中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月24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10月23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07月01日起至2018年09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	112,617,966.05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,并在招募说明书中列示,每个运作周期的前3个月为建仓期,力争在建仓期结束前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07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-2,875,661.15
2.本期利润	-1,155,494.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0055
4.期末基金资产净值	119,169,428.67
5.期末基金份额净值	1.058

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	-0.66%	0.25%	1.07%	0.01%	-1.73%	0.24%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郭睿	基金经理	2018-07-12	-	8年	历任中国国际金融股份有限公司研究部高级经理。2015-07-15加入中欧基金管理有限公司,历任研究员
蒋雯文	基金经理	2018-07-12	-	7年	历任新际香港有限公司销售交易员,平安资产管理有限责任公司债券交易员,前海开源基金投资经理助理。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司交易员、基金经理助理
孙倩倩	基金经理	2016-06-24	2018-07-12	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	2018-07-13	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

固定收益方面:9月制造业PMI较8月下降0.5个百分点,大幅低于前值;贸易战影响逐渐显现,新出口订单连续4个月维持在荣枯线之下;内需的疲软仍未见好转,企业经营压力重,受房地产、基建低迷影响,制造业回暖力度不强,同时上游行业持续对下游挤压也不利制造业复苏,短期经济难看明显回暖。

随着经济基本面的逐渐走弱,叠加中美贸易战愈演愈烈导致外贸放缓预期强化,稳增长逐渐取代防风险,成为了今年经济工作的中心任务。随着经济工作中心的转移,货币政策基调也随之出现了调整,货币政策由中性偏紧转向了稳健中性,削峰填谷、熨平波动的货币政策导向和货币政策的结构性宽松被更好的执行;尤其是4月和7月两次超预期定向降准落地,让市场更加确认了货币政策的转向。如我们二季度预测,三季度初,资金面持续趋松,甚至出现了银行间市场7天回购利率与央行公开市场7天逆回购利率倒挂的情况。另一方面,由于去杠杆的持续推进和资管新规正式实施,机构的整体杠杆率呈现出平稳下降的趋势,使得市场整体流动性需求有所下降。如此一来,供给有所放松,而需求又边际下降,市场流动性整体就呈现出相对宽松的格局,反映在债券市场上就表现为短端利率(包括回购、存单等在内的广谱短端利率)较二季度出现了比较显著的下行,收益率曲线由去年的过度平坦化逐渐回归陡峭。

经济下行意味最终需求难以明显改善,叠加土地、人工、原材料价格上升带来的生产压力,特别是社保征管变化带来的潜在影响,企业的投资意愿,尤其是中长期投资意愿更加减弱。与此同时,经济下行背景下,出于资产安全性考虑,银行风险偏好下降,这导致民营企业、中小微企业的融资难度上升。如之前所预测,三季度信用违约事件依旧持续爆发,民企债券利差继续走阔,整个境内金融市场的风险偏好降到了极低水平。

本基金三季度通过市价减持、回售或者到期的方式,在信用风险集中爆发前,最大可能地降低了固定收益持仓中具有较大权益市场风险的品种(主要是股东在较高估值水平上进行大比例股权融资,并且业绩预期下行期的发行人)。本基金保持短久期固定收益品种加杠杆的策略,通过增加杠杆部分中高等级债券资产持仓的方式增厚收益。

权益方面:2018年三季度,受经济转型短期的不确定性、贸易摩擦加剧以及去杠杆等因素共同影响,经济增速的不确定性加大,市场整体大幅回调,但是板块内个股分化进一步加剧,具备稳定现金流、良好成长性、稳健业绩的公司均表现出了很好的防御性特征。整体来看,消费、医疗等上半年强势板块回调幅度更大,但回顾全年,上述板块和部分科技成长行业依旧获得明显的超额收益。

