771	1.0290

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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中欧电子信息产业沪港深股票 A 净值表现

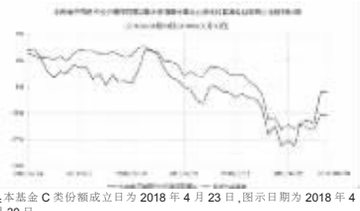
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 20.54%	2.13%	- 13.78%	1.29%	- 6.76%	0.84%

中欧电子信息产业沪港深股票 C 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金份额运作日至今	- 6.02%	2.19%	- 10.29%	1.33%	4.27%	0.86%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基金合同生效日期为 2017 年 7 月 7 日,自基金合同生效日起到本报告期末不满一年,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同约定。



注:本基金 C 类份额成立日为 2018 年 4 月 23 日,图示日期为 2018 年 4 月 24 日至 2018 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘晨	基金经理	2017- 07- 07	-	10年	历任中国国际金融有限公司资产管理部经理,方正富邦基金管理有限公司研究员、基金经理,永赢基金管理有限公司投资经理。2014- 08- 01 加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司研究员
曲径	策略组负责人、基金经理	2017- 11- 17	-	11年	历任千禧年基金量化基金经理、中信证券股份有限公司另类投资业务投资经理副总裁。2015- 04- 01 加入中欧基金管理有限公司。

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2018 年上半年,如在 2017 年报中所预判的,宏观经济边际增速减缓,一季度创新类资产出现了第一次重估,但由于中国经济相对较强的韧性和美国仍处于扩张周期的中后段,在中美国债收益率不断攀升的环境下,二季度创新类资产定价又出现了一定波动。虽然市场整体在无风险利率上行和摩擦降低风险偏好的情况下出现一定下滑,但总体来看,伴随去杠杆成果相对显著,未来一个季度可以对市场保持比较乐观的态度,尤其是创新类资产。但展望四季度之后的情况,仍需要观察我国房地产行业的下滑速度以及政府的容忍度,同时,美国经济一旦扩张结束带来的尾部风险也需重点观察。

回归 TMT 内部,我们认为板块内部仍将出现大量的结构性机会,主要会集中在社会发展所追求的高效率子领域,如人工智能、5G、大数据、半导体、物联网等。相比上半年,由于其他大类行业的业绩增速将出现下滑且估值处于历史较高的位置,TMT 整体上合理偏低的估值和长周期的景气可能使得其获得较好的相对收益。我们仍将聚焦在 TMT 板块内的领先公司的业绩研究上,以"自下而上"的方法为客户获得超额收益。

长期看,TMT 集中了中国产业转型升级的核心产业,无论汽车电子、半导体、5G 等方向必将是中国未来 10 年的核心竞争力,我们对此充满信心。自下而上看,我们也不断发现中国企业的创新能力,研发水平不断提高,结合"工程师红利",我们认为中国资本市场会出现一批更大更强的 TMT 核心资产。

具体投资方向上,我们全年将主抓 TMT 内部的蓝筹行情,以企业的竞争壁垒为核心,业绩和估值的匹配度为其次,精选个股。此外,对于未来 3 年明确看好的半导体、5G、智能制造、大数据和人工智能在把握安全边际的前提下进行投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A 级份额净值增长率为 -20.54%,同期业绩比较基准收益率为 -13.78%;C 类份额净值增长率为 -6.02%,同期业绩比较基准收益率为 -10.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	90,838,599.84	93.56
	其中:股票	90,838,599.84	93.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	5,234,072.93	5.39
8	其他资产	1,017,882.06	1.05
9	合计	97,090,554.83	100.00

注:权益投资中通过港股机制的公允价值为 661,273.68 元,占基金总资产比例 0.68。

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	59,944,266.48	62.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,233,059.68	31.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	90,177,326.16	93.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%)
信息技术	661,273.68	0.69
合计	661,273.68	0.69

