# 中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

2015年06月30日

2015 第二季度报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中欧精选定期开放混合 |
| 基金主代码 | 001117 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2015年3月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,031,407,439.49份 |
| 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，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采取积极主动的资产配置策略，投资于上市公司股票或固定收益类资产，并适当运用股指期货对冲系统性风险，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35% |
| 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。 |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2015年4月1日－2015年6月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,004,089,859.69 |
| 2.本期利润 | 520,175,295.02 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0883 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,313,221,107.98 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.056 |

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

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

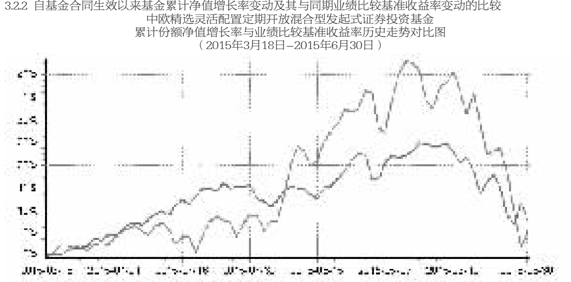
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.23% | 3.07% | 3.32% | 1.74% | -0.09% | 1.33% |

3.2.2 自基金合同生效以来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

中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年3月18日－2015年6月30日）



注：本基金基金合同生效日期为2015年3月18日，自基金合同生效日起到本报告期末未满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 曹剑飞 | 本基金基金经理，中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理，投资总监，事业部负责人 | 2015年3月18日 | – | 13年 | 历任长江证券有限责任公司投资总部分析师，泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理，华宝兴业基金管理有限公司研究员、基金经理助理，农银汇理基金管理有限公司投资总监、农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金经理、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金经理、农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金基金经理、农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金经理。2014年4月加入中欧基金管理有限公司，现任投资总监、事业部负责人，中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

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《证券业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 公平交易专项说明

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个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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度股票市场在经历快速上涨后又遭遇急跌，本轮牛市与过去相比最大的区别是大量杠杆资金的参与，杠杆有助涨助跌的功能，因此加剧了上涨下跌的幅度和速度。二季度我们重点配置在偏成长性的行业，以及跟转型相关的行业和主题，如TMT、医药、消费、新能源、新能源汽车等行业，以及国企改革、行业体制变革等主题。经过6月份的疯狂下跌之后，市场的风险意识增强，精选个股也将成为我们后续核心的操作策略，同时我们将在仓位控制上更加灵活。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为3.23%，同期业绩比较基准收益率为3.32%，基金投资收益低于同期业绩比较基准。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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元的情形。

§5 投资组合报告

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 | 权益投资 | 3,474,925,754.08 | 65.08 |
| | 其中：股票 | 3,474,925,754.08 | 65.08 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 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 | 1,800,104,485.85 | 33.71 |
| 8 | 其他资产 | 64,518,942.98 | 1.21 |
| 9 | 合计 | 5,339,549,182.91 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 518.40 | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 2,227,029,288.02 | 41.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 61,138,005.00 | 1.15 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | 430,765,983.18 | 8.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,640,117.23 | 0.14 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,363.95 | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 746,410,868.48 | 14.05 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | – | – |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,793.46 | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| 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 | 1,931,600.44 | 0.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,215.92 | – |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 3,474,925,754.08 | 65.40 |

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 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300171 | 东富龙 | 13,682,561 | 384,343,138.49 | 7.23 |
| 2 | 002551 | 尚荣医疗 | 8,584,736 | 372,491,695.04 | 7.01 |
| 3 | 601126 | 四方股份 | 11,158,370 | 340,330,285.00 | 6.41 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 8,380,653 | 256,196,562.21 | 4.82 |
| 5 | 002153 | 石基信息 | 1,604,917 | 208,623,160.83 | 3.93 |
| 6 | 002727 | 一心堂 | 2,270,063 | 187,552,605.06 | 3.53 |
| 7 | 300253 | 卫宁软件 | 3,434,034 | 178,569,768.00 | 3.36 |
| 8 | 300418 | 昆仑万维 | 1,178,340 | 170,600,065.20 | 3.21 |
| 9 | 002462 | 嘉事堂 | 3,012,951 | 159,987,698.10 | 3.01 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 2,438,937 | 153,872,535.33 | 2.90 |

5.4 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。

5.5 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券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 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。本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,723,623.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 61,566,637.74 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 228,681.52 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 64,518,942.98 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002727 | 一心堂 | 187,552,605.06 | 3.53 | 停牌 |
| 2 | 300418 | 昆仑万维 | 170,600,065.20 | 3.21 | 停牌 |

