中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年03月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧睿诚定期开放混合	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	350,598,759.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C
下属分级基金的交易代码	003150	003151
报告期末下属分级基金的份额总额	334,438,005.63份	16,160,754.29份

2.2 基金产品说明

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越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期偏离策略,根据对利率水平的预期调整组合久期。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张燕
	联系电话	021-68609600	0755-83199084
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95555
传真		021-33830351	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年12月01日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C
本期已实现收益	3,399,014.72	37,962.83	31,727,249.69	1,199,353.88	994,945.61	31,334.35
本期利润	-4,096,110.05	-381,674.39	41,746,463.82	1,680,432.32	-1,354,647.82	-87,411.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0089	-0.0171	0.0409	0.0362	-0.0012	-0.0015
本期基金份额净值增长率	-2.00%	-2.42%	4.51%	4.20%	-0.12%	-0.15%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0229	0.0152	0.0361	0.0327	-0.0012	-0.0015
期末基金资产净值	342,107,054.62	16,406,804.34	672,964,252.64	29,461,476.15	1,143,095,623.44	57,758,716.49
期末基金份额净值	1.0229	1.0152	1.0438	1.0404	0.9988	0.9985

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额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 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

中欧睿诚定期开放混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.65%	0.23%	-0.94%	0.32%	-0.71%	-0.09%
过去六个月	-3.01%	0.26%	-0.81%	0.29%	-2.20%	-0.03%
过去一年	-2.00%	0.37%	-1.72%	0.26%	-0.28%	0.11%
自基金合同生效起至今	2.29%	0.29%	-2.82%	0.22%	5.11%	0.07%

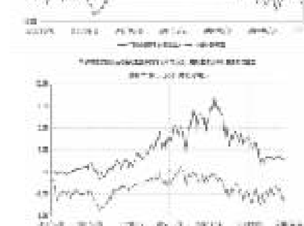
注:本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。比较基准每个交易日进行一次再平衡,每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡,使大类资产比例保持恒定。

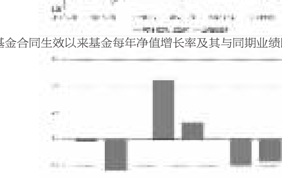
中欧睿诚定期开放混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.75%	0.23%	-0.94%	0.32%	-0.81%	-0.09%
过去六个月	-3.18%	0.26%	-0.81%	0.29%	-2.37%	-0.03%
过去一年	-2.42%	0.37%	-1.72%	0.26%	-0.70%	0.11%
自基金合同生效起至今	1.52%	0.29%	-2.82%	0.22%	4.34%	0.07%

注:本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。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比例进行大类资产之间的再平衡,使大类资产比例保持恒定。

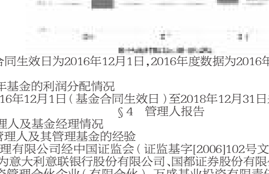
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同生效日为2016年12月1日,2016年度数据为2016年12月1日至2016年12月31日数据



注:本基金合同生效日为2016年12月1日,2016年度数据为2016年12月1日至2016年12月31日数据

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2016年12月1日(基金合同生效日)至2018年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会(证监基字[2006]102号文)批准,于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东,注册资本为2.20亿元人民币,旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理(上海)有限公司、中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司。截至2018年12月31日,本基金管理人共管理67只开放式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄华	策略组负责人、基金经理	2018-12-25	-	10	历任平安资产管理有限责任公司组合经理(2008.08-2012.06),中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理(2012.09-2014.07),中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人(2014.07-2016.11)。2016-11-10加入中欧基金管理有限公司,历任基金经理助理
蒋雯文	基金经理	2018-9-21	-	7	历任新际香港有限公司销售交易员(2009.06-2011.07),平安资产管理有限责任公司债券交易员(2013.09-2016.05),前海开源基金投资经理助理(2016.09-2016.10)。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司,历任交易员、基金经理助理
曲径	策略组负责人、基金经理	2016-12-1	-	12	历任千禧年基金量化基金经理(2006.12-2011.06),中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁(2011.07-2015.03)。2015-04-01加入中欧基金管理有限公司
尹诚庸	基金经理	2016-12-1	2018-9-21	7	历任招商证券股份有限公司固定收益总部研究员、投资经理(2011.09-2014.09)。2014-12-08加入中欧基金管理有限公司,历任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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规,公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。在投资决策方面,基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离;在交易执行方面,以系统控制和人工审阅相结合的方式,严控反向交易和同向交易;另外,中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控,监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估,定期进行公平交易的内部审计工作。