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	300170	汉得信息	601,907	9,774,969.68	10.16
2	002371	北方华创	196,051	9,737,853.17	10.12
3	603019	中科曙光	203,053	9,314,041.11	9.68
4	000938	紫光股份	137,300	8,594,980.00	8.93
5	000977	浪潮信息	351,120	8,374,212.00	8.70
6	600271	航天信息	318,600	8,051,022.00	8.37
7	600588	用友网络	327,700	8,031,927.00	8.35
8	300661	圣邦股份	29,500	3,632,925.00	3.78
9	300183	东软载波	207,900	3,195,423.00	3.32
10	002065	东华软件	350,800	3,016,880.00	3.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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,故此项不适用。

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,故此项不适用。

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,故此项不适用。

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。

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	67,118.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,454.83
5	应收申购款	949,308.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,017,882.06

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

	中欧电子信息产业沪港深股票 A	中欧电子信息产业沪港深股票 C
报告期期初基金份额总额	35,279,499.26	0.00
报告期期间基金总申购份额	102,494,497.09	2,012,487.18
减:报告期期间基金总赎回份额	39,459,785.45	1,866,542.23
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期末基金份额总额	98,314,210.90	145,944.95

总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§ 7 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

单位:份

	中欧电子信息产业沪港深股票 A	中欧电子信息产业沪港深股票 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,124,840.30	0.00
报告期期间买入/申购总份额	-	136,998.81
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期末管理人持有的本基金份额	9,124,840.30	136,998.81
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	9.28	93.87

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申赎	2018- 04- 24	136,998.81	150,000.00	0.0000
合计			136,998.81	150,000.00	

本基金管理人于本报告期内通过中欧基金管理有限公司直销机构申购本基金,适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年 4 月 1 日至 2018 年 5 月 1 日	9,124,840.30	136,998.81	-	9,261,839.11	9.41%
产品持有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,并在基金运作中对流动性进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。							

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.中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金相关批准文件
2.《中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金基金合同》
3.《中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金托管协议》
4.《中欧电子信息产业沪港深股票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.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

9.2 存放地点
基金管理人的办公场所。

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
2018 年 07 月 19 日

中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

2018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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 07 月 19 日

§ 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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 7 月 18 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。
本报告期自 2018 年 04 月 01 日起至 2018 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧睿尚定期开放混合
基金主代码	001615
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2015年 09 月 02 日
报告期末基金份额总额	243,176,736.45 份
投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超额收益。
投资策略	本基金以 36 个月为一个运作周期,本基金在每个运作周期前确定大类资产初始配比,并在积极管理期书中列示,每个运作周期的前 3 个月为建仓期,力争在建仓期结束时达到大类资产初始配比目标,达到初始配比目标后除证券价格波动等客观因素影响大类资产配比,不做频繁的主动大类资产配置调整。通过上述投资方法,一方面使得本基金投资组合的风险收益特征较为明晰,另一方面通过期初较大比例投资于债券类资产为权益投资的波动提供安全垫,以争取为组合实现本金安全,同时以有限比例投资于权益类资产而保有对股票市场一定的暴露度,以争取为组合创造超额收益
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率 +1.5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益风险水平的投资品种。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 04 月 01 日 - 2018 年 06 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,187,825.84
2.本期利润	90,383.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004
4.期末基金资产净值	258,959,733.02
5.期末基金份额净值	1.065

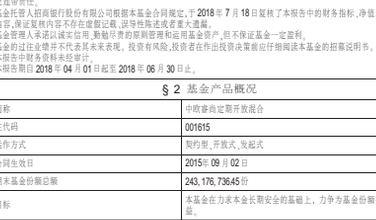
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.09%	1.06%	0.01%	- 1.06%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙倩倩	基金经理	2016- 06- 24	-	7年	历任招商证券策略研究分析师、债券研究分析师。2015- 11- 16 加入中欧基金管理有限公司。
周晶	基金经理	2016- 12- 01	-	11年	历任银华基金管理有限公司能源、家电、旅游行业分析师、大宗商品研究组组长、基金经理助理、基金经理。2015- 05- 11 加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司基金经理助理