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 6,206,055,617.90 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,060,953,226.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,235,601,405.11 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 5,031,407,439.49 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 9,999,450.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | – |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | – |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 9,999,450.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.20 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 9,999,450.00 | 0.20% | 9,999,450.00 | 0.20% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | – | – | – | – | |
| 基金经理等人员 | 3,968,433.97 | 0.08% | 3,968,433.97 | 0.08% | 三年 |
| 基金管理人股东 | – | – | – | – | |
| 其他 | – | – | – | – | |
| 合计 | 13,967,883.97 | 0.28% | 13,967,883.97 | 0.28% | 三年 |

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金相关批准文件

2、《中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》

3、《中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》

4、《中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

# 中欧明睿新起点混合型证券投资基金

2015年6月30日

2015 第二季度报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中欧明睿新起点混合 |
| 基金主代码 | 001000 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年1月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,999,462,600.27份 |
| 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。 |
| 投资策略 | 本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 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，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。 |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2015年4月1日－2015年6月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,980,388,129.10 |
| 2.本期利润 | 1,193,776,297.03 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1790 |
| 4.期末基金资产净值 | 8,853,421,377.55 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.476 |

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

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

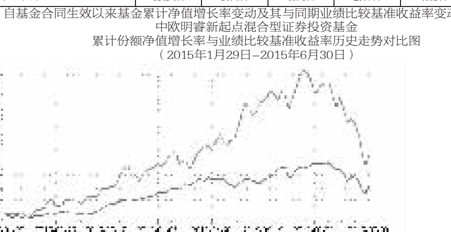
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 13.54% | 3.70% | 8.91% | 2.09% | 4.63% | 1.61% |

3.2.2 自基金合同生效以来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

中欧明睿新起点混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年1月29日－2015年6月30日）



注：本基金基金合同生效日期为2015年1月29日，自基金合同生效日起至本报告期末未满一年；按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 葛兰 | 本基金基金经理，中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015年1月29日 | – | 3年 | 历任国金证券股份有限公司研究所研究员，民生加银基金管理有限公司研究员。2014年10月加入中欧基金管理有限公司，曾任研究员，现任中欧明睿新起点混合型证券投资基金基金经理、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 刘明月 | 本基金基金经理，投资总监，事业部负责人 | 2015年5月18日 | – | 10年 | 历任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究发展部副总经理、机构投资部总经理，权益投资一部副总经理，广发聚瑞股票型证券投资基金基金经理，广发新经济股票型证券投资基金基金经理，广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2014年12月加入中欧基金管理有限公司，现任中欧明睿新起点混合型证券投资基金基金经理，投资总监，事业部负责人。 |

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《证券业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 公平交易专项说明

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个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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年二季度A股市场呈现出明显的"前涨后跌"，自进入6月中下旬起出现了一轮暴跌。但是从市场基本面来看，本次暴跌主要是"资金去杠杆"所引发的一次短期流动性危机，而这也随着政府强有力的多层次政策已逐渐解决；从宏观经济基本面来看，其本身发生任何变化，经济结构转型仍将是未来中长期的主要方向。从中国经济转型阶段、新兴产业的发展阶段以及所诞生的"未来新蓝筹"的市值情况来看，目前均处于初期、中期阶段，市场的结构性牛市仍然值得期待和看好。

中欧明睿新起点混合基金今年整体以来配置方向为调结构受益的行业，重点关注医药大健康、TMT、传媒、互联网+、环保、高端装备、文体娱乐等大众消费行业。同时根据市场环境、情绪、股价表现、估值等因素，日常进行动态微调，把握市场的投资机会。从中长期来看，我们的配置大方向是比较明确的，依然会在新科技、新消费、新服务等领域中加大研究力度，精选出具有投资价值的、长期优质企业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为13.54%，同期业绩比较基准收益率为8.91%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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元的情形。