组合配置方面,在相关风险释放后,已进行整体加仓,以消费行业作为重点配置方向,加仓消费分级龙头和高成长性个股;同时买入了部分成长和周期龙头公司。

展望未来,短期内,虽然受到去杠杆、贸易摩擦等因素影响,股市调整幅度较大,但经济基本面总体呈现平稳的发展态势。回顾过去几年的供给侧改革,开始时一样是造成大量低端和过剩产能倒闭退出,但短暂的阵痛之后,迎来的经济发展会更加健康。在去杠杆过程中,更需要扩大内需、提振消费,消费行业相对受益;而在市场整体情绪偏弱的背景下,消费行业天然的防御性特征将会更加明显,稳健且持续的业绩增长是获取超额收益的有力支撑。配置方面将会延续之前的投资策略,消费升级和基础消费龙头共同配置。此外作为未来转型方向的新兴产业和估值处于底部、行业基本面发生变化或者能源安全方面的部分周期行业也会进行配置。

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-0.66%,同期业绩比较基准收益率为1.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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	24,408,481.65	20.32
	其中:股票	24,408,481.65	20.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	84,652,697.00	70.47
	其中:债券	84,652,697.00	70.47
	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	9,373,313.10	7.80
8	其他资产	1,694,203.11	1.41
9	合计	120,128,694.86	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	-	-
C	制造业	10,459,422.86	8.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	954,451.74	0.80
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,487,740.25	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	1,157,520.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,450,015.40	2.06
J	金融业	526,050.00	0.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,373,281.40	3.67
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	24,408,481.65	20.48

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	603708	家家悦	133,405	2,968,261.25	2.49
2	601888	中国国旅	37,670	2,562,313.40	2.15
3	300146	汤臣倍健	122,291	2,506,965.50	2.10
4	002127	南极电商	247,400	1,810,968.00	1.52
5	603589	口子窖	34,156	1,759,034.00	1.48
6	603883	老百姓	24,300	1,519,479.00	1.28
7	002235	安妮股份	207,081	1,259,052.48	1.06
8	600967	内蒙一机	86,300	1,194,392.00	1.00
9	600115	东方航空	206,700	1,157,520.00	0.97
10	002013	中航机电	125,900	1,057,560.00	0.89

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	30,853,000.00	25.89
	其中:政策性金融债	30,853,000.00	25.89
4	企业债券	43,523,697.00	36.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,276,000.00	8.62
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	84,652,697.00	71.04

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	180205	18国开05	100,000	10,459,000.00	8.78
2	180204	18国开04	100,000	10,291,000.00	8.64
3	101800265	18中铝MTN001	100,000	10,276,000.00	8.62
4	180208	18国开08	100,000	10,103,000.00	8.48
5	143020	17复药01	100,000	9,971,000.00	8.37

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18中铝MTN001的发行主体中国铝业股份有限公司兰州分公司于2017年10月19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》(银保监银罚决字〔2018〕1号)。中国铝业股份有限公司兰州分公司电解槽大修时产生的废阴极炭块(HW48 321-023-48)未按照国家有关规定向环保部门进行危险废物申请登记,违反了《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第五十三条第一款的规定。依据《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第七十五条第一款第二项、第二款,处以罚款10万元。

在上述公告公布后,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对18中铝MTN001(101800265.IB)的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。其余九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	51,391.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,642,811.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,694,203.11

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	198.41
减:报告期期间基金总赎回份额	130,558,968.81
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	112,617,966.05

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

单位:份

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	10,009,900.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

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

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	2018-09-05	-10,009,900.00	-10,650,533.60	0.0000
合计			-10,009,900.00	-10,650,533.60	

注: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赎回本基金,适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金已成立满三年,本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§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:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
2018年10月24日

中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月24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10月23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07月01日起至2018年09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	196,707,260.95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,来做前瞻性的战略判断。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	175,858,197.24份	20,849,063.71份

§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07月01日 - 2018年09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	-15,883,700.93	-833,645.51
2.本期利润	-3,706,190.93	-502,755.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0213	-0.0600
4.期末基金资产净值	176,270,967.44	22,089,927.83
5.期末基金份额净值	1.0023	1.0595

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

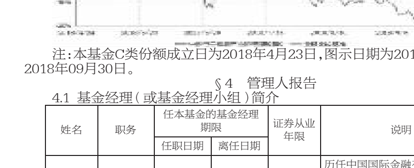
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.58%	2.24%	-6.62%	1.19%	9.20%	1.05%

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
过去三个月	2.96%	2.24%	-6.62%	1.19%	9.58%	1.05%

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,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09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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘晨	基金经理	2017-07-07	-	11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线高级副总裁。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

