

**中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要**

**2016年06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**

**送出日期：2016年08月24日**

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                 |                 |
|---------------------|-----------------|-----------------|
| 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     |                 |
| 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      |                 |
| 报告期末基金份额总额          | 757,472,408.38份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期             |                 |
| 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<br>额总额 | 3,511,903.17份   | 753,960,505.21份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                    |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 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。                                                |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目     |    | 基金管理人      | 基金托管人      |
|--------|----|------------|------------|
| 名称     |    | 中欧基金管理有限公司 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露负责 | 姓名 | 黎忆海        | 方韡         |

|        |      |                               |                       |
|--------|------|-------------------------------|-----------------------|
| 人      | 联系电话 | 021-68609600                  | 010-89936330          |
|        | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com            | fangwei@citicbank.com |
| 客户服务电话 |      | 021-68609700、<br>400-700-9700 | 95558                 |
| 传真     |      | 021-33830351                  | 010-85230024          |

## 2.4 信息披露方式

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 登载基金半年度报告正文的<br>管理人互联网网址 | www.zofund.com   |
| 基金半年度报告备置地点              | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

|               | 中欧瑾泉灵活配置混合A                  | 中欧瑾泉灵活配置混合C    |
|---------------|------------------------------|----------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016年01月01日-2016年06月30日） |                |
| 本期已实现收益       | 95,088.56                    | 25,997,635.03  |
| 本期利润          | 99,708.50                    | 17,707,420.78  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0287                       | 0.0149         |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.21%                        | 1.91%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年06月30日)            |                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3045                       | 0.0310         |
| 期末基金资产净值      | 4,708,546.43                 | 802,825,773.82 |
| 期末基金份额净值      | 1.3410                       | 1.0650         |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所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，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

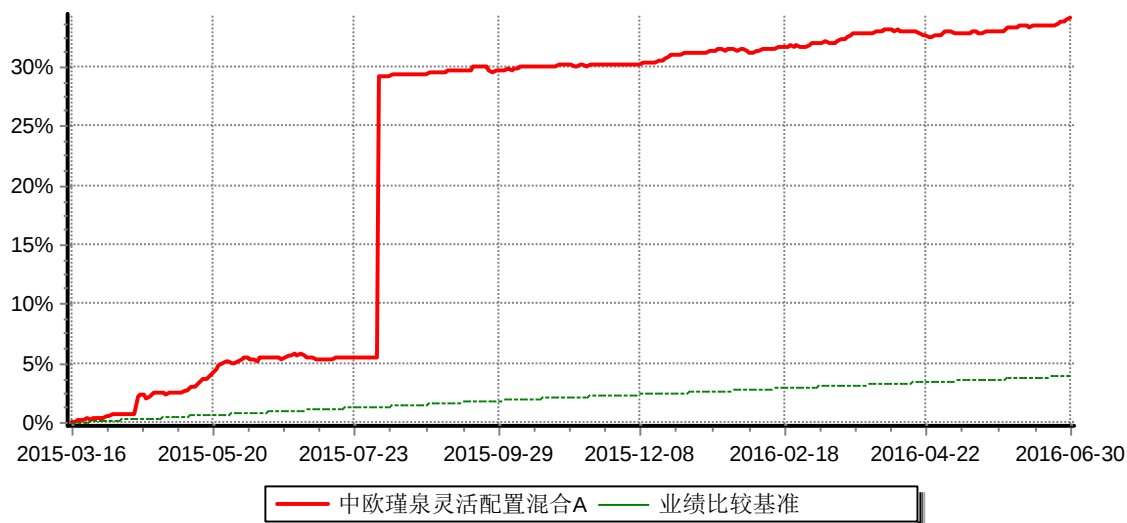
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段<br>(中欧瑾泉灵活配置混合A) | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|---------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月               | 0.68%    | 0.07%       | 0.23%      | 0.01%         | 0.45%  | 0.06% |
| 过去三个月               | 0.90%    | 0.07%       | 0.69%      | 0.01%         | 0.21%  | 0.06% |
| 过去六个月               | 2.21%    | 0.07%       | 1.37%      | 0.01%         | 0.84%  | 0.06% |
| 过去一年                | 26.75%   | 1.44%       | 2.87%      | 0.01%         | 23.88% | 1.43% |
| 自基金合同生效日起至今         | 34.10%   | 1.26%       | 3.94%      | 0.01%         | 30.16% | 1.25% |

| 阶段<br>(中欧瑾泉灵活配置混合C) | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|---------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月               | 0.66%    | 0.08%       | 0.23%      | 0.01%         | 0.43%  | 0.07% |
| 过去三个月               | 0.76%    | 0.07%       | 0.69%      | 0.01%         | 0.07%  | 0.06% |
| 过去六个月               | 1.91%    | 0.07%       | 1.37%      | 0.01%         | 0.54%  | 0.06% |
| 过去一年                | 2.40%    | 0.06%       | 2.87%      | 0.01%         | -0.47% | 0.05% |
| 自基金合同生效日起至今         | 6.50%    | 0.08%       | 3.94%      | 0.01%         | 2.56%  | 0.07% |

