中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年01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2017年1月18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03月18日
报告期末基金份额总额	2,289,280,862.96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	
下属分级基金的基金简称	中欧精选定期开放混合A	中欧精选定期开放混合E
下属分级基金的交易代码	001117	001890
报告期末下属分级基金的份额总额	2,288,496,633.65份	794,229.30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(2016年10月01日-2016年12月31日)	
	中欧精选定期开放混合A	中欧精选定期开放混合E
1.本期已实现收益	33,538,196.59	10,692.19
2.本期利润	-36,085,680.58	-12,267.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0147	-0.0156
4.期末基金资产净值	1,712,931,725.48	596,489.89
5.期末基金份额净值	0.748	0.751

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。

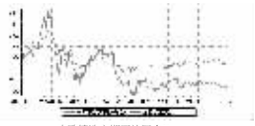
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中欧精选定期开放混合A

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	-2.22%	0.74%	0.34%	0.48%	-2.56%	0.26%

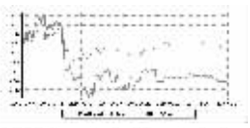
中欧精选定期开放混合E

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	-2.09%	0.75%	0.34%	0.48%	-2.43%	0.27%

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
中欧精选定期开放混合A
基金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03月18日-2016年12月31日)



中欧精选定期开放混合E
基金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10月13日-2016年12月31日)



注:本基金于2015年9月22日新增E份额,图示日期为2015年10月13日至2016年12月31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		
刘明月	公司员工	2016年01月08日	2016年12月01日	12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,曾任投资总监、事业部负责人、中欧明睿新起点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、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,现任公司员工。
周蔚文	投资总监、事业部负责人、基金经理	2016年12月01日		17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、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
接于本基金以来,我们按照精选行业、注重公司中长期价值的思路来调整组合,卖出了大部分我们对未来行业趋势判断不清或者公司当前市值远高于其中长期价值的股票,买入了一些有定价权的消费品公司股票、受益农产品价格上涨的股票等。持股集中度大幅上升,扣除新股后,仅20只左右个股。
相对于中欧新趋势与中欧新蓝筹两只基金,本基金的投资思路较为类似,但是会更注重于绝对收益,由于规模相对这两只基金而言较小,因此持股集中度会更高一些,仓位变化幅度也会更大一些。
展望未来几个季度,综合考虑经济、政策、资金、股市估值四大因素来看,未来半年A股指数总体波动区间不会大,如果有机会的话,一季度概率更大些。主要是经济方面,受2016年地产与汽车销售高增长影响,相关产业链将持续一段时间维持小景气,同时大宗商品价格上涨之后,整个制造业补库存将持续一段时间。对外贸易方面,中美之间将可能产生一些贸易纠纷,一季度可能处于配酿阶段,对股市的影响还不会很明显。机会不大,是因为中央经济工作会议对2017年定位于控风险,货币政策稳健中性,严防资产泡沫,资金面不会很宽松。因此,我们将继续注重公司的中长期价值,寻找结构性投资机会。继续按照寻找未来行业好转的中长期机会,在合适的价格买入受益行业好转而业绩高增长的股票。这些行业既包括新兴产业,也包括传统周期行业以及相对稳定的行业。在股市波动中,我们也可能在相对高位降低一些仓位,而在低位增加一些仓位,尽力创造更大的超额收益率。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,A类份额净值增长率为-2.22%,同期业绩比较基准收益率为0.34%;E类份额净值增长率为-2.09%,同期业绩比较基准收益率为0.34%。
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	1,161,097,660.23	67.52
	其中:股票	1,161,097,660.23	67.52
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	440,000,000.00	25.59
	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	107,092,062.66	6.23
8	其他资产	11,516,239.38	0.67
9	合计	1,719,705,962.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	62,909,406.08	3.67
B	采矿业	-	-
C	制造业	757,362,138.09	44.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,876,431.78	8.16
E	建筑业	51,065,995.83	2.98
F	批发和零售业	91,199,936.52	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.01
J	金融业	58,432,601.05	3.41
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	1,161,097,660.23	67.76

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票。
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	000858	五粮液	2,749,901	94,816,586.48	5.53
2	600519	贵州茅台	259,964	86,866,970.60	5.07
3	600409	三友化工	9,000,000	84,510,000.00	4.93
4	600856	中天能源	5,789,613	79,896,659.40	4.66
5	002078	太阳纸业	11,059,967	73,880,579.56	4.31
6	600837	欧亚集团	2,199,947	70,464,302.41	4.11
7	002041	登海种业	3,332,066	62,909,406.08	3.67
8	600970	中材国际	8,782,759	62,269,761.31	3.63
9	600681	百川能源	3,784,208	59,941,854.72	3.50
10	600643	爱建集团	4,699,905	58,325,821.05	3.40

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
本基金本报告期末未投资股指期货。
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。
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	790,014.66
2	应收证券清算款	10,653,567.68
3	应收股利	0.39
4	应收利息	72,656.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,516,239.38

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 报告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

	中欧精选定期开放混合A	中欧精选定期开放混合E
报告期期初基金份额总额	2,623,891,850.28	792,586.61
报告期期间基金总申购份额	2,340,616.29	74,607.71
减:报告期期间基金总赎回份额	337,745,832.92	72,965.02
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	2,288,496,633.65	794,229.30

