

信息披露 Disclosure

中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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：2019年01月22日

1.1 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2019年1月21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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或资产增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

本报告中所列数据截至2018年12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称 中欧达安混合

基金代码 004283

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 87,548,100.00份

投资目标 在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金管理人将运用多策略进行债券资产的投资，根据基本价值评估、经济周期和市场风险择时择券，力争在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%

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纯债型基金和货币型基金，但低于股票型基金，属于中等预期风险和预期收益水平的证券投资基金。

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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期末2018年10月01日至2018年12月31日

1.本期已实现收益 1,386,977.02

2.本期利润 780,303.88

3.期末可供分配基金份额利润 0.0090

4.期末基金净值 96,115,328.30

5.期末基金份额净值 1.0979

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买入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。

3.2.1 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 标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.79% 0.09% 0.52% 0.16% 0.27 -0.07

过去六个月 0.79% 0.09% 0.52% 0.16% 0.27 -0.07

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：2019年01月22日

1.1 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2019年1月21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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或资产增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

本报告中所列数据截至2018年12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称 中欧睿诚定期开放混合

基金代码 003150

基金运作方式 契约型、开放式

基金合同生效日 2016年12月01日

报告期末基金份额总额 283,598,792.00份

投资目标 本基金管理人将运用多策略进行债券资产的投资，根据基本价值评估、经济周期和市场风险择时择券，力争在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金管理人将运用多策略进行债券资产的投资，根据基本价值评估、经济周期和市场风险择时择券，力争在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

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纯债型基金和货币型基金，但低于股票型基金，属于中等预期风险和预期收益水平的证券投资基金。

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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期末2018年10月01日至2018年12月31日

1.本期已实现收益 -4,113,380.16

2.本期利润 -6,461,300.88

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0176

4.期末基金净值 342,107,064.62

5.期末基金份额净值 1.2229

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买入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 标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.65% 0.23% -0.94% 0.32% -0.71% -0.09%

过去六个月 -1.75% 0.23% -0.94% 0.32% -0.81% -0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来某基金资产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：本基金合同生效以来某基金资产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

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：2019年01月22日

1.1 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2019年1月21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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或资产增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

本报告中所列数据截至2018年12月31日止。

2 基金产品概况

基金名称 中欧睿诚定期开放混合

基金代码 003150

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 271,919,060.00份

投资目标 本基金管理人将运用多策略进行债券资产的投资，根据基本价值评估、经济周期和市场风险择时择券，力争在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金管理人将运用多策略进行债券资产的投资，根据基本价值评估、经济周期和市场风险择时择券，力争在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争取得超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

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纯债型基金和货币型基金，但低于股票型基金，属于中等预期风险和预期收益水平的证券投资基金。

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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期末2018年10月01日至2018年12月31日

1.本期已实现收益 -2,316,970.72

2.本期利润 -3,366,194.04

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0142

4.期末基金净值 146,333,896.40

5.期末基金份额净值 1.1171

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买入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 标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.17% 1.83% -0.91% 1.60% 4.74% 0.23%

中欧睿诚定期开放混合C净值表现

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12月31日。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

胡皓 基金经理 2017-4-10 - 11 历任中欧国际金融中心研究员（2007.3-2008.）、方正证券资产管理部研究员（2008.10-2011.1）、方正证券资产管理部基金经理（2011.10-2012.12）、中欧国际金融中心研究员（2013.1-2014.12）、中欧国际金融中心研究员（2015.1-2016.12）、中欧国际金融中心研究员（2017.1-2018.12）、中欧国际金融中心研究员（2019.1-至今）

注：1.任日期指聘任日期，一般情况下由公司董事会决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起担任，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守了《证券投资基金法》及其他各项法律法规、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、回报基金份额持有人的原则，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律法规及基金合同的约定，未发生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管控，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制公平执行，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

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有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期末基金的投资组合报告

4.4.1 资产配置情况

报告期末，本基金资产配置如下：股票投资占基金资产净值的比例为0.00%

4.4.2 行业配置情况

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.3 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.4 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.5 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.6 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.7 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.8 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.9 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.10 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.11 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.12 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.13 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.14 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.15 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.16 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.17 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.18 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.19 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.20 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.21 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.22 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.23 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.24 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.25 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.26 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.27 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.28 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.29 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.30 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.31 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.32 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.33 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.34 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.35 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.36 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.37 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.38 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.39 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.40 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.41 公允价值变动的公允价值

报告期末，本基金管理人管理的有投资组合不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.42 公允价值变动的公允价值