

中欧明睿新常态混合型证券投资基金

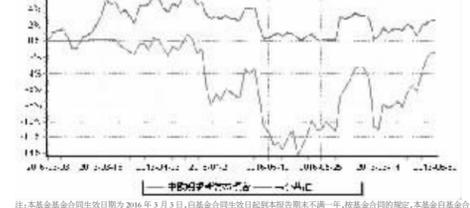
2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日
1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -4,200,49.27
2.本期利润 -4,214,845.62
3.期末净资产 181,404,870.18

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,本期利润为本基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.期末基金份额净值不包括持有人认购及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。



注:本基金基金合同生效日期为2016年3月31日,自基金合同生效日起至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

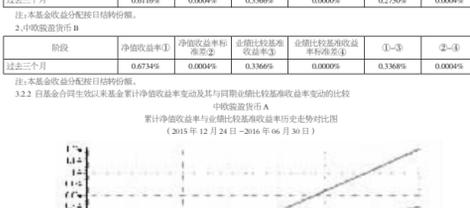
注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任日期为基金合同生效日。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

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 166,277,313.13 89.76
其中:股票 166,277,313.13 89.76
2 基金投资 -- --
3 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
货币 -- --
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 -- --
7 银行存款和结算备付金合计 15,281,177.29 8.23
8 其他资产 3,725,565.66 2.01
9 合计 185,284,056.08 100.00

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:兴证银行股份有限公司
报告送出日期:2016年07月19日
5.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

5.2 基金产品概况
基金名称 中欧明睿新常态混合
基金代码 001787
基金运作方式 契约型、开放式
基金合同生效日 2016年12月24日
报告期末基金份额总额 6,635,847,700.05份

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 104.59
2.本期利润 104.59
3.期末净资产 17,165.91
4.期末基金份额净值 1.1765元/份



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至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

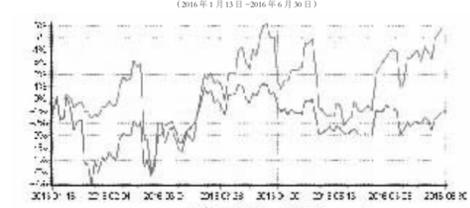
2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7月19日
5.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 16,402,253.81
2.本期利润 13,666,492.20
3.期末净资产 308,538,703.76

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,本期利润为本基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.期末基金份额净值不包括持有人认购及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。



注:本基金基金合同生效日期为2016年3月31日,自基金合同生效日起至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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 基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

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 203,635,793.47 64.79
其中:股票 203,635,793.47 64.79
2 基金投资 -- --
3 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
货币 -- --
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 -- --
7 银行存款和结算备付金合计 92,569,877.88 29.45
8 其他资产 18,108,310.39 5.76
9 合计 314,313,981.84 100.00

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:兴证银行股份有限公司
报告送出日期:2016年07月19日
5.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

5.2 基金产品概况
基金名称 中欧骏盈货币市场基金
基金代码 001788
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 6,635,847,700.05份

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 104.59
2.本期利润 104.59
3.期末净资产 17,165.91
4.期末基金份额净值 1.1765元/份



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至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

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 -- --
B 采矿业 -- --
C 制造业 16,008,384.22 37.52
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 6,099,097.28 3.69
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 61,164,394.32 33.72
J 金融业 -- --
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、环境和公共设施服务业 -- --
O 信息服务、软件和信息技术服务业 1,111,316.50 0.36
P 教育 -- --
Q 卫生健康 -- --
R 文化、体育和娱乐业 -- --
S 综合 -- --
合计 203,635,793.47 64.79

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 16,402,253.81
2.本期利润 13,666,492.20
3.期末净资产 308,538,703.76

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,本期利润为本基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.期末基金份额净值不包括持有人认购及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。



注:本基金基金合同生效日期为2016年3月31日,自基金合同生效日起至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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 基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

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 203,635,793.47 64.79
其中:股票 203,635,793.47 64.79
2 基金投资 -- --
3 固定收益投资 -- --
其中:债券 -- --
货币 -- --
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 -- --
7 银行存款和结算备付金合计 92,569,877.88 29.45
8 其他资产 18,108,310.39 5.76
9 合计 314,313,981.84 100.00

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:兴证银行股份有限公司
报告送出日期:2016年07月19日
5.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

5.2 基金产品概况
基金名称 中欧骏盈货币市场基金
基金代码 001788
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 6,635,847,700.05份

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 104.59
2.本期利润 104.59
3.期末净资产 17,165.91
4.期末基金份额净值 1.1765元/份



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至本报告期末不满一年,按基金合同的约定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期间期末的各项资产占比应当符合基金合同约定。

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
任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。

注:1.任职日期和离任日期一般指如下情况:聘任日期或由基金合同生效日起聘任,则聘任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。
3.基金经理的从业年限指其在证券行业从事基金业务、证券投资管理等工作的年限,计算方法如下:
(1)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限;
(2)取得基金从业资格,从事基金业务、证券投资管理工作,达到三年以上,且最近一年未在证券公司从事与客户开发无关的其他业务活动的年限,无法追溯,未发生基金合同承诺或基金合同约定有违约行为的;
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《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规定,从研究分析、投资决策、交易执行等方面确保公平交易制度的落实,未发现异常交易行为。