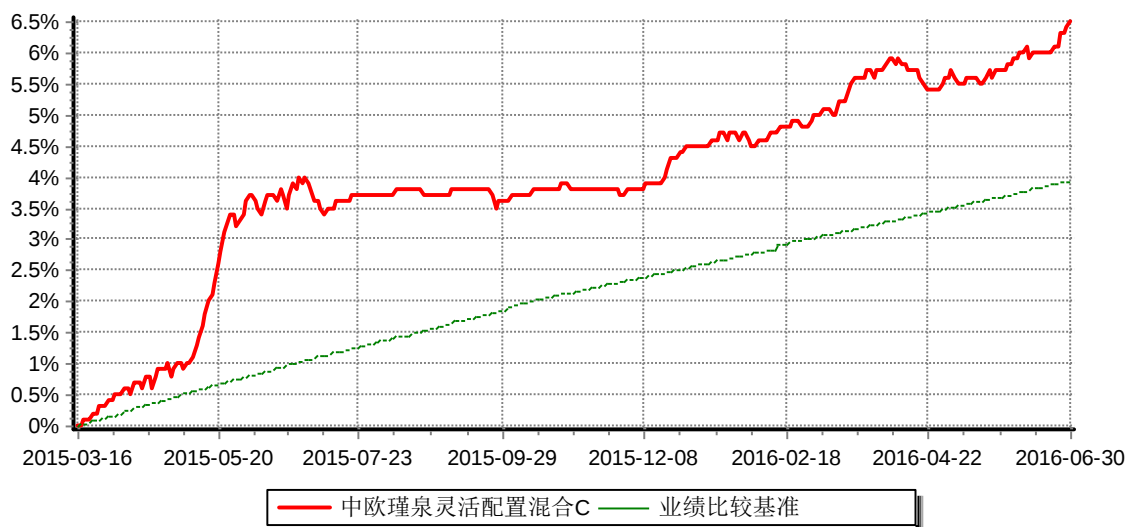
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

中欧瑾泉灵活配置混合C  
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 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年6月30日，本基金管理人共管理40只开放式基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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        |        |                                                                                                                                                        |
| 葛兰  | 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。 |
| 牛伟耕 | 基金经理助理 | 2015年04月03日     | 2016年05月09日 | 3年     | 历任上海海通证券资产管理有限公司债券研究员，德邦基金管理有限公司债券研究员。2015年4月加入中欧基金管理有限公司，任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                                                           |

|     |          |                 |                 |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----|----------|-----------------|-----------------|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |                 |                 |    | 资基金的基金经理助理兼研究员。                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 吴启权 | 基金经<br>理 | 2015年05月<br>25日 | 2016年06月<br>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、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，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。 |
| 孙甜  | 基金经<br>理 | 2015年06月<br>18日 | —               | 7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                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |      |             |   |    |                                                                                                                                                                                                           |
|-----|------|-------------|---|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |             |   |    | 基金经理，中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金经理，中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                       |
| 张跃鹏 | 基金经理 | 2016年01月12日 | — | 7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合规守信情况的说明

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。

2015年上半年，中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施，同时对公司原督察长黄桦

先生予以警示。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，整体经济、商品市场和金融市场均呈现出了底部振荡的形态。工业增加值同比增速稳定在6%的低位附近、全社会用电量同比增速亦稳定在2%左右的较低位置，显示经济增速持续疲软，呈"L"型的右侧底部盘整。在民间投资同比增速跌至零附近的情况下，基建和房地产成为上半年托底经济的主要抓手，其中全社会固定资产投资完成额同比增速基本维持在10%左右，主要动能源自二季度以来房地产开工重启带来的增速底部回升。

但是，受制于供给瓶颈，大宗商品的价格波动则远远超过了平稳的经济增长。受到唐山地区屡次环保限产的影响，叠加开春之后房地产新开工增加，钢材的社会库存被迅速消化，外加金融资本涌入大宗商品市场后的疯狂炒作，螺纹钢为代表的黑色产业链价格一度巨幅回升。部分高效钢厂的螺纹钢吨钢毛利一度升至1000元。焦煤、铁矿石等大宗品价格也出现了较大幅度的脉冲式上涨。然而随着5月初权威人士的讲话发布，进一步增加信贷刺激增长的预期被打破，加之高毛利的刺激下，大量2015年底闷炉的高炉纷纷复产，导致黑色产业链价格迅速回落，至5月末重新进入了吨钢亏损区间。进入二季度，由于煤炭全行业严格执行276工作日的减产计划，导致动力煤出现供给瓶颈，环渤

