

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人兴业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。

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请仔细阅读基金的投资风险提示。

本报告期自2018年10月17日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧兴华债券
基金代码	005736
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2018年10月17日
报告期末基金总额	1,010,008,000.00份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金管理人将根据基金合同约定,结合宏观经济和市场环境,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。本基金管理人将根据基金合同约定,结合宏观经济和市场环境,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	6,044,984.97
2.本期利润	11,610,339.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	1,021,618,339.33
5.期末基金份额净值	1.0115

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

阶段	净值增长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
自基金合同生效至现在	1.15%	0.05%	1.60%	0.05%	-0.40%	0.00%

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	-12.52%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去六个月	-12.48%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去一年	-12.70%	1.59%	-0.85%	1.31%	-3.06%	0.28%

注:1.本基金合同生效以来,本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

3.2.2 本基金合同生效以来,本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:1.本基金合同生效以来,本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

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:2019年01月22日

§1 重要提示

基金管理人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。

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请仔细阅读基金的投资风险提示。

本报告期自2018年10月17日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧价值发现混合
基金代码	160605
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2008年07月24日
报告期末基金总额	6,428,096,066.69份
投资目标	本基金通过适当的资产配置策略和积极的投资选择,以合理的价格买入具有良好发展前景和成长性的股票,并辅以适当的债券配置,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略的核心在于通过积极的投资选择,以合理的价格买入具有良好发展前景和成长性的股票,并辅以适当的债券配置,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证综指收益率
风险收益特征	本基金的风险收益特征,预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-169,547,621.04
2.本期利润	-980,584,222.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1550
4.期末基金资产净值	10,003,766,062.33
5.期末基金份额净值	1.2776

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

阶段	净值增长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
自基金合同生效至现在	-12.52%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%

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	-12.52%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去六个月	-12.48%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去一年	-12.70%	1.59%	-0.85%	1.31%	-3.06%	0.28%

注:1.本基金合同生效以来,本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

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中信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。

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请仔细阅读基金的投资风险提示。

本报告期自2018年10月17日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧鼎利债券
基金代码	160610
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年09月18日
报告期末基金总额	230,017,468.87份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略的核心在于通过积极的投资选择,以合理的价格买入具有良好发展前景和成长性的股票,并辅以适当的债券配置,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	406,997.58
2.本期利润	184,753.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0007
4.期末基金资产净值	241,720,076.65
5.期末基金份额净值	1.0473

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

阶段	净值增长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
自基金合同生效至现在	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%

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	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%
过去六个月	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%
过去一年	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%

注:1.本基金合同生效以来,本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

基金管理人:中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22日

§1 重要提示

基金管理人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。

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请仔细阅读基金的投资风险提示。

本报告期自2018年10月17日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码	005736
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2018年10月17日
报告期末基金总额	1,010,008,000.00份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略的核心在于通过积极的投资选择,以合理的价格买入具有良好发展前景和成长性的股票,并辅以适当的债券配置,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	6,044,984.97
2.本期利润	11,610,339.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115
4.期末基金资产净值	1,021,618,339.33
5.期末基金份额净值	1.0115

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

阶段	净值增长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
自基金合同生效至现在	1.15%	0.05%	1.60%	0.05%	-0.40%	0.00%

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	-12.52%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去六个月	-12.48%	1.59%	-0.85%	1.31%	-2.87%	0.28%
过去一年	-12.70%	1.59%	-0.85%	1.31%	-3.06%	0.28%

注:1.本基金合同生效以来,本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

基金管理人:中欧鼎利债券型证券投资基金
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22日

§1 重要提示

基金管理人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。

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请仔细阅读基金的投资风险提示。

本报告期自2018年10月17日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧鼎利债券
基金代码	160610
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年09月18日
报告期末基金总额	230,017,468.87份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略的核心在于通过积极的投资选择,以合理的价格买入具有良好发展前景和成长性的股票,并辅以适当的债券配置,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月17日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	406,997.58
2.本期利润	184,753.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0007
4.期末基金资产净值	241,720,076.65
5.期末基金份额净值	1.0473

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

阶段	净值增长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
自基金合同生效至现在	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%

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	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%
过去六个月	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%
过去一年	-0.13%	0.11%	1.34%	0.16%	-1.47%	0.05%

注:1.本基金合同生效以来,本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

中欧价值发现混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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律法规和基金合同的约定,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。

4.3.1 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩变动分析

2018年四季度A股市场全面下跌。截至12月28日,上证50下跌12.03%,上证综指下跌11.61%,沪深300下跌12.46%,中小板指数下跌18.22%,创业板指数下跌11.39%。从行业来看,农林牧渔、食品饮料等行业表现较好,钢铁、采掘、医药、通信、食品饮料等板块表现较差。

2018年四季度市场的走势与年初处于非常悲观的状态,资金市场的利率高,几乎没有利好能够有反应,呈现明显的非理性状态。但作为理性的投资者,我们要看到积极的一面,从长远的角度来看,中国经济增长已经超越其他国家的增速,我们看好中国长期的发展前景,我们看好中国长期的发展前景,我们看好中国长期的发展前景。

4.5 报告期内基金A类基金份额净值表现

报告期内,基金A类基金份额净值增长率为-12.52%,同期业绩比较基准收益率为-0.85%,基金A类基金份额净值增长率为-12.07%,同期业绩比较基准收益率为-0.85%。

4.6 报告期内基金管理人人数或基金资产净值说明

报告期内,基金管理人人数或基金资产净值说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	10,060,968,504.14	91.36
2	基金投资	10,060,968,504.14	91.36
3	固定收益投资	7,598,000.00	0.07
4	资产支持证券	7,598,000.00	0.07
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	787,241,326.80	7.20
8	其他资产	84,579,227.85	0.77
9	合计	10,930,377,068.79	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股票投资组合

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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160196	757	240,314,595.39	3.76
2	600048	24,321	496,746,344.56	2.66
3	603040	11,030	280,722,585.65	2.61
4	000002	11,413	271,872,300.30	2.52
5	600036	10,475	263,967,438.40	2.46
6	600297	19,475	261,903,536.66	2.43
7	603138	4,519,213	253,527,849.30	2.35
8	601607	14,626	248,688,070.00	2.31
9	000856	4,962	246,538,102.68	2.29
10	601601	8,492,983	241,731,206.69	2.24

5.4 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债券投资明细

序号	债券代码	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600196	757	240,314,595.39	3.76
2	600048	24,321	496,746,344.56	2.66
3	603040	11,030	280,722,585.65	2.61
4	000002	11,413	271,872,300.30	2.52
5	600036	10,475	263,967,438.40	2.46
6	600297	19,475	261,903,536.66	2.43
7	603138	4,519,213	253,527,849.30	2.35
8	601607	14,626	248,688,070.00	2.31
9	000856	4,962	246,538,102.68	2.29
10	601601	8,492,983	241,731,206.69	2.24

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十名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160196	757	240,314,595.39	3.76
2	600048	24,321	496,746,344.56	2.66
3	603040	11,030	280,722,585.65	2.61
4	000002	11,413	271,872,300.30	2.52
5	600036	10,475	263,967,438.40	2.46
6	600297	19,475	261,903,536.66	2.43
7	603138	4,519,213	253,527,849.30	2.35
8	601607	14,626	248,688,070.00	2.31
9	000856			