

A64 信息披露 Disclosure

（上接A63版）

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号平安银行大厦
法定代表人：谢永林
客服热线：95611-3
网址：www.bank.pingan.com
60)名称：南京苏宁基金销售有限公司
住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
客服热线：95177
网址：www.snjijin.com

（二）C类份额销售机构
1. 直销机构（C类）
名称：中欧基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层
办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层
法定代表人：冀玉明
联系人：袁蓁
电话：021-68609602
传真：021-68609601
客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
网址：www.zofund.com
2. 代销机构（C类）（排名不分先后）
1)名称：招商银行股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
客服热线：95555
公司网站：www.cmbchina.com
2)名称：阳光人寿保险股份有限公司
住所：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
客服热线：95610
网址：http://fund.sinosig.com
3)名称：国都证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：王少华
客服热线：400-818-8118
网址：www.guodu.com
4)名称：国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服热线：95536
网址：www.guosen.com.cn
5)名称：中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人：王常青
客服热线：400-888-8108
网址：www.csc108.com
6)名称：中国银河证券股份有限公司
住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
法定代表人：陈共炎
客服热线：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn
7)名称：中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市经七路86号
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路66号
法定代表人：李玮
客服热线：95538
网址：http://www.zts.com.cn
8)名称：财通证券股份有限公司
住所：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
法定代表人：陆建强
客服热线：95336、40086-96336
网址：www.ctsec.com
9)名称：上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
10)名称：深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
办公地址：上海市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
法定代表人：薛峰
客服热线：4006-788-887
众禄基金销售网：www.zlfund.cn
基金买卖网：www.jjmmw.com
11)名称：上海好买基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
12)名称：诺亚正行基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波
客服热线：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
13)名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1楼202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
客服热线：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
14)名称：上海陆金所基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：王之光
客户热线：400-821-9031
网址：www.lufunds.com
15)名称：中债基金（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F
法定代表人：钱昊昊
客服热线：400-890-9998
网址：www.jnlc.com
16)名称：北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座京东集团总部
法定代表人：江卉
客服热线：4000988511/ 4000888816
网址：http://fund.jl.com/
17)名称：上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
客服热线：400-817-5666
网址：www.amcfund.com
18)名称：北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
法定代表人：王伟刚
客服热线：4006199059
网址：www.hejijin.com
19)名称：上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
客服热线：021-50810673
网址：www.wacaijin.com

20)名称：嘉实财富管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
客服热线：400-021-8850
网址：https://www.harvestwm.cn/
21)名称：南京苏宁基金销售有限公司
住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
客服热线：95177
网址：www.snjijin.com
（三）E类份额销售机构
1. 直销机构（E类）
名称：中欧基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层
办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层
法定代表人：冀玉明
联系人：袁蓁
电话：021-68609602
传真：021-68609601
客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
网址：www.zofund.com
2. 代销机构（E类）（排名不分先后）
1)名称：广东顺德农村商业银行股份有限公司
住所：广东省佛山市顺德区大良新城区拥翠路2号
办公地址：广东省佛山市顺德区大良新城区拥翠路2号
法定代表人：姚真勇
客服热线：0757-22223388
网址：www.sdebank.com
2)名称：上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区东昌路600号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
客服热线：95528
网址：www.spdb.com.cn
3)名称：阳光人寿保险股份有限公司
住所：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
客服热线：95610
网址：http://fund.sinosig.com
4)名称：中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人：王常青
客服热线：400-888-8108
网址：www.csc108.com
5)名称：中国银河证券股份有限公司
住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
法定代表人：陈共炎
客服热线：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn
6)名称：中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市经七路86号
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路66号
法定代表人：李玮
客服热线：95538
网址：http://www.zts.com.cn
7)名称：平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：刘世安
客服热线：95511-8
网址：www.stock.pingan.com
8)名称：财通证券股份有限公司
住所：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716
法定代表人：陆建强
客服热线：95336、40086-96336
网址：www.ctsec.com
9)名称：上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
10)名称：诺亚正行基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波
客服热线：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
11)名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1楼202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
客服热线：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
12)名称：上海陆金所基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：王之光
客户热线：400-821-9031
网址：www.lufunds.com
13)名称：中债基金（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F
法定代表人：钱昊昊
客服热线：400-890-9998
网址：www.jnlc.com
14)名称：北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座京东集团总部
法定代表人：江卉
客服热线：4000988511/ 4000888816
网址：http://fund.jl.com/
15)名称：上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
客服热线：400-817-5666
网址：www.amcfund.com
16)名称：北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
法定代表人：王伟刚
客服热线：4006199059
网址：www.hejijin.com
17)名称：上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
客服热线：021-50810673
网址：www.wacaijin.com