海5500K动力煤价格指数开始稳步回升，至6月底已升至400元以上。螺纹钢为代表的黑色产业链价格亦有所回升。

上半年CPI表现的通胀压力不大，作为食品价格主要推动因素的猪肉已经经过了供不应求的调整期，出现明显的高位回落，但是随着大宗商品价格的脉冲式回暖，PPI同比降幅迅速收窄，带来工业品价格回升的隐忧。

商业银行体系开始大量、主动收缩特定过剩产能、持续亏损企业的信贷投放，加之2015年四季度和2016年一季度的大宗商品价格处于历史低位，许多杠杆较高的企业在一季度出现了明显的周转困难。因此，整个2016年上半年的信用风险事件频频爆发，其中以4月的中铁物资贷款违约影响最甚。由于其存量公募债券较多，导致整个债券和股票市场均在4月出现了大幅调整，一定程度上打断了一度高涨的风险偏好情绪。但是进入二季度末，随着房地产和基建开工需求的持续托底，大宗商品价格重拾低位反弹的趋势。从整个上半年来看，大量过剩产能企业受益于产品价格回暖、成本压缩和资本开支减少，纷纷达到了盈亏平衡的状态。

新的外汇管制环境带来新的货币政策制约。受制于人民币持续贬值的压力，可以看到央行在稳汇率和稳增长两者之间的着力点持续变换。春节之前，为了在季节性外汇流出高峰期间稳定汇率，央行主动维持了偏紧的信贷和货币投放。但是3月开始，随着增长预期的回暖和汇率的稳定，信贷投放节奏重新加快。

在以上错综复杂的环境中，我们积极调整了债券组合策略。在一月利率债收益率下行的尾部行情中，我们通过中短久期底仓放杠杆配置长期利率品种的哑铃型策略，在锁定票息的同时获取了一定资本利得。春节前后，我们判断利率债行情基本结束，因此当时采取了中短久期加仓加杠杆的方式套取稳定的票息。经过4月的脉冲式调整之后，信贷数据出现了雪崩式下滑。我们判断宽松预期会重启，因此开始逐步将部分短久期套息资产置换为长久期利率品种，在6月的下行中再次获取了一定资本利得。

具体债券持仓的行业结构也发生了较大变化。由于房地产市场走势进入了高位盘整的阶段，部分城市的成交量出现调整，我们认为本轮房地产周期的高点已经过去，因此主动压缩了房地产债券在整个组合中的占比。在这个压缩的过程中，主要减持了高杠杆、周转慢、拿地激进的一部分住宅开发商。而在压缩房地产仓位的同时，我们增加了医药流通、基础设施建设、汽车制造等景气波动小或者后周期的品种。虽然大宗商品的价格已经出现了明显的修复，但是我们认为其持续性较为脆弱，且大多数过剩产能发行人的负债率较高，一个季度的微利并不足以修复其资产负债表。因此在钢铁、煤炭、稀土等具有较高绝对收益率的行业上，仍然坚持不配置或者较低配置的策略。

在权益方面，积极参与网下新股投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内,基金A类份额净值增长率为2.21%,同期业绩比较基准收益率为

1.37%；基金C类份额净值增长率为1.91%,业绩比较基准收益率为1.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

汇率问题仍将是下半年影响货币政策节奏的核心因素。由于美国就业市场改善的势头没有改变，强势美元的大趋势很难改变，人民币贬值的压力将持续制约国内货币政策的进一步放松。预计常态化的MLF、SLF和PSL投放将持续放量，然而宽松信号更为强烈的降准和降息等传统货币政策工具将很难被启用。

经济增长方面，预计房地产开发投资叠加基建投资的托底效应仍将持续到三季度，最终完成全年的增长目标。在这个过程中，受益最直接的是与固定资产投资直接相关的上游过剩产能行业。二季度发生的大宗商品价格修复预计能够维持到整个下半年。然而就目前的情形来看，受制于高居不下的不良率制约，银行业对过剩产能行业紧缩信贷的大方向不会改变。因此，下半年较可能出现的情形是采掘及制造业盈利情况改善，资本开支却持续处于历史低位，杠杆逐步去化。在这个情境下，全社会工业企业的固定资产投资不会出现实质性的改善，因此经济增长也不会出现超预期的改善。

有鉴于此，我们认为下半年的利率水平将在振荡中缓慢下行，很难重现2015年四季度的快牛行情。因此，将主要通过快节奏地控制长久期利率债仓位的方式来参与利率水平阶段性的下行机会。