§5 投资组合报告

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 | 权益投资 | 8,325,580,507.46 | 78.13 |
| | 其中：股票 | 8,325,580,507.46 | 78.13 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 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 | 2,295,688,623.20 | 21.54 |
| 8 | 其他资产 | 34,873,916.13 | 0.33 |
| 9 | 合计 | 10,656,143,046.79 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 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 | 317,688.84 | – |
| C | 制造业 | 1,649,855,959.90 | 18.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 86,571,719.25 | 0.98 |
| E | 建筑业 | 161,782.41 | – |
| F | 批发和零售业 | 627,780,410.46 | 7.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 440,278.27 | – |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,185,619,796.00 | 58.57 |
| J | 金融业 | 352,861.98 | – |
| K | 房地产业 | 226,450,537.37 | 2.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | 115,048,562.82 | 1.30 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| 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 | 459,525.24 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 296,093,407.88 | 3.34 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 136,427,977.04 | 1.54 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 8,325,580,507.46 | 94.04 |

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 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300170 | 汉得信息 | 17,735,356 | 430,791,797.24 | 4.87 |
| 2 | 300033 | 同花顺 | 4,725,072 | 406,308,941.28 | 4.59 |
| 3 | 300377 | 赢时胜 | 2,359,930 | 343,393,414.30 | 3.88 |
| 4 | 300168 | 万达信息 | 6,909,650 | 339,402,008.00 | 3.83 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 3,024,107 | 338,851,189.35 | 3.83 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 5,344,107 | 337,159,710.63 | 3.81 |
| 7 | 000503 | 海虹控股 | 6,520,918 | 319,524,982.00 | 3.61 |
| 8 | 300085 | 银之杰 | 4,414,326 | 316,639,603.98 | 3.58 |
| 9 | 300253 | 卫宁软件 | 6,044,971 | 314,338,492.00 | 3.55 |
| 10 | 600446 | 金证股份 | 2,523,618 | 311,565,878.28 | 3.52 |

5.4 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。

5.5 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券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 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。本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 4,623,765.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 328,586.05 |
| 5 | 应收申购款 | 29,921,564.79 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 34,873,916.13 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300377 | 赢时胜 | 343,393,414.30 | 3.88 | 停牌 |

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 7,582,607,876.68 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,145,459,038.60 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 5,728,604,315.01 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 5,999,462,600.27 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧明睿新起点混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧明睿新起点混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧明睿新起点混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧明睿新起点混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

# 中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金

2015年6月30日

2015 第二季度报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月7日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 中欧琪和灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 001164 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年4月7日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 11,022,399,975.61份 | |
| 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。 | |
| 投资策略 | 本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。 | |
| 业绩比较基准 | 金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后） | |
| 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，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。 | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧琪和灵活配置混合A | 中欧琪和灵活配置混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001164 | 001165 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,796,639,249.86份 | 225,760,725.75份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2015年4月7日－2015年6月30日） | |
|---|---|---|
| | 中欧琪和灵活配置混合A | 中欧琪和灵活配置混合C |
| 1.本期已实现收益 | 169,194,833.58 | 5,212,872.20 |
| 2.本期利润 | 178,694,415.77 | 14,751,815.06 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0381 | 0.0384 |
| 4.期末基金资产净值 | 11,211,609,148.63 | 233,856,368.75 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.038 | 1.036 |

注：1、本基金基金合同生效日为2015年4月7日，报告期不满一个季度。

2. 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。

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，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 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

中欧琪和灵活配置混合A

| 阶段 | 净值增长率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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日起至今（2015年04月07日－2015年06月30日） | 3.80% | 0.16% | 0.84% | 0.01% | 2.96% | 0.15% |

中欧琪和灵活配置混合C

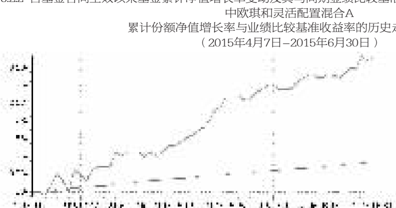
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日起至今（2015年04月07日－2015年06月30日） | 3.60% | 0.15% | 0.84% | 0.01% | 2.76% | 0.14% |

