

中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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

1 重要提示
基金管理人承诺:严格遵守国家法律法规...
2 基金基本情况
2.1 基金名称:中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金

5.1 报告期内本基金托管人遵循诚信守约...
5.2 报告期内,中国建设银行股份有限公司...
5.3 托管人对报告期内本基金投资运作...
5.4 报告期内,本基金实施侧袋机制...

资产负债表
单位:人民币元
资产:货币资金 7,596,907.51
负债:应付赎回款 4,461,838.92

主要会计数据和财务指标
单位:人民币元
3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 基金净值表现

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...
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者(为期末余额,不取当期发生额)...

中欧成长优选混合 A
业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证500指数收益率*40%

中欧成长优选混合 E
业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证500指数收益率*40%

3.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目:一、期初所有者权益 3,041,676.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目:一、期初所有者权益 3,041,676.64

6.4 基金基本情况
6.4.1 基金名称:中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金
6.4.2 基金管理人:中欧基金管理有限公司

6.4.3 基金管理人:中欧基金管理有限公司
6.4.4 基金托管人:中国建设银行股份有限公司
6.4.5 基金募集:本基金经中国证监会2016年2月15日证监许可[2016]767号文核准...

6.7.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
6.7.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
6.7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

6.7.1 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(%)

6.7.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
6.7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
金额单位:人民币元

6.7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元)

6.8.1.1 股票交易
6.8.1.2 权证交易
6.8.1.3 债券交易
6.8.1.4 债券回购交易

6.8.2 关联方报酬
6.8.2.1 基金管理费
6.8.2.2 基金托管费
6.8.2.3 销售服务费

6.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
6.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.8.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.8.4.2 基金托管费
6.8.4.3 销售服务费
6.8.4.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.8.4.5 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.8.4.6 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
6.8.4.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.8.4.8 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.8.4.9 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
6.8.4.10 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.8.4.11 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.8.4.12 基金托管费
6.8.4.13 销售服务费
6.8.4.14 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.8.4.15 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.8.4.16 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
6.8.4.17 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金投资的招商银行(600036.SH)于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会发出的行政处罚信息公开表(银监罚字决[2018]1号)...

7.12.2 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。
7.12.3 期末其他各项资产构成

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.6 基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
7.12.7 基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
7.12.8 基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.2 期末基金管理人从业人数情况
8.3 期末基金管理人从业人数持有基金份额情况

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况
8.6 发起式基金发起资金持有份额情况

8.7 总申购份额含红利再投、转换入份额、总额回份额转换转出份额。
8.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况
8.9 开放式基金申购赎回情况

8.10 重大事件揭示
8.11 基金份额持有人大会决议
8.12 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

8.13 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
8.14 基金投资策略的改变
8.15 为基金进行审计的会计师事务所情况

8.16 报告期内,本基金新增国盛证券深圳交易单元。
8.17 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况

8.18 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况
8.19 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况

8.20 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况
8.21 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况

8.22 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况
8.23 基金租用证券公司交易单元进行证券投资的情况

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
7.10.2 股指期货持仓和损益明细

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.11.1 本期国债期货投资政策
7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

7.12 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细
7.12.1 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细
7.12.2 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细

7.13 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.13.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.13.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.14.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.14.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.15 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.15.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.15.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.16 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.16.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.16.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.17 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.17.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.17.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.18 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.18.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.18.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.19 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.19.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.19.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.20 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.20.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.20.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.21 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.21.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.21.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细

7.22 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明
7.22.1 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细
7.22.2 报告期末本基金投资的衍生品持仓和损益明细