中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年04月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4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1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧瑾通灵活配置混合	
基金主代码	002009	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年11月17日	
报告期末基金份额总额	50,527,410.23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	金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧瑾通灵活配置混合A	中欧瑾通灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	002009	002010
报告期末下属分级基金的份额总额	290.68份	50,527,119.55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01月01日-2016年03月31日)	
	中欧瑾通灵活配置混合A	中欧瑾通灵活配置混合C
1.本期已实现收益	7.21	11,320,107.60
2.本期利润	2.62	5,801,998.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090	0.0052
4.期末基金资产净值	294.49	50,935,347.79
5.期末基金份额净值	1.013	1.008

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

中欧瑾通灵活配置混合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	0.90%	0.07%	0.69%	0.01%	0.21%	0.06%

中欧瑾通灵活配置混合C

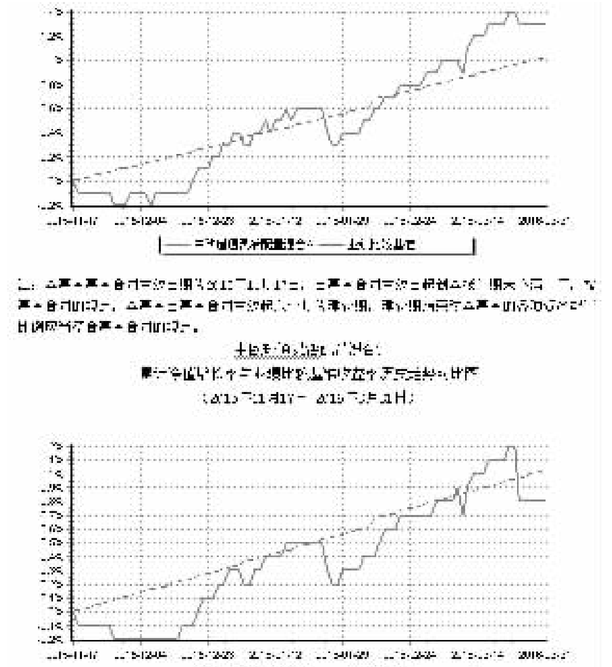
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.08%	0.69%	0.01%	-0.19%	0.07%

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

中欧瑾通灵活配置混合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11月17日-2016年3月31日)



注:本基金基金合同生效日期为2015年11月17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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例应当符合基金合同的规定。

§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		
孙甜	基金经理	2015年11月17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、海通海蓝宝益、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、中欧信用增利分级债券型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,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,中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧滚钱宝发起式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发起式证券投资基金基金经理,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾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,中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金经理。
吴启权	基金经理	2015年11月17日		8年	历任中信建投证券股份有限公司研究发展部高级副总裁。2015年3月加入中欧基金管理有限公司,曾任中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理兼研究员,现任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘德元	基金经理	2015年11月27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,现任中欧增强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,中欧瑾和灵活配置混合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,中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪丰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。
张跃鹏	基金经理	2015年11月27日		6年	历任上海永邦投资有限公司投资经理,上海涌泉亿信投资发展中心(有限合伙)策略分析师。2013年9月加入中欧基金管理有限公司,曾任交易员,现任中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑾和灵活配置混合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

基本面方面,一季度经济基本面有探底企稳的迹象。年初经济延续15年底下行惯性,继续表现颓靡,工业增加值、进出口、固定资产投资等数据都持续恶化。但进入3月后,在基建发力、地产投资回升、大宗商品上涨改善企业盈利状况等因素下,整体经济呈现回暖态势。另一方便通胀预期升温,受蔬菜价格、猪肉价格以及房屋租金上涨的影响,CPI同比数据在2月冲高,3月继续维持较高位置,同时大宗商品价格上涨带动PPI同比跌幅缩窄。

货币政策在一季度整体保持适度宽松,两会前降准是在美元加息暂缓汇率环境稳定的影响下,央行借降准释放长期流动性,以此填补此前积压的流动性缺口。而整体流动性除在春节提现因素及3月末MPA考核的影响下出现了阶段性扰动外,总体呈现宽松态势。

策略方面,随着基本面的回暖,A股一季度大幅下行后呈现逐步回暖的态势,新股投资在一季度表现出比较稳定的收益率,本基金在新股配置和债券配置的结合下,获得了稳定的净值增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准收益率为0.69%;C级份额净值增长率为0.50%,同期业绩比较基准收益率为0.69%。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,092,800.00	86.44
	其中:债券	48,092,800.00	86.44
	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	6,653,328.75	11.96
8	其他资产	891,785.20	1.60
9	合计	55,637,913.95	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沪港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	国家债券	10,012,000.00	19.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	38,080,800.00	74.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,092,800.00	94.42

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	112314	16华南01	300,000	30,000,000.00	58.90
2	019515	15国债15	100,000	10,012,000.00	19.66
3	127301	15武清债	40,000	4,072,800.00	8.00
4	136147	16中粮01	40,000	4,008,000.00	7.87

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	325,366.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	566,418.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	891,785.20