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

考虑到目前实体经济增速仍较为稳定,企业盈利水平仍然保持在高位,公开发行的城投债务亦无违约实例,我们认为目前尚未到信用风险全面爆发的阶段。未来仍要且行且珍惜。

总体而言,实体层面,受到去杠杆政策影响,基建同比增速降至低点。尽管调控政策愈发加码,居民的强烈预期却将房地产销售、投资指标维持在较高水平,因此黑色产业链所反映出现的实体经济开工情况并不弱。经济有下行,却无 2015 年断崖式下行的迹象。随着信用违约事件持续不断爆发,整个境内金融市场的风险偏好降到了极低水平。在权重股利润不断创出新高的情况下,A 股指数却降至接近"股灾"时的阶段性低点,为了维持金融资产价格的稳定,货币当局为金融市场提供了充足的流动性,并缓和了对金融体系的去杠杆力度。这种环境极为有利于长久期利率品和高等级信用债,不利于权益品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为 0.00%,同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,712,089.93	2.70
	其中:股票	11,712,089.93	2.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	330,342,648.74	76.27
	其中:债券	305,134,887.10	70.45
	资产支持证券	25,207,761.64	5.82
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	39,950,149.93	9.22
	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	43,131,894.05	9.96
8	其他资产	7,969,642.24	1.84
9	合计	433,106,424.89	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	691,120.00	0.27
C	制造业	6,867,749.68	2.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,518,947.25	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	503,476.00	0.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,130,797.00	0.82
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,712,089.93	4.52

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	603008	喜临门	142,056	2,809,867.68	1.09
2	600048	保利地产	117,500	1,433,500.00	0.55
3	603708	家家悦	48,275	1,061,567.25	0.41
4	002327	富安娜	90,100	976,684.00	0.38
5	000858	五粮液	12,600	957,600.00	0.37
6	600188	兖州煤业	53,000	691,120.00	0.27
7	603517	绝味食品	14,500	615,525.00	0.24
8	603877	太平鸟	16,800	559,944.00	0.22
9	300059	东方财富	38,200	503,476.00	0.19
10	000333	美的集团	9,200	480,424.00	0.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,487,000.00	4.05
	其中:政策性金融债	10,487,000.00	4.05
4	企业债券	234,202,887.10	90.44
5	企业短期融资券	10,007,000.00	3.86
6	中期票据	50,438,000.00	19.48
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	305,134,887.10	117.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101653039	16陕钢铁 MTN003	200,000	20,136,000.00	7.78
2	143271	17南铝债	200,000	19,922,000.00	7.69
3	136457	16泰航 01	200,000	19,814,000.00	7.65
4	112501	17东江 G1	150,000	14,907,000.00	5.76
5	112499	17欣容 01	150,000	14,790,000.00	5.71

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123591	禾信气 05	100,000	10,328,702.74	3.99
2	131849	16远东 3B	100,000	9,879,058.90	3.81
3	142492	16旺新 1B	50,000	5,000,000.00	1.93

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

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 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。

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,故此项不适用。

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,故此项不适用。

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,故此项不适用。

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。

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	60,549.39
2	应收证券清算款	199,250.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,709,842.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,969,642.24

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	243,176,736.45
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	243,176,736.45

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§ 7 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,900.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	10,009,900.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.12

注:申购总份额包含红利再投份额、转换入份额,赎回总份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回及买卖本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,900.00	4.12%	10,009,900.00	4.12%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,009,900.00	4.12%	10,009,900.00	4.12%	三年

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金相关批准文件
2.《中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
3.《中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
4.《中欧睿尚定期开放混合型发起式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.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

9.2 存放地点
基金管理人的办公场所。

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