

中欧嘉泽灵活配置混合型证券投资基金

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
基金合同生效日期：2018年03月26日

基金资产		期末余额
		2018年06月30日
银行存款		397,381,104.84
结算备付金		277,642.00
存出保证金		146,712.00
应收申购款项		179,856,964.65
其他资产		143,736,469.00
负债和所有者权益		30,060,000.00
资产支持证券		-
应付账款		-
其他负债		-
所有者权益		269,230,000.00
实收资本		2,287.49
未分配利润		266,942,512.51

2.1 基金基本情况

基金名称：中欧嘉泽灵活配置混合型证券投资基金
基金代码：004423
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
基金合同生效日期：2018年03月26日
基金管理人地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号
基金托管人地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座11层
基金合同生效日期：2018年03月26日

2.2 基金产品说明

投资目标：本基金将在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略：本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%
风险收益特征：本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于纯债型基金，低于股票型基金。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的业绩比较基准一致。

2.3 基金管理人及基金托管人

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

注：1. 报告期内基金投资业绩与同期业绩比较基准的偏离度
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

主要会计数据和财务指标		金额单位：人民币元
3.1 期间数据		
报告期	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年12月31日
本报告期	-28,009,112.20	-
本报告期末	-	30,060,000.00
上年度末	-	-
本报告期基金份额净值增长率	-5.06%	-
上年度末基金份额净值	1.0000	1.0000
本报告期末基金份额净值	0.9494	-
本报告期基金份额持有人户数	529,432,121	529,432,121
本报告期末基金份额持有人户数	529,432,121	529,432,121
本报告期末基金份额持有人户数	529,432,121	529,432,121

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。
注：2. 本报告期末公允价值变动未实现资产/负债中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低/孰高/期末余额，不是当期发生数。
注：3. 上述基金业绩指标不包括基金申购赎回及基金转换的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
注：4. 本基金合同于2018年1月26日生效，合同生效当期相关数据和指标按实际发生数据列示。

3.2 基金净值表现

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

期间	中欧嘉泽灵活配置混合型证券投资基金	业绩比较基准	超额收益
过去一个月	-0.07%	0.07%	-0.14%
过去三个月	-0.00%	0.71%	-0.71%
过去六个月	-0.04%	0.62%	-0.66%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%+恒生指数收益率×10%。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 本基金合同生效以来基金份额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

项目		本期	上期
		2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		-22,044,006.87	-
1.利息收入		2,325,497.01	-
2.投资收益		904,560,000.00	-
3.公允价值变动收益		303,048.06	-
4.其他收入		1,066,133.84	-
二、费用		-11,229,180.04	-
1.销售费用		-13,077,097.94	-
2.管理费用		-	-
3.其他费用		-	-
三、利润总额		-10,718,513.86	-
四、净利润		-10,718,513.86	-

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

3.3 基金投资组合报告

3.3.1 基金资产组合情况

项目	金额
权益投资	594,428,234.04
固定收益投资	-
金融资产公允价值变动损益	-28,009,112.20
其他资产	179,856,964.65
负债	30,060,000.00

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

3.4 报告期内基金投资业绩与同期业绩比较基准的偏离度

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

3.5 基金管理人及基金托管人

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

2018年半年度报告摘要

代码	名称	公允价值	公允价值占基金资产净值比例
000001	平安银行	13,496,764.00	2.63
000297	广汽集团	11,391,262.20	2.26
601088	中国神华	13,328,570.00	2.62
000002	万科A	12,264,262.87	2.41
000061	长安汽车	12,502,398.14	2.40
000079	招商局A	12,400,464.00	2.42
000416	际华集团	12,793,467.40	2.46
601388	蚂蚁金服	12,493,000.00	2.36
002226	华信软件	12,020,649.00	2.39
000028	中国石化	12,264,262.87	2.39
000271	广汇能源	11,866,280.00	2.34
601111	中国航航	11,268,096.22	2.23
000003	中国联通	11,796,048.00	2.33
000887	伊泰煤炭	11,281,200.21	2.21
601398	工商银行	11,313,230.30	2.24
000001	平安银行	10,300,000.00	2.09
000033	荣信股份	10,508,519.04	2.09

注：1. 买入金额均按买入成交金额（成交价款乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
注：2. 卖出金额均按卖出成交金额（成交价款乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
注：3. 买入股票的成本及卖出股票的收入总额
注：4. 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

序号	债券代码	债券名称	公允价值	公允价值占基金资产净值比例
1	000022	白云山	26,141,932.07	4.76
2	000029	招商局A	21,364,262.87	4.14
3	101016	中国石化可转债	19,180,857.67	3.62
4	000061	长安汽车	17,026,398.14	3.22
5	601388	蚂蚁金服	16,994,400.00	3.21
6	601398	工商银行	16,014,864.00	3.10
7	000079	招商局A	16,461,416.83	3.11
8	000002	万科A	15,607,800.00	2.99
9	600000	浦发银行	15,640,727.00	2.98
10	300170	中信建投	14,713,061.36	2.89
11	000179	中航光电	13,268,797.00	2.52
12	000048	保利地产	11,991,723.00	2.29
13	000398	工商银行	11,268,000.00	2.26
14	000028	中国石化	11,264,262.87	2.26
15	000001	平安银行	11,796,048.00	2.21
16	000000	浦发银行	11,666,416.20	2.21
17	300033	荣信股份	11,508,477.64	2.18
18	601088	中国神华	11,600,766.00	2.20
19	000226	华信软件	10,800,727.00	2.04
20	000003	中国联通	11,268,096.22	2.21

注：1. 买入股票的成本及卖出股票的收入总额
注：2. 卖出股票的成本及买入股票的收入总额
注：3. 买入股票的成本及卖出股票的收入总额
注：4. 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

项目	本期	上期
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年12月31日
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

项目	本期	上期
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年12月31日
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。

项目	本期	上期
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年12月31日
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-
当期公允价值变动损益	3,074,317.07	-

注：1. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：2. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。
注：3. 本基金合同于2018年1月26日生效，故无上年度可比期间数据。