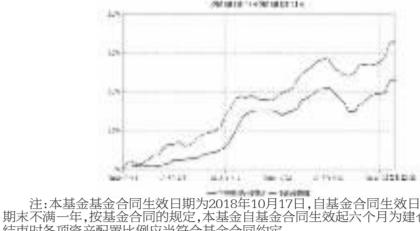


## 中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金

## 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：兴业银行股份有限公司  
报告送出日期：2019年01月22日  
§ 重要提示



基金管理人和基金托管人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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。本基金于2019年1月21日复核了报告期间的财务指标、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，也不保证最低收益。

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

基金主代码 005736

基金运作方式 约定的、开放式、发起式

基金合同生效日 2018年10月7日

报告期/期末基金份额总额 1,010,000,000.0000

投资目标 在严控信用风险的前提下，力争在风险与收益之间取得平衡，为投资者提供稳定的现金流和市场流动性。

投资策略 本基金将根据宏观经济、利率、信用、流动性等市场环境的变化，综合运用久期策略、期限策略、类属配置策略、信用策略、利率策略、回购策略、资产支持证券策略、利差策略、利率策略等增强组合收益。

业绩比较基准 中债新综合(财富)指数收益率\*60%+一年期定期存款利率(税后)\*40%

风险收益特征 本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金，风险收益特征属于中低风

险收益特征

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

单位：人民币元

报告期/期末 2018年10月17日～2018年12月31日

1.本期已实现收益 6,944,864.97

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.期末基金份额净值 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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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.本期利润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不计费用的利润。

3.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，费用影响较大时，基金的业绩表现会受到影响。

4.报告期利润指根据《证券投资基金运作管理办法》的规定，扣除交易费用、利息收入、手续费、交易费用、申购赎回费等环节后的余额，即为基金利润。

5.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。

本报告期利润未扣除评估费用。

6.报告期基金份额净值变动情况

7.报告期末基金份额总额

8.报告期末基金份额净值

9.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。