4.3.2 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。在公平交易稽核审计过程中,针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况,我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析,并与基金经理进行了沟通确认,从最终结果看,造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素,基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

固收方面:自2016年11月底以来金融监管趋严,监管机构先后出台系列规章制度,旨在规范和整治金融业乱象,2018年4月《资管新规》落地,银行理财持续高速增长的时代已经结束,银行表外资产逐渐回归表内,原有通过非银途径流入实体企业的渠道受阻,信用环境明显收缩,企业再融资压力加大。再融资的不畅,使金融机构风险偏好下降,单从信用债不同等级融资方面,2018年信用债不同等级间净融资额分化明显,AAA净融资额占比超90%,AA+净融资额大幅下滑,AA净融资额为负值;民企净融资方面,民企净融资额仅为429亿元,到期债务量较大叠加民企债发行难度较大,净融资额处于较低水平;上市公司违约方面,过去投资者对上市公司较为信任,主要基于上市公司具有良好的风险隔离机制,受到监管较为严格、治理相对规范,资产相对非上市公司较优、经营风险相对较低,随着上市公司违约增多,其信用风险明显提升,其资质需重新审视。主体违约的公司看,主要分布在一是依赖债务快速扩张,业务发展激进,造血能力较弱,到期偿债压力增大;二是实控人和控股股东股权质押比例高,股价持续下跌,强制平仓风险增大;三是多板块经营,主营优势不明显,盈利能力不突出的企业;四是非常规信息如实控人因素、企业互保、股权质押等冲击主体资质,诱发主体违约;五是行业周期下行,公司盈利能力出现下滑甚至亏损。本基金在2018年特别关注以上这类企业,通过回售,自然到期,二级卖出等方式降低违约风险。

2018年央行共实施四次定向降准,并于2019年初实行全面降准,幅度更强,释放资金量更大。纵观近几次降准,可以看出,央行的货币政策倾向于放宽信用,增加市场的流动性,支持商业银行解决在金融去杠杆背景下小微企业融资难的问题,使金融更好地服务于实体经济。经济下行确定,货币政策宽松,2018年三季度起,基金顺势而为地拉长久期和提高杠杆,持仓以AAA主体为主,主动规避信用资质不良的主体,取得了可观的业绩表现。

权益方面:回顾2018年,A股经历了年初短暂的上涨后,进入了持续下跌。上证指数全年下跌近25%,创2008年金融危机以来的最大跌幅。中美贸易摩擦产生的不确定性,叠加国内政策摇摆的环境,使得投资者对长期经济动能产生疑虑,资本市场对后市保有极度谨慎的情绪;海外市场来看,美国持续繁荣的确定性下降,美股与我们此前的判断一致,在下半年达到高点后,开始调整。美股的波动对所有新兴市场,包括A股在内,都将产生较大压力。另一方面,国内经济下行压力持续,我们认为2019年二季度之前,难以看到显著的复苏;即便货币政策在近期逐步宽松,仍难看到托底动作产生实质性效果。内部经济下行的压力结合海外市场的不确定性,我们认为股票市场短期大幅反转的概率不大。当前市场可对标2011年-2012年的A股,权益投资的收益将主要来自于个股研究的Alpha而非市场趋势的Beta。

4.4.2 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-2.00%,同期业绩比较基准收益率为-1.72%;C类份额净值增长率为-2.42%,同期业绩比较基准收益率为-1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收方面:考虑目前经济下行边际仍将企稳,货币宽松维持,"宽信用"效果尚未显现,期限利差压缩的债牛行情大概率仍可能持续到一两个季度,故未来在考虑负债稳定性前提下,适当拉长久期博取长端收益,从曲线走平中获得收益的策略仍可能持续。从历史表现看,我国的经济效益是属于刺激易见成效,货币宽松叠加财政刺激是否带动信用增速并拉动名义增速是我们会在2019年关注的重点。在各政策支持力度增强的情况下,预判19年基建投资将企稳回升,制造业投资稳定上行,构成固定资产总投资增速企稳。此时,资本的风险偏好将提升,债市则不宜期待过多的资本利得回报,会适时调整自身持仓,降低久期、适度下沉信用资质、加大杠杆套息力度。当然,2019年我们仍然担忧未来的债券违约事件。民营企业资质表现料将持续分化,低资质民营企业有较大的信用风险。对于多板块经营,且背负着较大的刚性债务的低资质民营企业,仍是2019年信用风险爆发的集中区,同时需要关注非常规因素对主体信用资质的冲击。中高等级民营企业受益于政策利好,其融资环境或将持续改善,或将带动民营企业信用利差出现下行;城投平台资质同样料将分化,资质较弱的县级和县级市城投平台在2019年或将是非标违约的集中区域,主要是县级和县级市城投平台所在地方政府支持意愿和支持能力都相对较弱。综合行业板块多元,造血能力未跟上,导致内部现金流持续净流出,叠加2019年对这类企业的再融资收紧或将持续,偿债压力快速上升。房地产行业,对于土地储备多位于非一二线的中小型民营房企,面临较大的去库存压力,自身资质较弱,外部融资渠道受阻,再融资压力较大,或有较大的违约风险。商业贸易行业中非零售业务无核心技术,利差单薄,大量垫资,短债运营业务,资金链高度紧绷。

