中欧滚钱宝发起式货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司据本基金合同规定,于2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧滚钱宝货币
基金主代码	001211
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2015年06月12日
报告期末基金份额总额	300,601,966.04份
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	567,567.71
2.本期利润	567,567.71
3.期末基金资产净值	300,601,966.04

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

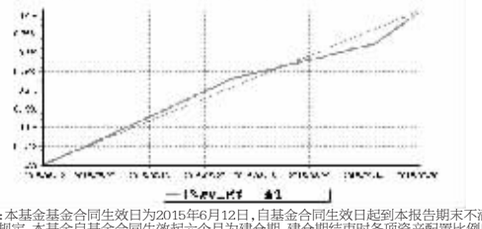
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3312%	0.0015%	0.3408%	0.0000%	-0.0096%	0.0015%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基基金合同生效日为2015年6月12日,自基金合同生效日起到本报告期末不满一年,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。图示日期为2015年6月12日至2015年9月30日。

§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,中欧鼎和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧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证券投资基金基金经理,中欧盛泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑞源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理	2015年06月12日		6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、海通海蓝宝盈、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、中欧鼎和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧成长优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧瑞源灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧睿尚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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

三季度货币市场资金利率整体中枢继续有所下行。具体来看,随着股票市场的降温,IPO的再次暂停,权益市场的资金回流银行间,短端资金价格以及债券收益率继续呈现下行趋势。本基金在这种货币政策总体宽松的局面下,继续合理的配置了存款、债券,并将组合久期和组合流动性维持在一个适度的范围之内。特别值得一提的是,本基金在三季度适时进行了大额存单的投资。由于存单有着流动性高,同时相比同期限定存有一定的性价比等优势,从而为客户获得了稳定且相对较高的收益。

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0.3312%,同期业绩比较基准收益率为0.3408%,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	固定收益投资	130,673,586.33	43.43
	其中:债券	130,673,586.33	43.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	165,909,140.41	55.14
4	其他资产	4,279,456.60	1.42
5	合计	300,862,183.34	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.17
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数	
报告期末投资组合平均剩余期限		
报告期内投资组合平均剩余期限最高值		
报告期内投资组合平均剩余期限最低值		

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	0.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	30.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	54.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	6.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.66	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,991,640.25	6.65
	其中:政策性金融债	19,991,640.25	6.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,626,667.26	33.48
6	中期票据	10,055,278.82	3.35
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	130,673,586.33	43.47
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041455048	14天业CP004	200,000	20,202,579.56	6.72
2	150413	15农发13	200,000	19,991,640.25	6.65
3	041453118	14酒钢CP002	100,000	10,064,228.68	3.35
4	041454076	14南汇CP002	100,000	10,059,313.50	3.35
5	041461066	14川水电CP002	100,000	10,058,416.85	3.35
6	1082203	10兖矿MTN2	100,000	10,055,278.82	3.35
7	041456058	14三安CP002	100,000	10,054,785.80	3.34
8	041456055	14滨建投CP004	100,000	10,054,487.37	3.34
9	041454075	14渝机电CP002	100,000	10,051,457.35	3.34
10	041461064	14青投CP002	100,000	10,044,544.22	3.34

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1663%
报告期内偏离度的最低值	0.0132%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0758%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

5.8.2本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	
3	应收利息	4,279,456.60
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,279,456.60

5.8.5 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	40,033,520.62
报告期期间基金总申购份额	260,576,758.71
减:报告期基金总赎回份额	8,313.29
报告期期末基金份额总额	300,601,966.04

注:总申购份额含红利再投份额

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年08月06日	90,000,000.00	90,000,000.00	-
2	申购	2015年08月10日	90,000,000.00	90,000,000.00	-
3	申购	2015年08月19日	80,000,000.00	80,000,000.00	-
合计			260,000,000.00	260,000,000.00	

§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	300,597,540.73	100.00%	10,000,000.00	3.33%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	300,597,540.73	100.00%	10,000,000.00	3.33%	三年

注:本基金管理人固有资金投资所得份额占基金总份额的实际比例为99.9985%,上表所示数据为四舍五入之后的结果。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧滚钱宝发起式货币市场基金相关批准文件

2、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》

3、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金托管协议》

4、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金招募说明书》

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
二〇一五年十月二十四日

中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧新趋势混合(LOF)
场内简称	中欧趋势
基金主代码	166001
交易代码	166001
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月29日
报告期末基金份额总额	2,077,672,855.56份
投资目标	本基金通过投资于可能从中国经济以及资本市场新趋势获益的公司,在兼顾风险的原则下,追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的投资风格以积极的股票选择策略为特点,注重挖掘基于未来趋势的企业价值。资产配置和行业配置层面,本基金在正常市场条件下不做主动性资产配置调整,并倾向于持有较多符合经济发展和市场变革新趋势的行业。股票选择层面,本基金通过客观化的定量分析、主观化的定性分析,证券估值等步骤选择合适的,物有所值的上市公司股票构建最优投资组合。
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债全价指数
风险收益特征	本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于中高风险、追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。在严格控制风险的前提下,本基金的投资将以前瞻的眼光把握经济发展与市场变革的中长期趋势,努力挖掘个股与板块、行业的投资机遇。
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

