

中欧价值发现混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金托管人：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04月18日

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不保证虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。
本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年4月17日复核了本报告中的全部内容，确认不存在虚假记载、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。
基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告经基金经理审核后，由基金经理签署。

本报告经基金经理签署后即视为对本报告内容予以确认。

报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§ 2 基金简介

中欧价值发现混合

基金主代码 166006

契约型、开放式

基金合同生效日 2009年07月26日

报告期末基金份额总额 6,947,563,762.02份

投资目标 本基金通过适当的资产配置和精选的投资选择策略，力争在控制风险的前提下，获取超越基准收益。

投资策略 本基金将坚持长期持有的投资理念，在注重风险控制的前提下，力争实现超越基准收益的基本策略。

业绩比较基准 60%×沪深300指数+20%×上证国债指数

风险收益特征 本基金的风格目标是，获取和超越基准收益，体现了本基金侧重于风格投资，高收益，追求长期稳定增长的混合型证券投资基金。

基金管理人 中欧基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 中欧价值发现混合A 中欧价值发现混合C

中欧价值发现混合A 合同持有人数 10,417份

中欧价值发现混合C 合同持有人数 3,093,917份

报告期末下属分级基金的份额总额 6,420,446,233份

31,114,769,645.4份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2019年01月01日—2019年03月31日

中欧价值发现混合A 中欧价值发现混合C 中欧价值发现混合C

1本期已实现收益 121,207,390.34 500,296,866 8,082,731.21

2本期利润 2,587,802,676.06 9,052,622.94 194,599,975.46

3加权平均基金份额本期利润 0.3063 0.04170 0.0363

4期末基金资产净值 10,599,969,206.08 42,443,555.03 825,947,708.83

5期末基金份额净值 1,651.01 1,836.26 1,639.00

注：1.本期已实现收益为期初至报告期末的收入，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣减相关费用后的金额，本期利润为期间实现的收入加上本期的平均份额变动收益。

2.本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的基金认购费和申购费。

3.2 本期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

中欧价值发现混合C净值表现

3.3 主要财务指标和基金净值表现

注：所有列示均为人民币元。

4.1 基金经理（或基金经理助理）管理基金

姓名 职务 在本基金的基金管理期间 任期日期 离任日期 说明

曹名长 基金经理 2016-11-20 -

董晓峰 基金经理 2017-6-11 -

注：自2017年1月12日起，本基金增加C类份额，报告日期为2017年1月13日至2019年03月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理助理）报告

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 收款投资 10,679,459,384.42 91.19

2 其他投资 10,679,459,384.42 91.19

3 固定收益投资 9,418,490.00 0.08

4 衍生工具投资 9,418,490.00 0.08

5 金融衍生品投资 0 0

6 其他金融资产 150,000,000.00 1.20

其中：类现金方式的买入返售金融资产 0 0

7 银行存款和结算备付金合计 817,049,630.00 6.98

8 其他资产 54,690,342.00 0.47

9 合计 11,710,613,838.24 100.00

注：1、任职日期和离任日期一般情况指公司作出决定之日；若基金经理经自基金经理合同生

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：1、任职日期和离任日期一般情况指公司作出决定之日；若基金经理经自基金经理合同生

5.3 主要财务指标和基金净值表现

注：所有列示均为人民币元。

5.4 管理人报告

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 收款投资 366,657,394.47 93.17

2 其他投资 366,657,394.47 93.17

3 固定收益投资 0 0

4 衍生工具投资 0 0

5 金融衍生品投资 80,000,000.00 10.02

6 其他金融资产 1,217,454,753.00 1.57

其中：类现金方式的买入返售金融资产 0 0

7 银行存款和结算备付金合计 9,048,152.07 1.10

8 其他资产 9,342,667.00 1.23

9 合计 760,463,520.33 100.00

注：1、任职日期和离任日期一般情况指公司作出决定之日；若基金经理经自基金经理合同生

2.证券业的营业收入从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.3.2 本基金的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本基金的招募说明书。