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

	中欧瑾通灵活配置混合A	中欧瑾通灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	290.68	1,999,826,142.95
报告期期间基金总申购份额	-	49,800.80
减:报告期期间基金总赎回份额	-	1,949,348,824.20
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	290.68	50,527,119.55

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、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧瑾通灵活配置混合型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

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
二〇一六年四月二十一日

中欧骏盈货币市场基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

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:2016年04月21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2016年4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1月1日起至2016年3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	1,203,972,634.61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	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	17,111.70份	1,203,955,522.91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01月01日-2016年03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	94.72	3,873,555.92
2.本期利润	94.72	3,873,555.92
3.期末基金资产净值	17,111.70	1,203,955,522.91

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	0.5552%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.2186%	0.0003%

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	0.6164%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.2798%	0.0003%

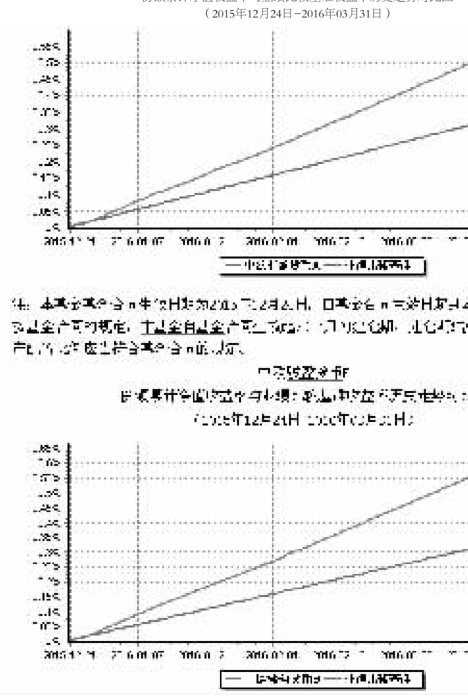
注:本基金收益分配按日结转份额。

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

份额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03月31日)



注:本基金基金合同生效日期为2015年12月24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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例应当符合基金合同的规定。

§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,现任中欧增强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,中欧瑾和灵活配置混合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,中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧琪丰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。

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

本基金保持组合流动性的基础上,配置收益相对较高的并具有较高流动性的债券。

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0.5552%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%;B类份额净值收益率为0.6164%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	1,166,873,502.30	96.89
	其中:债券	1,166,873,502.30	96.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,000,150.00	1.66
	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	17,175,487.17	1.43
4	其他资产	277,532.62	0.02
5	合计	1,204,326,672.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

本基金本报告期内未发生回购融资情况。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内未发生回购融资情况。

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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

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	3.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	51.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	45.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.01	-

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	64,852,293.40	5.39
	其中:政策性金融债	64,852,293.40	5.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,102,021,208.90	91.53
8	其他	-	-
9	合计	1,166,873,502.30	96.92
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	111618005	16华夏CD005	2,400,000	239,041,972.57	19.85
2	111609080	16浦发CD080	2,400,000	237,315,861.58	19.71
3	111617025	16光大CD025	2,400,000	237,315,861.58	19.71
4	111607042	16招行CD042	2,300,000	229,082,024.70	19.03
5	111615016	16民生CD016	1,000,000	99,613,600.22	8.27
6	090410	09农发10	650,000	64,852,293.40	5.39
7	111612028	16北京银行CD028	500,000	49,772,830.09	4.13
8	111608059	16中信CD059	100,000	9,879,058.16	0.82

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	0.0295%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0084%

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16中信CD59(11608059)的发行主体,中信银行股份有限公司(以下简称银行)于2016年1月29日发布公告,中信银行兰州分行发生票据业务风险事件。经核查,涉及风险金额为人民币9.69亿元。目前,公安机关已立案侦查。银行正积极配合侦办工作,加强与相关机构协调沟通,最大限度保证资金安全。在上述公告公布后,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述立案侦查不会对16中信CD059(11608059)的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

本基金投资的前十大持仓证券中其余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	277,532.62
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	277,532.62

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

	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	17,137.32	200,081,966.99
报告期期间基金总申购份额	94.72	1,003,873,555.92
报告期期间基金总赎回份额	120.34	-
报告期期末基金份额总额	17,111.70	1,203,955,522.91

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 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

7.3 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
二〇一六年四月二十一日

信达澳银转型创新股票型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
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4月21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2016年4月20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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银转型创新股票
基金主代码	001105
交易代码	001105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
报告期末基金份额总额	1,204,169,054.14份
投资目标	在有效控制风险的前提下,深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇,力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金,核心投资策略为股票精选策略,同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金是股票型基金,长期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于风险及预期收益较高的证券投资基金产品。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
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1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-201,132,498.08
2.本期利润	-252,831,781.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2058
4.期末基金资产净值	710,361,409.06
5.期末基金份额净值	0.590

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

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	-25.88%	3.42%	-11.43%	2.06%	-14.45%	1.36%

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

注:1、本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%;债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%;资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的20%。