注:根据2014年8月8日修订后施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)第十条第一项之规定,本基金自2015年7月17日由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金。

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,979,165.03
2.本期利润	-614,502,069.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3060
4.期末基金资产净值	2,541,594,151.62
5.期末基金份额净值	1.2233

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

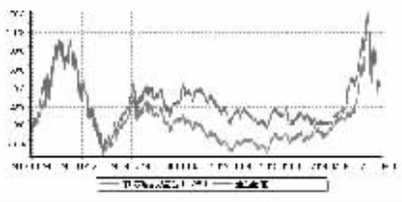
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.58%	3.66%	-23.42%	2.66%	3.84%	1.00%

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

中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)

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

(2007年1月29日-2015年9月30日)



§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		
周蔚文	本基金基金经理,中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理,投资总监,事业部负责人	2011年8月16日	-	16年	历任光大证券研究所研究员,富国基金管理有限公司研究员、高级研究员,富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理。2011年1月加入中欧基金管理有限公司,历任研究部总监、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理、副总经理,现任投资总监、事业部负责人、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)基金经理。
林英睿	本基金基金经理,中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年5月29日	-	4年	历任瑞银证券有限责任公司证券部助理投资研究分析师。2012年10月加入中欧基金管理有限公司,曾任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金的基金经理助理兼研究员,现任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)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

三季度的市场是A股多年来少见的,在股市泡沫较大及国家清理配资等共同作用下,市场经历了持续的去杠杆过程,到季度末,去杠杆基本完成,股市企稳。本基金在整个季度对组合内对应的上市公司未来经营的预判反复检验,卖掉了一些可靠性稍低的股票,并增加了一些未来行业与公司经营相对更确定、估值更能接受的股票。

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-19.58%,同期业绩比较基准增长率为-23.42%,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	1,801,938,335.18	69.84
	其中:股票	1,801,938,335.18	69.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,092,144.80	5.00
	其中:债券	129,092,144.80	5.00
	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	479,320,503.46	18.58
8	其他资产	169,612,444.42	6.57
9	合计	2,579,963,427.86	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	385,116,006.60	15.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	970,127,113.04	38.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,404,093.75	3.71
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	76,141,185.51	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,830.65	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	119,945,971.63	4.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	156,202,134.00	6.15
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	1,801,938,335.18	70.90

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	600276	恒瑞医药	3,713,471	171,525,225.49	6.75
2	002714	牧原股份	3,582,100	159,403,450.00	6.27
3	002672	东江环保	8,755,725	156,202,134.00	6.15
4	002223	鱼跃医疗	3,999,895	134,356,473.05	5.29
5	300124	汇川技术	3,713,400	132,605,514.00	5.22
6	002299	圣农发展	6,999,800	104,857,004.00	4.13
7	601199	江南水务	3,020,931	94,404,093.75	3.71
8	002074	国轩高科	3,012,529	88,809,354.92	3.49
9	300003	乐普医疗	2,592,723	82,941,208.77	3.26
10	603368	柳州医药	1,124,187	76,141,185.51	3.00

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,092,144.80	5.08
	其中:政策性金融债	129,092,144.80	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,092,144.80	5.08

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	018001	国开1301	1,279,280	129,092,144.80	5.08

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

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

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

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,927,734.10
2	应收证券清算款	15,884,381.34
3	应收股利	-
4	应收利息	5,726,431.91
5	应收申购款	145,073,897.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,612,444.42

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

报告期期初基金份额总额	2,103,572,597.77
报告期期间基金总申购份额	279,181,923.02
减:报告期期间基金总赎回份额	305,081,665.23
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	2,077,672,855.56

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、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)相关批准文件

2、《中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)托管协议》

4、《中欧新趋势混合型证券投资基金(LOF)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
二〇一五年十月二十四日

中欧永裕混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司据本基金合同规定,于2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧永裕混合	
基金主代码	001306	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年06月04日	
报告期末基金份额总额	5,685,081,791.21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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧永裕混合A	中欧永裕混合C
下属分级基金的交易代码	001306	001307
报告期末下属分级基金的份额总额	5,607,810,327.99份	77,271,463.22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07月01日-2015年09月30日)	
	中欧永裕混合A	中欧永裕混合C
1.本期已实现收益	-427,204,403.86	-6,809,260.41
2.本期利润	-837,734,050.64	-13,398,549.02
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1406	-0.1534
4.期末基金资产净值	4,425,674,883.95	60,762,832.50
5.期末基金份额净值	0.789	0.786

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

中欧永裕混合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
过去三个月	-13.30%	2.01%	-22.82%	2.68%	9.52%	-0.67%

中欧永裕混合C

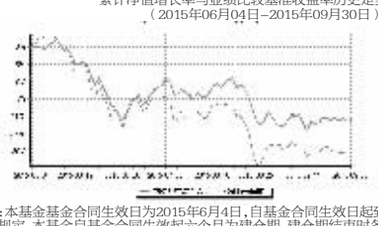
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.53%	1.99%	-22.82%	2.68%	9.29%	-0.69%

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

中欧永裕混合A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月04日-2015年09月30日)



注:本基金基金合同生效日为2015年6月4日,自基金合同生效日起到本