三季度投资集中在对中国经济进行效率增加部分的计算机板块,主要为工业互联网,云计算以及半导体等板块中的龙头优质公司。但临近季末时,在对全球半导体和云计算的研究中,我们发现市场对于其增长的预期过于乐观,且无论相对估值还是绝对估值都非常高,因此对持仓进行了较大程度的调整。选择了运营商和传媒等偏基础消费类的公司以试图回避较大的市场波动。

展望四季度,我们认为市场目前仍过于乐观,云计算和半导体公司可能面临中短期的需求增速下滑的困扰。此外,展望未来2-3个季度通胀可能会出现反复,对于现金流不足够好以及对客户议价能力较差的公司可能都会产生比较大的影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值增长率为2.58%,同期业绩比较基准收益率为-6.62%;C类份额净值增长率为2.96%,同期业绩比较基准收益率为-6.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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	166,599,301.33	79.87
	其中:股票	166,599,301.33	79.87
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	14,000,000.00	6.71
	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	23,886,882.78	11.45
8	其他资产	4,094,329.47	1.96
9	合计	208,580,513.58	100.00

注:权益投资中通过港股机制的公允价值为60,452,705.81元,占基金总资产比例29.98%。

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	20,136,517.33	10.15
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	19,605,662.48	9.88
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	18,404,546.66	9.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,541,785.32	9.85
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	28,458,083.73	14.35
S	综合	-	-
	合计	106,146,595.52	53.51

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)	占基金资产净值比例(%)
通信服务	60,452,705.81	30.48
合计	60,452,705.81	30.48

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	002024	苏宁易购	1,454,426	19,605,662.48	9.88
2	002027	分众传媒	2,296,332	19,541,785.32	9.85
3	600050	中国联通	1,794,000	14,554,971.37	7.34
3	H00762	中国联通	805,308	4,485,565.56	2.26
4	601098	中南传媒	1,553,839	18,754,836.73	9.45
5	H00728	中国电信	4,532,000	15,513,060.93	7.82
6	H00941	中国移动	222,000	15,071,167.64	7.60
7	600406	国电南瑞	783,014	13,820,197.10	6.97
8	H00700	腾讯控股	36,400	10,352,154.18	5.22
9	002916	深南电路	105,179	7,500,314.49	3.78
10	601928	凤凰传媒	1,076,000	6,886,400.00	3.47

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	1,595,463.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	649.62
5	应收申购款	2,498,216.71
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,094,329.47

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	98,314,210.90	145,944.95
报告期期间基金总申购份额	341,479,721.69	37,940,772.37
减:报告期期间基金总赎回份额	263,935,735.35	17,237,653.61
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	175,858,197.24	20,849,063.71

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

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	136,998.81
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	9,124,840.30	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	136,998.81
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	0.66

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	2018-08-22	-9,124,840.30	-9,188,166.69	0.0050
合计			-9,124,840.30	-9,188,166.69	

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	序号	报告期内持有基金份额变化情况: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	报告期末持有基金情况:持有份额	份额占比
机构	1	2018年8月14日至2018年8月20日;2018年8月22日至2018年9月20日	0.00	54,328,368.58	54,328,368.58	0.00	0.00%
产品特有风险							
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10月24日

中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧盛世成长混合(LOF)		
基金主代码	166011		
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)		
基金合同生效日	2012年03月29日		
报告期末基金份额总额	536,072,794.03份		
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	本基金为混合型基金,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,低于股票型基金		
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		
下属分级基金的基金简称	中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
下属分级基金场内简称	中欧盛世	-	-
下属分级基金的交易代码	166011	001888	004233
报告期末下属分级基金的份额总额	526,678,765.88份	6,029,488.95份	3,364,539.20份

§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07月01日 - 2018年09月30日) 中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
1.本期已实现收益	-58,723,713.40	-676,536.22	-371,568.10
2.本期利润	-4,570,252.43	-32,793.34	-178,650.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0085	-0.0056	-0.0394
4.期末基金资产净值	613,726,454.04	7,050,492.23	3,890,190.67
5.期末基金份额净值	1.1653	1.1693	1.1562

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

中欧盛世成长混合(LOF)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	-0.76%	1.51%	-1.10%	1.02%	0.34%	0.49%