权益方面:站在当前,我们维持2018年的判断,以大消费为首的蓝筹行情已经告一段落,即便经过近一年的调整,部分蓝筹股的估值依然高于历史中枢,叠加对公司业绩预期的下调,"戴维斯双杀"仍在进行中。另一方面,以计算机,5G通信,电力设备等行业为代表的成长股,具有一定的抗周期性,在盈利稳定的情况下进入了估值合理的区间;在下跌中,2019年股息率有望达到4%以上的个股,也体现出了配置价值。我们依据以上两个投资逻辑,进行了权益资产的配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定,有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理,成员包括总经理、督察长、投资总监,基金运营部总监,监察稽核部总监以及具备多年证券、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:基金日常估值由基金管理人进行,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以XBRL形式报给基金托管人,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	4,713,294.22	1,765,268.91
结算备付金	4,591,732.79	4,863,681.33
存出保证金	131,998.36	272,494.95
交易性金融资产	280,710,818.14	715,013,793.53
其中:股票投资	35,069,803.74	151,162,673.93
基金投资	-	-
债券投资	241,129,014.40	549,969,119.60
资产支持证券投资	4,512,000.00	13,882,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	64,980,297.47	-
应收证券清算款	-	6,371,725.00
应收利息	4,317,884.77	10,725,698.62
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	359,446,025.75	739,012,662.34
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	27,400,000.00
应付证券清算款	-	7,189,565.14
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	466,509.10	947,927.55
应付托管费	46,650.91	94,792.76
应付销售服务费	5,699.36	10,479.44
应付交易费用	88,836.65	627,554.68
应交税费	24,470.77	-
应付利息	-	-8,386.02
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	300,000.00	325,000.00
负债合计	932,166.79	36,586,933.55
所有者权益:		
实收基金	350,598,759.92	673,026,347.65
未分配利润	7,915,099.04	29,399,381.14
所有者权益合计	358,513,858.96	702,425,728.79
负债和所有者权益总计	359,446,025.75	739,012,662.34

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额总额350,598,759.92份。其中A类基金份额净值1.0229元,基金份额总额334,438,005.63份;C类基金份额净值1.0152元,基金份额总额16,160,754.29份。

7.2 利润表

会计主体:中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	7,528,871.51	68,667,816.17
1.利息收入	18,365,261.01	41,897,023.75
其中:存款利息收入	163,065.19	13,415,333.57
债券利息收入	16,535,700.63	26,188,227.77
资产支持证券利息收入	472,964.91	735,840.30
买入返售金融资产收入	1,193,530.28	1,557,622.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-3,772,880.86	13,999,216.96
其中:股票投资收益	-4,363,378.30	13,772,016.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-318,272.31	-1,222,169.46
资产支持证券投资收益	18,311.48	11,653.83
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-990,880.00
股利收益	890,458.27	2,428,595.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,914,761.99	10,500,292.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	851,253.35	2,271,282.89
减:二、费用	12,006,655.95	25,240,920.03
1. 管理人报酬	7,597,888.83	16,259,253.76
2. 托管费	759,788.90	1,625,925.33
3. 销售服务费	93,497.56	188,490.50
4. 交易费用	2,336,961.33	5,225,684.64
5. 利息支出	812,511.04	1,590,911.89
其中:卖出回购金融资产支出	812,511.04	1,590,911.89
6. 税金及附加	49,863.82	-
7. 其他费用	356,144.47	350,653.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-4,477,784.44	43,426,896.14
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-4,477,784.44	43,426,896.14

