

中欧强盈定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

本报告期内,基金份额净值增长率为1.03%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,420,077,892.88	98.53
其中:债券	1,285,077,892.88	83.50	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	50,000,000.00	3.36
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	28,526,228.97	1.91
8	其他资产	29,308,793.02	1.97
9	合计	1,480,443,015.29	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
本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,746,000.00	4.38
其中:政策性金融债	49,746,000.00	4.40	
4	企业债券	667,709,000.00	60.03
5	企业短期融资券	601,817,000.00	53.22
6	中期票据	176,234,000.00	15.65
7	可转换债券(含交换债)	14,400,000.00	1.28
8	资产支持证券	19,082,000.00	1.71
9	其他债券	-	-
10	合计	1,283,077,892.88	113.64

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	130003	13国债(3)	800,000	79,206,000.00	7.04
2	011710139	17国债逆回购013	600,000	50,505,000.00	4.50
3	011710106	17国债逆回购016	500,000	50,315,000.00	4.50
4	041746004	17债通新001	500,000	50,305,000.00	4.50
5	1400102	14国债(2)	500,000	42,060,000.00	4.21

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

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。

§2 基金产品概况

基金名称	中欧强盈定期开放债券型证券投资基金
基金主代码	000830
基金运作方式	定期开放,开放式
基金合同生效日期	2016年02月24日
报告期末基金份额总额	53,494,227.98份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合财富收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于较低风险收益的产品。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
1.本期已实现收益	10,348,443.08		
2.本期利润	10,151,620.86		
3.本期中基金费用总额	186,822.22		
4.本期基金份额净值	1.0036		
5.本期基金份额持有人数量	969,174,288.95		

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。

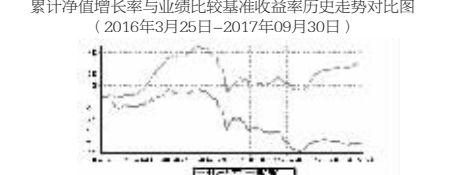
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.03%	0.02%	-0.15%	0.03%	1.18%	0.00%

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的比较

中欧强盈定期开放债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年9月25日-2017年09月30日)



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10月26日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。

§2 基金产品概况

基金名称	中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金
基金主代码	000728
基金运作方式	定期开放,开放式
基金合同生效日期	2016年02月23日
报告期末基金份额总额	53,494,227.98份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合财富收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于较低风险收益的产品。
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

主要财务指标		报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
1.本期已实现收益	-2,060,749.26		
2.本期利润	1,281,227.78		
3.本期中基金费用总额	1,092.62		
4.本期基金份额净值	54.47%	17.44%	
5.本期基金份额持有人数量	1,944,156.56		

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。

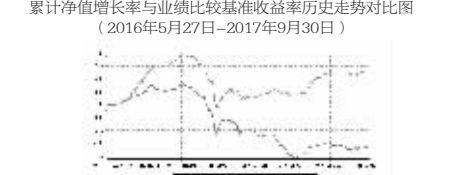
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.07%	-0.15%	0.03%	0.82%	0.04%

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的比较

中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年5月27日-2017年9月30日)



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10月26日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。基金管理人及基金托管人履行各自职责,不保证基金一定盈利,并不承担基金投资中的任何风险。

§2 基金产品概况

基金名称	中欧强泽债券型证券投资基金
基金主代码	000800
基金运作方式	定期开放,开放式
基金合同生效日期	2017年02月24日
报告期末基金份额总额	253,381,748.69份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金管理人运用多策略资产配置管理,在严格控制投资组合风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合财富收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于货币型基金,属于较低风险收益的产品。
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

主要财务指标		报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
1.本期已实现收益	3,438,567.89		
2.本期利润	3,499,499.28		
3.本期中基金费用总额	60,931.39		
4.本期基金份额净值	28.61%	1.85%	
5.本期基金份额持有人数量	1,688,556.56		

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。

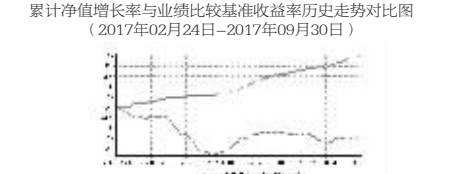
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.89%	0.08%	-0.15%	0.03%	3.04%	0.05%

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的比较

中欧强泽债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年02月24日-2017年09月30日)



中欧强盈定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

本报告期内,基金份额净值增长率为1.03%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,420,077,892.88	98.53
其中:债券	1,285,077,892.88	83.50	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	50,000,000.00	3.36
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	28,526,228.97	1.91
8	其他资产	29,308,793.02	1.97
9	合计	1,480,443,015.29	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
本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,746,000.00	4.38
其中:政策性金融债	49,746,000.00	4.40	
4	企业债券	667,709,000.00	60.03
5	企业短期融资券	601,817,000.00	53.22
6	中期票据	176,234,000.00	15.65
7	可转换债券(含交换债)	14,400,000.00	1.28
8	资产支持证券	19,082,000.00	1.71
9	其他债券	-	-
10	合计	1,283,077,892.88	113.64

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	130003	13国债(3)	800,000	79,206,000.00	7.04
2	011710139	17国债逆回购013	600,000	50,505,000.00	4.50
3	011710106	17国债逆回购016	500,000	50,315,000.00	4.50
4	041746004	17债通新001	500,000	50,305,000.00	4.50
5	1400102	14国债(2)	500,000	42,060,000.00	4.21

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

中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

本报告期内,基金份额净值增长率为0.69%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,586,720.22	86.81
其中:债券	46,586,720.22	86.81	
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:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	7,400,107.54	14.01
8	其他资产	46,308,971.67	86.80
9	合计	54,003,812.74	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
本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,351,000.00	72.12
其中:政策性金融债	39,351,000.00	72.12	
4	企业债券	6,500,000.00	11.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债券(含交换债)	646,000.00	1.19
8	资产支持证券	-	-
9	其他债券	-	-
10	合计	46,586,720.22	86.81

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	130017	13国债(7)	200,000	19,876,000.00	36.49
2	170015	17			