

中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)

[2015]第四季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员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、完整性、及时性、合法性负责。
基金托管人及银行存款类金融机构的负责人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。
基金销售机构承诺在销售过程中不违反法律、行政法规、部门规章、规范性文件、自律规则，不损害基金份额持有人利益。
基金销售人员承诺在向投资人推介基金时，向投资人充分揭示投资风险，投资人作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:中欧增强回报债券(LOF)
场内简称:中欧债基
基金代码:160008
基金运作方式:契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日:2010年12月02日
报告期末基金份额总额:2,000,734,383.71份

投资目标:在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的收入工具，在投资策略上兼顾投资期限与本金的安全性特点，通过分散投资货币市场基金、债券基金、股票基金等不同类型的金融产品，保持基金组合的流动性，通过对宏观经济走势、利率走势、信用品种、行业分布等进行深入研究，选择具有较好投资价值的金融产品，本基金也将根据市场情况适时调整资产配置比例以提高投资组合收益率。

业绩比较基准:中国国债总指数
风险收益特征:本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益均低于股票型基金和股票型基金。

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称:中欧增强回报债券(LOF)A 中欧增强回报债券(LOF)E
下属分级基金的业内简称:中欧债基
下属分级基金的交易代码:160008 001889
报告期末下属分级基金的份额总额:1,997,483,136.10份 3,261,206.61份

注:2015年10月08日起,本基金增加类别份额,登记机构为中欧基金管理有限公司。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)	
	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	22,206,528.99	15,165.86
2.本期利润	61,967,896.97	36,042.04
3.期初至报告期利润累计金额	0.0374	0.0263
4.期末未分配利润	2,166,033,874.94	3,506,080.30
5.期末未分配利润总额	16,0008 001889	10,769 10,7683

注:1.本期末现金类资产占基金总资产的比例为33.88%，同期间货比净值增长率为23.37%，基金E类份额净值增长率为3.65%，期间货比净值增长率为2.07%。
46. 报告期内基金持有人数或人数数据均按基金净值余额倒推计算。
本基金报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数不足二百人或者基金净资产值低于五十万元的情形。

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,但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来的业绩。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。

5.4 报告期末未持有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 94,810,500.00 4.39

2 行业票据 - -

3 金融债券 301,560,000.00 13.07

4 中央政府金融债券 301,560,000.00 13.07

5 企业债券 1,621,326,566.80 76.13

6 企业短期融资券 160,577,000.00 6.60

7 中期票据 263,031,000.00 12.19

8 可转债(可交换) 466,000.00 0.02

9 其他 - -

10 合计 2,432,288,096.80 100.00

5.5 投资组合报告

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:2016年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员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、及时性、合法性负责。
基金托管人及银行存款类金融机构的负责人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。
基金销售机构承诺在销售过程中不违反法律、行政法规、部门规章、规范性文件、自律规则，不损害基金份额持有人利益。
基金销售人员承诺在向投资人推介基金时，向投资人充分揭示投资风险，投资人作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:中欧增强回报债券(LOF)
场内简称:中欧债基
基金代码:160008
基金运作方式:契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日:2010年12月02日
报告期末基金份额总额:2,000,734,383.71份

投资目标:在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的收入工具，在投资策略上兼顾投资期限与本金的安全性特点，通过分散投资货币市场基金、债券基金、股票基金等不同类型的金融产品，保持基金组合的流动性，通过对宏观经济走势、利率走势、信用品种、行业分布等进行深入研究，选择具有较好投资价值的金融产品，本基金也将根据市场情况适时调整资产配置比例以提高投资组合收益率。

业绩比较基准:中国国债总指数
风险收益特征:本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益均低于股票型基金和股票型基金。

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称:中欧增强回报债券(LOF)A 中欧增强回报债券(LOF)E
下属分级基金的业内简称:中欧债基
下属分级基金的交易代码:160008 001889
报告期末下属分级基金的份额总额:1,997,483,136.10份 3,261,206.61份

注:2015年10月08日起,本基金增加类别份额,登记机构为中欧基金管理有限公司。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)

报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)