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	673,026,347.65	29,399,381.14	702,425,728.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,477,784.44	-4,477,784.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-322,427,587.73	-17,006,497.66	-339,434,085.39
其中:1.基金申购款	525,649.30	31,150.46	556,799.76
2.基金赎回款	-322,953,237.03	-17,037,648.12	-339,990,885.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	350,598,759.92	7,915,099.04	358,513,858.96
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,202,296,399.58	-1,442,059.65	1,200,854,339.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,426,896.14	43,426,896.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-529,270,051.93	-12,585,455.35	-541,855,507.28
其中:1.基金申购款	367,325.38	2,538.99	369,864.37
2.基金赎回款	-529,637,377.31	-12,587,994.34	-542,225,371.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	673,026,347.65	29,399,381.14	702,425,728.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]1552号《关于准予中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,202,296,399.58份基金份额,其中认购资金利息折合743,071.10份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。A类基金份额和C类基金份额分别设置代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放方式运作。本基金每3个月开放一次,每次开放期不少于3个工作日且最长不超过10个工作日,每个开放期的首日为基金合同生效日的每3个月月度对日,若该日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一工作日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2019年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司("北京百骏")	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a ("意大利意联银行")	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)("上海睦亿合伙")	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司("中欧盛世资管")	基金管理人的控股子公司
中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司("钱滚滚")	基金管理人的控股子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	1,103,924,506.37	73.63%	3,437,747,515.77	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国都证券	214,948,090.86	79.91%	499,155,527.49	100.00%

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	3,826,300,000.00	45.21%	7,677,100,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	1,028,091.99	73.63%	28,537.64	33.02%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	3,201,582.08	100.00%	626,379.68	100.00%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,597,888.83	16,259,253.76
其中:支付销售机构的客户维护费	4,382,289.84	9,423,357.26

注:支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	759,788.90	1,625,925.33

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	93,013.16	93,013.16
国都证券	0.00	454.91	454.91
合计	0.00	93,468.07	93,468.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	183,711.28	183,711.28
国都证券	0.00	4,779.22	4,779.22
合计	0.00	188,490.50	188,490.50

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%,销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.40%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人,由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间,基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

中欧睿诚定期开放混合A

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	6,003.98	0.00%	6,003.98	0.00%

注:

1、截止本报告期末,本基金自然人股东持有本基金A类份额的比例为0.0018%,上年度期末自然人股东持有本基金A类份额实际占比为0.0009%,上表展示为四舍五入结果。

2、本报告期及上年度可比期间,除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,713,294.22	90,278.07	1,765,268.91	314,444.24

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为35,838,662.74元,属于第二层次的余额为244,872,155.40元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次151,095,702.25元,第二层次563,918,091.28元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	35,069,803.74	9.76
	其中:股票	35,069,803.74	9.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	245,641,014.40	68.34
	其中:债券	241,129,014.40	67.08
	资产支持证券	4,512,000.00	1.26
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	64,980,297.47	18.08
	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	9,305,027.01	2.59
8	其他各项资产	4,449,883.13	1.24
9	合计	359,446,025.75	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,149,105.00	0.60
C	制造业	13,807,107.40	3.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,840,692.00	0.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,043,210.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,692,827.40	1.31
J	金融业	2,697,921.90	0.75
K	房地产业	4,251,456.00	1.19
L	租赁和商务服务业	579.04	0.00
M	科学研究和技术服务业	3,586,905.00	1.00
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	35,069,803.74	9.78

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位:人民币元

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	600585	海螺水泥	174,600	5,112,288.00	1.43
2	300012	华测检测	530,700	3,476,085.00	0.97
3	000002	万科A	132,300	3,151,386.00	0.88
4	600491	龙元建设	419,600	2,840,692.00	0.79
5	603868	飞科电器	69,000	2,634,420.00	0.73
6	002531	天顺风能	556,370	2,475,846.50	0.69
7	300349	金卡智能	147,860	2,380,546.00	0.66
8	300271	华宇软件	153,980	2,311,239.80	0.64
9	601328	交通银行	250,800	1,452,132.00	0.41
10	601088	中国神华	64,400	1,156,624.00	0.32

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.zofund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	23,990,613.00	3.42
2	600048	保利地产	21,393,344.63	3.05
3	000333	美的集团	15,263,320.00	2.17
4	601088	中国神华	13,563,307.24	1.93
5	001979	招商蛇口	12,846,247.00	1.83
6	000100	TCL 集团	12,289,725.50	1.75
7	603799	华友钴业	11,824,926.34	1.68
8	300284	苏交科	11,182,615.31	1.59
9	603019	中科曙光	10,726,402.03	1.53
10	002396	星网锐捷	10,708,793.02	1.52
11	601155	新城控股	10,274,946.34	1.46
12	600789	鲁抗医药	9,644,870.98	1.37
13	000932	华菱钢铁	9,630,645.00	1.37
14	300124	汇川技术	9,314,422.00	1.33
15	000708	大冶特钢	9,155,338.86	1.30
16	603788	宁波高发	9,117,002.94	1.30
17	300098	高新兴	9,086,170.85	1.29
18	002376	新北洋	9,005,459.52	1.28
19	600348	阳泉煤业	8,963,675.75	1.28
20	300316	晶盛机电	8,825,350.00	1.26