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

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
二〇一七年一月二十日

中欧骏盈货币市场基金

【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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年01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。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月18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	中欧骏盈货币	
基金主代码	001787	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年12月24日	
报告期末基金份额总额	8,150,150,968.74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,通过对期限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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
下属分级基金的交易代码	001787	001788
报告期末下属分级基金的份额总额	15,895.65份	8,150,135,073.09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(2016年10月01日-2016年12月31日)	
	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
1.本期已实现收益	65.82	61,694,047.51
2.本期利润	65.82	61,694,047.51
3.期末基金资产净值	15,895.65	8,150,135,073.09

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。

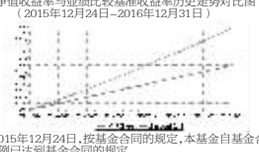
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1、中欧骏盈货币A

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	0.7030%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.3627%	0.0017%

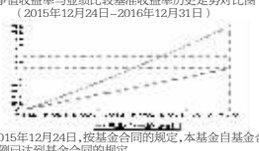
注:本基金收益分配按日结转份额。
2、中欧骏盈货币B

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	0.7627%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.4224%	0.0017%

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
中欧骏盈货币A
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月24日-2016年12月31日)



注:本基金基金合同生效日期为2015年12月24日,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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。
中欧骏盈货币B
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月24日-2016年12月31日)



注:本基金基金合同生效日期为2015年12月24日,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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。

§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		
刘德元	基金经理	2015年12月24日	-	11年	历任大公国际资信评估有限公司技术总监、阳光资产管理股份有限公司高级研究员。2015年6月加入中欧基金管理有限公司,曾任信用研究员、中欧瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧凯丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任中欧稳健回报债券型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧兴利债券型证券投资基金基金经理、中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理、中欧瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧骏盈货币市场基金基金经理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金经理、中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理、中欧强利债券型证券投资基金基金经理、中欧瑞悠灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧强惠债券型证券投资基金基金经理、中欧强裕债券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 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
报告期内,市场资金面趋紧,流动性告急,组合一方面降低了杠杆,做好了流动性管理,期限搭配和杠杆维持适当水平;另外一方面,加强合规监管指标的管理,在市场剧烈调整中,较好的保证了组合满足各项监管指标的要求。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,A类份额净值收益率为0.7030%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;B类份额净值收益率为0.7627%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。
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	固定收益投资	6,076,855,302.09	71.05
	其中:债券	5,622,954,980.59	65.74
	资产支持证券	453,900,321.50	5.31
2	买入返售金融资产	2,449,896,614.83	28.64
	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	1,874,494.58	0.02
4	其他资产	24,060,872.12	0.28
5	合计	8,552,687,283.62	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	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	2.61
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	399,829,200.25	4.91
	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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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120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	57.28	4.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	1.54	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	20.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	20.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.65	4.91

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240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240天。
5.5 报告期末投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	540,436,558.92	6.63
	其中:政策性金融债	540,436,558.92	6.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	814,293,481.17	9.99
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,268,224,940.50	52.37
8	其他	-	-
9	合计	5,622,954,980.59	68.99
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。
5.6 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	111612159	16北京银行CD159	11,000,000	1,092,700,683.79	13.41
2	111616126	16上海银行CD126	5,000,000	499,836,123.57	6.13
3	111613097	16浙商CD097	5,000,000	499,799,940.03	6.13
4	111696572	16杭州银行CD100	4,000,000	399,231,505.47	4.90
5	111680731	16邵邦华一银行CD034	3,000,000	292,727,957.72	3.59
6	111680994	16中原银行CD167	3,000,000	292,713,384.58	3.59
7	111696937	16宁波银行CD186	2,500,000	248,828,884.83	3.05
8	120223	12国开23	2,050,000	204,570,502.04	2.51
9	111607106	16招行CD106	2,000,000	199,919,931.11	2.45
10	111619104	16恒丰银行CD104	2,000,000	199,794,862.13	2.45

5.7 "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	0.1044%
报告期内偏离度的最低值	-0.2017%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0611%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。
5.8 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689179	16开元2A2	4,000,000	387,293,728.06	4.75
2	1689086	16永生1A1	300,000	25,529,544.77	0.31
3	1689038	16睿程1A2	670,000	15,396,377.84	0.19
4	1589160	15平银1A2	1,200,000	15,078,803.31	0.19
5	123836	PR一A4	171,000	8,101,207.76	0.10
6	123978	PR德润A2	90,000	2,500,659.76	0.03

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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。
5.9.2
本基金投资的前十大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。
5.9.3 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	24,060,872.12
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	24,060,872.12

5.9.4 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

	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
报告期期初基金份额总额	16,194.76	8,088,441,025.58
报告期期间基金总申购份额	10,065.82	61,694,047.51
报告期期间基金总赎回份额	10,364.93	-
报告期期末基金份额总额	15,895.65	8,150,135,073.09

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、中欧骏盈货币市场基金相关批准文件
2、《中欧骏盈货币市场基金基金合同》
3、《中欧骏盈货币市场基金托管协议》
4、《中欧骏盈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
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
二〇一七年一月二十日

中欧明睿新常态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 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根据本基金合同规定,于2017年1月18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	中欧明睿新常态混合
基金主代码	001811
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年3月3日
报告期末基金份额总额	155,003,029.46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

§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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	605,040.86
2.本期利润	-5,610,691.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0344
4.期末基金资产净值	142,578,425.97
5.期末基金份额净值	0.920

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