

中欧养老产业混合型证券投资基金

[2016] 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

1.1 重要提示及目录

基金管理人的董事会及董事保证本基金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。
基金销售机构承诺在本报告期间内,遵守《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,于2017年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告,并保证复核结果与本基金管理人复核的结果一致。
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,投资人在投资本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧养老混合
基金主代码	001956
基金运作方式	契约型,开放式
基金合同生效日	2016年06月13日
报告期末基金资产总额	65,006,797.00

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,力争获得超越行业平均水平的稳定收益。

投资策略 本基金在综合分析宏观经济、市场趋势、风险控制要求等的基础上,制定合理的资产配置策略。

业绩比较基准 95%的基金资产投资于股票,5%的基金资产投资于债券,业绩比较基准为沪深300指数*80%+中债综合指数*20%。

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于股票型基金,但低于高预期收益和低风险水平的债券型基金。

基金管理人 中欧基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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(2016年10月1日-2016年12月31日)			
1.本期已实现收益		674,990.17			
2.本期利润		168,526.45			
3.报告期基金份额本期利润		0.0022			
4.期末基金资产净值		68,843,496.03			
5.期末基金份额净值		1.0068			

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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,余额为零时,则显示为零。

2.所述本期利润不包括持有人认购或申购交易的各笔费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.1 本期报告基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

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 002041 海康威视 173,700 3,279,466.00 4.76

2 600087 伊利股份 165,800 2,918,080.00 4.24

3 000998 五粮液 82,023 2,869,185.04 4.15

4 600690 高贝生物 166,389 2,848,679.00 4.14

5 600709 人福医药 134,400 2,681,280.00 3.89

6 600998 蓝思科技 120,000 2,571,600.00 3.74

7 002070 丽珠集团 190,000 2,361,600.00 3.43

8 600984 乐普医疗 132,600 2,340,300.00 3.40

9 600276 相城医药 50,000 2,275,000.00 3.20

10 000028 国药一致 33,782 2,260,015.00 3.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

单位:人民币元

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 2,996,970.00 4.36

2 行业债券 - -

3 金融债券 - -

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债(含分离交易可转债) - -

8 拆借债券 - -

9 其他 - -

10 合计 2,996,970.00 4.36

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 019130 16国债11 30,000 2,996,100.00 4.36

5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券投资。

5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及权证投资明细

本基金本报告期未持有权证投资。

5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期未持有股指期货投资。

5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金本报告期未持有国债期货投资。

5.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期未持有股票投资。

5.11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金本报告期未持有股票投资组合。

5.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合

本基金本报告期未持有股票投资组合。

5.13 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 61,143.65

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 -

4 应收股利 46,589.05

5 应收申购款 88,811.04

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 196,546.24

5.14 报告期末持有的处于转持期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.15 报告期内各一名股东所持有的处于转持期的可转换债券

本基金本报告期末未持有处于转持期的可转换债券。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金因组合五人原因,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。

5.17 基金管理人运用资产支持证券投资情况

本基金本报告期未持有资产支持证券投资。

5.18 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.19 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.20 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.21 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.22 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.23 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.24 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.25 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.26 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.27 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.28 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.29 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.30 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.31 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.32 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.33 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.34 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.35 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.36 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.37 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.38 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.39 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.40 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.41 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.42 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.43 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.44 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.45 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.46 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.47 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.48 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。

5.49 基金管理人运用资金投资本基金管理费情况

本基金本报告期未持有资金投资本基金管理费。