中欧瑾泉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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2016年07月19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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7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4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧瑾泉灵活配置混合	
基金主代码	001110	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年03月16日	
报告期末基金份额总额	757,472,408.38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数量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、风险控制要素等因素,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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧瑾泉灵活配置混合A	中欧瑾泉灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001110	001111
报告期末下属分级基金的份额总额	3,511,903.17份	753,960,505.21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04月01日-2016年06月30日)	
	中欧瑾泉灵活配置混合A	中欧瑾泉灵活配置混合C
1.本期已实现收益	36,216.18	5,214,419.42
2.本期利润	39,994.75	5,767,037.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0076
4.期末基金资产净值	4,708,546.43	802,825,773.82
5.期末基金份额净值	1.341	1.065

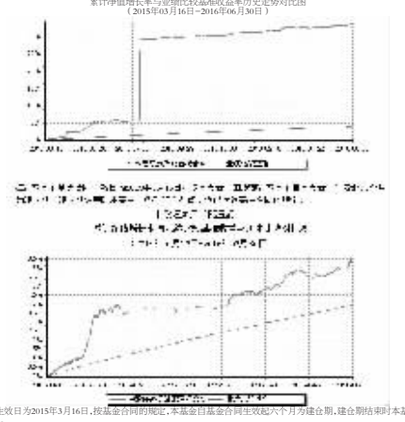
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中欧瑾泉灵活配置混合A

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%

中欧瑾泉灵活配置混合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	0.76%	0.07%	0.69%	0.01%	0.07%	0.06%

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
中欧瑾泉灵活配置混合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03月16日-2016年06月30日)



注:本基金基金合同生效日为2015年3月16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		
蒋兰	基金经理	2015年03月16日	2016年04月22日	5年	历任国金证券股份有限公司研究所研究员,民生加银基金管理有限公司研究员,2014年10月加入中欧基金管理有限公司,历任研究员,中欧明睿新起点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。
吴启权	基金经理	2015年05月25日	2016年06月17日	8年	历任中信建投证券股份有限公司研发策略高级副总裁,2015年3月加入中欧基金管理有限公司,曾任中欧盈利分级债券型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧瑞泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧盈利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼研究员,中欧盈利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧瑞泉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,中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中欧瑞