202-124室
办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
客服热线：400-111-0889
网址：www.gomefund.com
21)名称：北京广达信基金销售有限公司
住所：北京市西城区新街口外大街28号C座6层606室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
客服热线：400-623-6060
网址：www.niuiufund.com
22)名称：上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
客服热线：400-821-0203
网址：www.wandufund.com
23)名称：北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层18室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层18室
法定代表人：李阳琛
客服热线：010-62675369
网址：www.xincai.com
24)名称：上海云湾基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，
200127
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，
200127
法定代表人：桂水发
客服热线：400-820-1515
网址：www.zhengtongfunds.com
25)名称：北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座京东集团总部
法定代表人：江卉
客服热线：4000988511/ 4000888816
网址：http://fund.jl.com/
26)名称：上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
客服热线：400-817-5666
网址：www.amcfund.com
27)名称：北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号B座世界财富中心A座1108号
法定代表人：王伟刚
客服热线：4006199059
网址：www.hejijin.com
28)名称：上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
客服热线：021-50810673
网址：www.wacaijin.com
29)名称：大连银行股份有限公司
住所：辽宁省大连市中山区中山路88号
办公地址：辽宁省大连市中山区中山路88号
法定代表人：陈占维
客服热线：4006540099
网址：www.bankofdl.com
30)名称：南京苏宁基金销售有限公司
住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
客服热线：95177
网址：www.snjijin.com
基金管理人可以根据情况变化，增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化，增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

2. 登记机构
本基金A类份额注册登记机构信息如下：
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：赵亦清
电话：010-59378782
传真：010-50038828
本基金C类、E类份额注册登记机构信息如下：
名称：中欧基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层
办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层
法定代表人：冀玉明
总经理：刘建平
成立日期：2006年7月19日
电话：021-68609600
传真：021-68609601
联系人：杨敏
三、出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
经办律师：吕红、黎明
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
四、审计本基金的会计师事务所（特殊普通合伙）
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
01-12室
执行事务合伙人：毛鞍宁
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐旭
经办注册会计师：徐旭、印艳萍

中欧价值智选回报混合型证券投资基金
第四部分 基金的投资目标
在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
第五部分 基金的投资范围
本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等固定收益资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。
固定收益类资产包括通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例：
本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。
本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。
第八部分 基金的投资策略
本基金将采取积极主动的资产配置策略，投资于价值型上市公司股票或固定收益类资产，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期增值。
（一）大类资产配置策略
美林投资时钟理论按照经济增长与通胀的不同搭配，将经济周期划分为四个阶段：
1、“经济上行，通胀下行”构成复苏阶段，此阶段由于股票对经济的弹性更大，其相对债券和现金具备明显超额收益；
2、“经济上行，通胀上行”构成过热阶段，在此阶段，通胀上升增加

了持有现金的机会成本，可能出台的加息政策降低了债券的吸引力，股票的配置价值相对较强，而商品则将明显走强；
3、“经济下行，通胀上行”构成滞胀阶段，在滞胀阶段，现金收益率提高，持有现金最明智，经济下行对企业盈利的冲击将对股票构成负面影响，债券相对股票的收益率提高；
4、“经济下行，通胀下行”构成衰退阶段，在衰退阶段，通胀压力下降，货币政策趋宽松，债券表现最突出，随着经济即将见底的预期逐步形成，股票的吸引力逐步增强。
本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，研判经济周期在美林投资时钟理论所述所处的阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并实行实时动态调整。
（二）股票投资策略
本基金将重点关注在中国经济经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中价值型上市公司投资价值机会。
本基金将分析各行业上市公司的估值指标（如P/E、P/B、P/E等）、现金流量指标和其他财务指标（主要是净资产收益率和资产负债率），从各行业中选择价值低、现金流状况良好、盈利能力和偿债能力强的上市公司，作为本基金的备选股票。
同时，本基金还将通过分析重要股票所代表的上市公司的资产收益率、固定资产周转率、存货及应收账款周转率等变量的时间序列来评估其投资价值。
（三）债券选择策略
本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。
1. 久期偏离
本基金通过关注宏观经济走势、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。
2. 期限结构配置
本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。
3. 类属配置
类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。
4. 个券选择
个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。
（四）股指期货投资策略
本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。
第九部分 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：金融债+人民币三年期定期存款基准利率（税后）
金融债+人民币三年期定期存款基准利率由中国人民银行公布，该利率作为业绩比较基准直观明了，为广大投资者所熟悉；数据容易获得，适合作为业绩比较基准。本基金积极投资于股票等金融资产，在长期有机会获得相对于无风险利率的风险溢价。本基金力争基金资产净值的长期的收益率超越同期业绩比较基准。
若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。
第十部分 基金的风险收益特征
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。
第十一部分 基金的投资组合报告
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。
基金托管人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据取自本基金2019年第1季度报告，所载数据截至2019年3月31日，本报告中列明财务数据未经审计。
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	权益投资	365,462,384.47	93.17
2	其中：股票	365,462,384.47	93.17
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	24,172,220.08	6.23
10	其中：应收股利和应收利息	1,248,382.74	0.32
11	合计	389,634,604.55	100.00