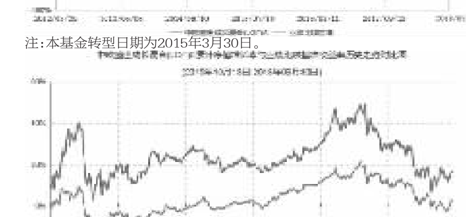
中欧盛世成长混合(LOF)E净值表现

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	-0.75%	1.51%	-1.10%	1.02%	0.35%	0.49%

中欧盛世成长混合(LOF)C净值表现

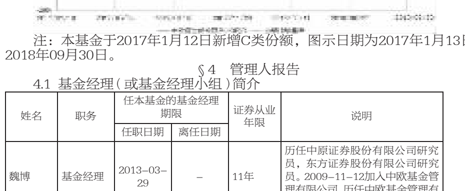
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.86%	1.51%	-1.10%	1.02%	0.24%	0.49%

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:本基金转型日期为2015年3月30日。

注:本基金于2015年10月8日新增E份额,图示日期为2015年10月13日至2018年09月30日。



注:本基金于2017年1月12日新增C类份额,图示日期为2017年1月13日至2018年09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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏博	基金经理	2013-03-29	-	11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。2009-11-12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兼研究员

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

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。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配置重点,根据行业景气度和标的价格的变化动态调整。

转型期和不可知论是盛世展望市场一贯的两个认知前提。宏观经济短期韧性增强,基于对美好生活的向往,社会化需求不断显现,传统行业发生变化的同时许多新的细分行业也在孕育和衍生。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,我们认为现阶段对内改革更为重要。未来一段时间政策执行力增强,解决社会现实问题的工具变多;进入深水区的改革,开始阶段显示出来的正向效果较多,其伴随的负作用如何化解,需要在实践中观察研究。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,选取我们能理解的行业,通过挖掘并耐心持有的策略来获取超额收益。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金A类份额净值增长率为-0.76%,同期业绩比较基准收益率为-1.10%;基金E类份额净值增长率为-0.75%,同期业绩比较基准收益率为-1.10%;基金C类份额净值增长率为-0.86%,同期业绩比较基准收益率为-1.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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	517,030,941.62	82.56
	其中:股票	517,030,941.62	82.56
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	60,000,000.00	9.58
	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	46,889,752.64	7.49
8	其他资产	2,360,769.42	0.38
9	合计	626,281,463.68	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	-	-
C	制造业	235,773,339.47	37.74
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	108,599,717.18	17.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,657,884.97	27.64
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	517,030,941.62	82.77

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	000661	长春高新	197,119	46,717,203.00	7.48
2	600038	中直股份	1,097,260	43,736,783.60	7.00
3	300253	卫宁健康	2,957,860	42,652,341.20	6.83
4	600893	航发动力	1,739,423	41,850,517.38	6.70
5	002007	华兰生物	1,047,382	39,695,777.80	6.35
6	601021	春秋航空	1,098,568	39,460,562.56	6.32
7	600570	恒生电子	702,588	38,789,883.48	6.21
8	002368	太极股份	1,223,429	37,449,161.69	6.00
9	603885	吉祥航空	2,783,842	36,913,744.92	5.91
10	601111	中国国航	3,954,038	32,225,409.70	5.16

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

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	466,702.60
2	应收证券清算款	1,811,526.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-34,119.32
5	应收申购款	116,659.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,360,769.42

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

	中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
报告期期初基金份额总额	547,134,551.98	5,607,936.34	5,510,426.03
报告期期间基金总申购份额	12,328,336.66	1,005,064.47	1,561,834.02
减:报告期期间基金总赎回份额	32,784,122.76	583,511.86	3,707,720.85
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	526,678,765.88	6,029,488.95	3,364,539.20

注:申购份额含红利再投、转换入份额,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

	中欧盛世成长混合(LOF)A	中欧盛世成长混合(LOF)E	中欧盛世成长混合(LOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	124,875.12
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	124,875.12
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	0.00	0.00

注:买入/申购总份额含红利再投、转换入份额,卖出/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

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	2018-08-22	-124,875.12	-140,147.35	0.0000
合计			-124,875.12	-140,147.35	

注: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赎回本基金,适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)相关批准文件
2、《中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
3、《中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》
4、《中欧盛世成长混合型证券投资基金(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

8.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

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10月24日