本报告经基金经理审核后，由基金经理签署。

本报告经基金经理签署后即视为对本报告内容予以确认。

报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§ 2 基金产品概况

中欧价值发现混合

基金运作方式 竞争型、开放式

基金合同生效日 2016年11月7日

报告期末基金份额总额 685,514,646.00份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过适当的资产配置和精选的投资选择策略，力争在控制风险的前提下，获取超越基准收益。

投资策略 本基金将坚持长期持有的投资理念，在注重风险控制的前提下，力争实现超越基准收益的基本策略。

业绩比较基准 60%×沪深300指数+40%×中债综合指数

风险收益特征 本基金的风格目标是，获取和超越基准收益，体现了本基金侧重于风格投资，高收益，追求长期稳定增长的混合型证券投资基金。

基金管理人 中欧基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 中欧价值发现混合A 中欧价值发现混合C

中欧价值发现混合A 合同持有人数 10,007份

中欧价值发现混合C 合同持有人数 695,493,262.64份

4.1 报告期内主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2019年01月01日—2019年03月31日

中欧价值发现混合A 中欧价值发现混合C 中欧价值发现混合C

1本期已实现收益 12,503,089.31 7,242,050,90.00 529,177.67

2本期利润 44,024,439.60 26,834,109.00 3,916,202.12

3加权平均基金份额本期利润 0.4765 0.07100 0.03337

4期末基金资产净值 249,240,377.34 118,061,539.48 11,667,737.57

5期末基金份额净值 2.1962 2.2763 2.0919

注：1.本期已实现收益为期初至报告期末的收入，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣减相关费用后的金额，本期利润为期间实现的收入加上本期的平均份额变动收益。

2.所列数据不包括持有人认购或申购基金时产生的基金认购费和申购费。

3.2 本期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

中欧价值发现混合C净值表现

3.3 主要财务指标和基金净值表现

注：所有列示均为人民币元。

4.1 基金经理（或基金经理助理）管理基金

姓名 职务 在本基金的基金管理期间 任期日期 离任日期 说明

刘晨 基金经理 2018-7-12 -

注：自2018年7月12日起，本基金增加C类份额，报告日期为2018年7月13日至2019年03月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理助理）报告

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 收款投资 366,657,394.47 93.17

2 其他投资 366,657,394.47 93.17

3 固定收益投资 0 0

4 衍生工具投资 0 0

5 金融衍生品投资 80,000,000.00 10.02

6 其他金融资产 1,217,454,753.00 1.57

其中：类现金方式的买入返售金融资产 0 0

7 银行存款和结算备付金合计 9,048,152.07 1.10

8 其他资产 9,342,667.00 1.23

9 合计 760,463,520.33 100.00

注：1、任职日期和离任日期一般情况指公司作出决定之日；若基金经理经自基金经理合同生

2.证券业的营业收入从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.3.2 本基金的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本基金的招募说明书。

本报告经基金经理审核后，由基金经理签署。

本报告经基金经理签署后即视为对本报告内容予以确认。

报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§ 2 基金产品概况

中欧价值发现混合

基金运作方式 竞争型、开放式

基金合同生效日 2016年11月7日

报告期末基金份额总额 685,514,646.00份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过适当的资产配置和精选的投资选择策略，力争在控制风险的前提下，获取超越基准收益。

投资策略 本基金将坚持长期持有的投资理念，在注重风险控制的前提下，力争实现超越基准收益的基本策略。

业绩比较基准 60%×沪深300指数+40%×中债综合指数

风险收益特征 本基金的风格目标是，获取和超越基准收益，体现了本基金侧重于风格投资，高收益，追求长期稳定增长的混合型证券投资基金。

基金管理人 中欧基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 中欧价值发现混合A 中欧价值发现混合C

中欧价值发现混合A 合同持有人数 10,007份

中欧价值发现混合C 合同持有人数 695,493,262.64份

4.1 报告期内主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2019年01月01日—2019年03月31日