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	1,436,585.94	0.38
C	制造业	208,283,796.31	78.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,933,120.00	1.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,493,421.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	6,819,466.00	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,908,561.00	2.35
J	金融业	1,407,092.50	0.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,083,660.00	2.10
M	科学研究和技术服务业	22,422,722.72	5.91
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	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		365,462,384.47	93.17

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。
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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300338	广明通	584,809	35,088,540.00	9.24
2	002698	妙手回春	919,397	22,510,012.76	5.92
3	002525	星源材质	201,377	14,458,389.00	3.81
4	002933	弘亚数控	288,528	12,986,030.00	3.69
5	002659	德邦股份	494,878	12,738,150.72	3.39
6	002837	美尚生态	622,100	12,274,033.00	3.23
7	300981	贝斯达	307,200	11,566,364.00	3.04
8	300762	安华新材	145,040	11,218,644.00	2.96
9	002699	美都能源	120,000	10,046,060.00	2.69
10	002695	福瑞股份	288,213	9,711,660.97	2.56

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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五名债投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
6、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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、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、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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 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投资股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资策略
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
10.3 本期国债期货投资评价
国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。
11、投资未按公允价值计量的资产公允价值
11.1 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。

11.2 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。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	266,063.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,264.86
5	应收申购款	1,634,923.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,910,182.74

11.4 报告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。
11.5 报告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。
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本报告因四舍五入原因，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。
第十二部分 基金的业绩
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当仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金合同生效日2013年5月14日，基金业绩截止日2019年3月31日。
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
中欧价值智选混合A

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2013/5/14-2013/12/31	6.09%	0.48%	2.70%	0.01%	3.39%	0.47%
2014/1-2014/12/31	33.49%	1.08%	4.11%	0.01%	29.38%	1.07%
2015/1-2015/12/31	50.15%	23.5%	3.15%	0.01%	46.00%	23.49%
2016/1-2016/12/31	-6.08%	1.26%	2.13%	0.02%	-7.29%	1.24%
2017/1-2017/12/31	-5.68%	0.68%	2.76%	0.01%	-6.41%	0.67%
2018/1-2018/12/31	-7.97%	1.38%	2.76%	0.01%	-10.25%	1.37%
2019/1-2019/3/31	37.59%	1.80%	0.68%	0.01%	36.91%	1.79%
2013/5/14-2019/3/31	164.06%	15.1%	19.22%	0.01%	144.84%	15.0%

中欧价值智选混合C

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2017/1/9-2017/12/31	-3.60%	0.09%	2.61%	0.01%	-6.27%	0.08%
2018/1-2018/12/31	-6.69%	1.38%	2.76%	0.01%	-11.41%	1.37%
2019/1-2019/3/31	34.55%	1.84%	1.22%	0.00%	33.29%	1.79%
2017/1/9-2019/3/31	0.89%	3.21%	6.69%	0.02%	-5.68%	3.19%

中欧价值智选混合E

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2015/5/22-2015/12/31	24.63%	1.60%	0.60%	0.01%	23.93%	1.59%
2016/1-2016/12/31	3.67%	1.70%	2.13%	0.02%	1.54%	1.68%
2017/1-2017/12/31	-5.74%	0.68%	2.76%	0.01%	-6.49%	0.67%
2018/1-2018/12/31	-7.69%	1.38%	2.76%	0.01%	-10.31%	1.37%
2019/1-2019/3/31	37.54%	1.80%	0.68%	0.01%	36.86%	1.79%
2015/5/22-2019/3/31	54.84%	1.60%	6.69%	0.01%	48.15%	1.59%

数据来源：中欧基金
2.基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图