3.2.2 自基金合同生效以来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

中欧琪和灵活配置混合A

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

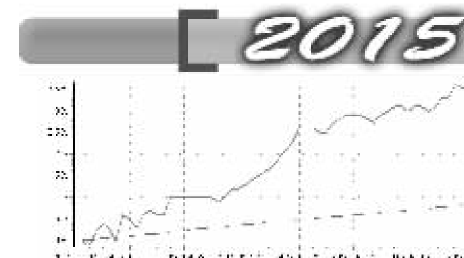
（2015年4月7日－2015年6月30日）



中欧琪和灵活配置混合C

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015年4月7日－2015年6月30日）



注：本基金基金合同生效日期为2015年4月7日，自基金合同生效日起到本报告期末未满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 孙甜 | 本基金基金经理，中欧货币市场基金基金经理，中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理，中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理，中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015年4月7日 | – | 5年 | 历任长江养老保险股份有限公司投资助理，上海烟草（年金计划）平衡配置组合投资经理，上海海通证券资产管理有限公司海通季季红、海通海蓝宝益、海通海蓝宝银、海通月月鑫、海通季季鑫、海通半年鑫、海通年年鑫投资经理。2014年8月加入中欧基金管理有限公司，曾任投资经理，现任中欧货币市场基金基金经理，中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理，中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 吴启权 | 本基金基金经理，中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015年5月25日 | – | 7年 | 历任中信建投证券股份有限公司研究发展部高级副总裁。2015年3月加入中欧基金管理有限公司，曾任中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理兼研究员，现任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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《证券业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 公平交易专项说明

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个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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年二季度，新股发行速度加快。本基金致力于为投资者赚取"绝对收益"，报告期内净值实现正增长，组合风险暴露水平较低，净值波动较小。但由于市场波动7月初开始暂缓IPO，重启IPO时间有不确定性。本基金将秉承为投资者赚取"绝对收益"的原则，通过稳健的投资策略努力为投资者获得较好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A级份额净值增长率为3.80%，同期业绩比较基准收益率为0.84%；C级份额净值增长率为3.60%，同期业绩比较基准收益率为0.84%。基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

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 | 权益投资 | 212,972,484.91 | 1.86 |
| | 其中：股票 | 212,972,484.91 | 1.86 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 631,957,798.00 | 5.52 |
| | 其中：债券 | 631,957,798.00 | 5.52 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | 1,650,003,195.00 | 14.41 |
| | 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 | 8,951,453,579.46 | 78.15 |
| 8 | 其他资产 | 7,473,469.25 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 11,453,860,526.62 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 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 | – | – |
| C | 制造业 | 99,205,037.98 | 0.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 41,575,709.21 | 0.36 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | 48,602,903.89 | 0.42 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,379.04 | – |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,052,370.94 | 0.03 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | – | – |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,083.85 | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| 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 | 20,530,000.00 | 0.18 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 212,972,484.91 | 1.86 |

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 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002462 | 嘉事堂 | 849,956 | 45,132,663.60 | 0.39 |
| 2 | 601985 | 中国核电 | 3,181,003 | 41,575,709.21 | 0.36 |
| 3 | 600420 | 现代制药 | 829,719 | 36,092,776.50 | 0.32 |
| 4 | 000681 | 视觉中国 | 500,000 | 20,530,000.00 | 0.18 |
| 5 | 000860 | 顺鑫农业 | 520,000 | 11,913,200.00 | 0.10 |
| 6 | 600073 | 上海梅林 | 700,000 | 9,058,000.00 | 0.08 |
| 7 | 000848 | 承德露露 | 430,000 | 7,826,000.00 | 0.07 |
| 8 | 002412 | 汉森制药 | 299,950 | 7,573,737.50 | 0.07 |
| 9 | 600251 | 冠农股份 | 530,000 | 7,329,900.00 | 0.06 |
| 10 | 600521 | 华海药业 | 170,000 | 5,312,500.00 | 0.05 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 218,126,000.00 | 1.91 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 411,868,000.00 | 3.60 |
| | 其中：政策性金融债 | 411,868,000.00 | 3.60 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | | – |
| 7 | 可转债 | 842,798.00 | 0.01 |
| 8 | 其他 | 1,121,000.00 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 631,957,798.00 | 5.53 |

注：其他债券品种中包含可交换债券。

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五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150411 | 15农发11 | 1,900,000 | 190,817,000.00 | 1.67 |
| 2 | 020076 | 15贴债02 | 1,500,000 | 147,600,000.00 | 1.29 |
| 3 | 150211 | 15国开11 | 1,000,000 | 100,350,000.00 | 0.88 |
| 4 | 150403 | 15农发03 | 500,000 | 50,305,000.00 | 0.44 |
| 5 | 150202 | 15国开02 | 300,000 | 30,162,000.00 | 0.26 |

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 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。本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 116,991.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,286.39 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 7,348,191.64 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 7,473,469.25 |

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 中欧琪和灵活配置混合A | 中欧琪和灵活配置混合C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 2,922,739.01 | 223,069,062.32 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 13,654,209,143.75 | 410,263,481.31 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 2,860,492,632.90 | 407,571,817.88 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | – | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 10,796,639,249.86 | 225,760,725.75 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日