2、本基金基金合同生效日2015年4月15日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柴妍	本基金的基金经理、红利回报混合基金的基金经理、新能源产业股票基金的基金经理	2015年8月19日	-	8年	华东理工大学经济学硕士。2008年5月至2010年1月就职于元大证券,任研究部研究员;2010年5月加入信达澳银基金管理有限公司,历任研究咨询部研究员、信达澳银产业升级混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2015年7月9日起至今)、信达澳银新能源产业股票基金基金经理(2015年8月12日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年8月19日起至今)。
杜蜀鹏	原本基金的基金经理、原精华配置混合基金的基金经理、原消费优选混合基金的基金经理、原红利回报混合基金的基金经理	2015年4月15日	2016年1月22日	8年	中国人民银行研究生部金融学硕士。2008年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2012年4月6日起至2016年1月22日)、信达澳银消费优选混合基金基金经理(2013年12月19日起至2016年1月22日)、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2015年2月14日起至2016年1月22日)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至2016年1月22日)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金年初以来仓位偏高,所以在股市下跌中有较大的净值损失。2月上中旬市场有一波小幅反弹,之后股市继续暴跌,本基金没有及时减仓,没有保住反弹中的收益。行业配置上,年初本基金配置了较多的传媒股,而传媒板块跌幅较大,对净值造成了一定的损失。3月以来,逐渐增加了新能源汽车板块的配置,取得了一定的收益。报告期末本基金持有较多的行业包括:新能源、电子、传媒。

经历了股市剧烈波动的休整,3月以来市场企稳反弹,部分基本面较好的个股已经有一定的收益,对二季度市场不悲观,认为仍有操作的空间,本基金后续的基本思路还是结合产业基本面和公司基本面,从个股入手,寻找优质的成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.590元,份额累计净值为0.590元,报告期内份额净值增长率-25.88%,同期业绩比较基准收益率为-11.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	625,606,034.12	85.36
	其中:股票	625,606,034.12	85.36
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	-	-
	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	92,483,533.84	12.62
8	其他资产	14,842,490.25	2.03
9	合计	732,932,058.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	19,344,343.32	2.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	366,396,459.87	51.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	121,859,133.96	17.15
J	金融业	32,321,199.75	4.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,661,471.72	3.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,509,756.63	2.32
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	45,513,668.87	6.41
S	综合	-	-
	合计	625,606,034.12	88.07

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	300322	硕贝德	2,546,768	38,048,713.92	5.36
2	000887	中鼎股份	1,635,400	34,817,666.00	4.90
3	300324	旋极信息	712,639	34,634,255.40	4.88
4	300014	亿纬锂能	1,252,186	34,309,896.40	4.83
5	601198	东兴证券	1,197,525	32,321,199.75	4.55
6	002456	欧菲光	1,136,065	30,151,165.10	4.24
7	002445	中南重工	1,486,192	29,575,220.80	4.16
8	300161	华中数控	1,064,587	24,485,501.00	3.45
9	002343	慈文传媒	491,419	23,828,907.31	3.35
10	300058	蓝色光标	2,236,434	23,661,471.72	3.33

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

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

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

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报告期内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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

2015年7月16日,江西证监局出具了《关于东兴证券(601198)南昌抚河北路滕王阁证券营业部采取责令改正措施的决定》,指出该营业部自2010年8月至2015年4月在江西省上饶市余干县利用固定场所非法经营证券业务,鉴于该营业部能够认识到问题严重性,采取措施主动整改,未造成严重后果,但上述行为反映该营业部存在内部控制不完善的问题,对该营业部采取责令改正的监管措施,并提交书面整改报告。

根据该公司的公告,该公司严肃追究了有关人员的责任,并督导营业部强化内部管理,并对上述问题进行了整改。基金管理人经审慎分析,认为该处罚对公司经营和价值应不会构成重大影响。

2015年6月23日,北京证监局出具了《关于对东兴证券股份有限公司(601198)采取责令定期报告监管措施的决定》,因2015年5月29日,该公司证券集中交易系统部分运行异常,导致公司部分客户无法及时登陆交易,该公司未就该信息安全事件及时向北京证监局报告,而对该公司采取责令定期报告的监管措施,要求该公司在2015年6月15日至2015年12月15日期间,每15日向北京证监局报送一份有关信息系统运行情况的书面报告。

基金管理人分析认为,该公司表示后续将重视信息系统安全建设,并按照监管部门要求,进一步梳理内部制度和相关流程,认真进行整改并履行定期报告报送要求。该公司证券集中交易系统已经恢复正常,客户已经可以正常登陆并交易,该事宜得到妥善解决。基金管理人经审慎分析,认为该处罚对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除东兴证券(601198)外,其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有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,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	558,941.45
2	应收证券清算款	13,786,115.69
3	应收股利	-
4	应收利息	23,518.78
5	应收申购款	473,914.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,842,490.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注: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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,221,216,154.29
报告期期间基金总申购份额	49,284,799.09
减:报告期期间基金总赎回份额	66,331,899.24
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	1,204,169,054.14

§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

注:基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。