注:买入金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	25,006,950.74	3.56
2	600048	保利地产	18,756,171.00	2.67
3	300316	晶盛机电	15,707,513.82	2.24
4	603019	中科曙光	14,592,212.23	2.08
5	000333	美的集团	13,028,278.06	1.85
6	600104	上汽集团	12,441,186.71	1.77
7	601088	中国神华	12,288,124.00	1.75
8	300601	康泰生物	12,097,392.03	1.72
9	601233	桐昆股份	11,779,503.04	1.68
10	600885	宏发股份	11,634,681.88	1.66
11	603799	华友钴业	11,106,776.60	1.58
12	300098	高新兴	11,086,686.37	1.58
13	002376	新北洋	11,036,992.60	1.57
14	001979	招商蛇口	11,036,590.14	1.57
15	000100	TCL 集团	10,976,751.00	1.56
16	300124	汇川技术	10,930,924.22	1.56
17	603589	口子窖	10,887,771.81	1.55
18	002396	星网锐捷	10,687,929.28	1.52
19	002179	中航光电	10,563,971.88	1.50
20	600789	鲁抗医药	10,233,302.42	1.46

注:卖出金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	701,123,974.34
卖出股票收入(成交)总额	800,512,182.26

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,720,000.00	22.79
	其中:政策性金融债	81,720,000.00	22.79
4	企业债券	68,488,155.40	19.10
5	企业短期融资券	30,123,000.00	8.40
6	中期票据	60,029,000.00	16.74
7	可转债(可交换债)	768,859.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	241,129,014.40	67.26

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	300,000	30,132,000.00	8.40
2	160413	16农发13	300,000	29,796,000.00	8.31
3	180205	18国开05	200,000	21,792,000.00	6.08
4	011801350	18东航股SCP007	200,000	20,104,000.00	5.61
5	101801465	18天津港MTN002	200,000	19,994,000.00	5.58

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1789024	17招金1A3	200,000	4,512,000.00	1.26

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	131,998.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,317,884.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,449,883.13

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧睿诚定期开放混合A	1,893	176,670.90	0.00	0.00%	334,438,005.63	100.00%
中欧睿诚定期开放混合C	106	152,459.95	0.00	0.00%	16,160,754.29	100.00%
合计	1,999	175,387.07	0.00	0.00%	350,598,759.92	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧睿诚定期开放混合A	9,106.29	0.00%
	中欧睿诚定期开放混合C	-	-
	合计	9,106.29	0.00%

注:截止本报告期末,基金管理人的从业人员持有本基金A类份额的实际比例为0.0027%,持有本基金的总份额占基金总份额的实际比例为0.0026%,上表展示系四舍五入结果。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧睿诚定期开放混合A	0~10
	中欧睿诚定期开放混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧睿诚定期开放混合A	0~10
	中欧睿诚定期开放混合C	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	中欧睿诚定期开放混合A	中欧睿诚定期开放混合C
基金合同生效日(2016年12月01日)基金份额总额	1,144,450,271.26	57,846,128.32
本报告期期初基金份额总额	644,708,486.51	28,317,861.14
本报告期基金总申购份额	449,089.11	76,560.19
减:本报告期基金总赎回份额	310,719,569.99	12,233,667.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	334,438,005.63	16,160,754.29

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为60,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	1	27,163,771.58	1.81%	25,297.49	1.81%	-
新时代证券	1	141,577,897.02	9.44%	131,850.39	9.44%	-
长江证券	1	210,300,089.16	14.03%	195,852.22	14.03%	-
天风证券	1	16,341,805.06	1.09%	15,219.75	1.09%	-
国都证券	2	1,103,924,506.37	73.63%	1,028,091.99	73.63%	-

注:1.根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内,本基金新增太平洋证券上海交易单元和新时代证券上海交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
太平洋证券	16,395,131.76	6.09%	1,194,000,000.00	14.11%	-	-	-	-
新时代证券	17,231,572.85	6.41%	2,295,000,000.00	27.12%	-	-	-	-
长江证券	20,421,690.41	7.59%	208,000,000.00	2.46%	-	-	-	-
天风证券	-	-	940,300,000.00	11.11%	-	-	-	-
国都证券	214,948,090.86	79.91%	3,826,300,000.00	45.21%	-	-	-	-

注:1.根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内,本基金新增太平洋证券上海交易单元和新时代证券上海交易单元。

中欧基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日