供给侧改革在下半年仍将推进，但是由于具体政策的不同，我们预计煤炭和钢铁两个行业在中期可能会出现分化。在钢铁行业，由于采取的主要是压缩产能或异地搬迁的措施，同时长期行政性的闷炉也给复产带来了极大的成本压力，部分产能将永久性退出市场，重置成本极高，未来钢铁行业的供需基本面存在潜在改善的可能。而煤炭行业执行的是276天限产或者兼并重组，主要通过降低开工率的模式来限制全国产量，一旦煤价反弹至行业全面盈利水平，继续执行限产恐将受到市场自发力量的冲击，供需面出现实质性变化的可能性较小。

具体到券种配置上，我们仍然将坚持上半年标配地产、制造业，超配弱周期，规避煤炭的策略。但是考虑到钢铁行业毛利情况的实质好转以及供给侧改革的推进情况，将在中报公布后，通过分析龙头企业的个体偿债能力以及盈利情况，审慎地研究该行业可能存在的超额回报。

在权益方面，仍将积极参与网下新股投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基

金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——中欧基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金的基金管理人——中欧基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2016年06月30日         | 上年度末<br>2015年12月31日         |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                            |                             |
| 银行存款            | 1,854,979.31               | 129,764,898.63              |
| 结算备付金           | 4,342,015.15               | 25,977,210.94               |
| 存出保证金           | 123,152.16                 | 519,972.57                  |
| 交易性金融资产         | 831,628,712.75             | 491,632,629.28              |
| 其中：股票投资         | 21,730,585.05              | 31,138,661.68               |
| 基金投资            | —                          | —                           |
| 债券投资            | 729,898,127.70             | 460,493,967.60              |
| 资产支持证券投资        | 80,000,000.00              | —                           |
| 贵金属投资           | —                          | —                           |
| 衍生金融资产          | —                          | —                           |
| 买入返售金融资产        | —                          | —                           |
| 应收证券清算款         | 29,389,089.71              | 2,000,373,080.65            |
| 应收利息            | 10,292,927.85              | 10,280,549.60               |
| 应收股利            | —                          | —                           |
| 应收申购款           | 14,671.30                  | 99.99                       |
| 递延所得税资产         | —                          | —                           |
| 其他资产            | —                          | —                           |
| 资产总计            | 877,645,548.23             | 2,658,548,441.66            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                            |                             |

|               |                |                  |
|---------------|----------------|------------------|
| 短期借款          | —              | —                |
| 交易性金融负债       | —              | —                |
| 衍生金融负债        | —              | —                |
| 卖出回购金融资产款     | 69,000,000.00  | —                |
| 应付证券清算款       | —              | —                |
| 应付赎回款         | 42,031.73      | 233.34           |
| 应付管理人报酬       | 395,554.27     | 1,346,981.54     |
| 应付托管费         | 98,888.59      | 336,745.39       |
| 应付销售服务费       | 327,750.59     | 1,120,160.77     |
| 应付交易费用        | 48,056.58      | 138,098.20       |
| 应交税费          | —              | —                |
| 应付利息          | —              | —                |
| 应付利润          | —              | —                |
| 递延所得税负债       | —              | —                |
| 其他负债          | 198,946.22     | 270,000.23       |
| 负债合计          | 70,111,227.98  | 3,212,219.47     |
| <b>所有者权益：</b> |                |                  |
| 实收基金          | 757,472,408.38 | 2,539,146,740.15 |
| 未分配利润         | 50,061,911.87  | 116,189,482.04   |
| 所有者权益合计       | 807,534,320.25 | 2,655,336,222.19 |
| 负债和所有者权益总计    | 877,645,548.23 | 2,658,548,441.66 |

注：1、报告截止日2016年6月30日，基金份额总额757,472,408.38份。A类基金份额净值1.341元，基金份额总额3,511,903.17份；C类基金份额净值1.065元，基金份额总额753,960,505.21份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2016年01月01日-2016<br>年06月30日 | 上年度可比期间2015<br>年03月16日-2015年06<br>月30日 |
|-----|-----------------------------------|----------------------------------------|
|-----|-----------------------------------|----------------------------------------|

|                   |               |                |
|-------------------|---------------|----------------|
| 一、收入              | 27,534,141.46 | 225,117,082.23 |
| 1.利息收入            | 19,362,709.39 | 36,090,521.17  |
| 其中：存款利息收入         | 326,566.65    | 30,972,449.82  |
| 债券利息收入            | 17,175,374.50 | 4,802,415.72   |
| 资产支持证券利息收入        | 1,221,171.23  | —              |
| 买入返售金融资产收入        | 639,597.01    | 315,655.63     |
| 其他利息收入            | —             | —              |
| 2.投资收益            | 16,453,113.10 | 200,914,151.41 |
| 其中：股票投资收益         | 14,150,658.34 | 201,559,277.25 |
| 基金投资收益            | —             | —              |
| 债券投资收益            | 2,249,369.99  | -2,472,186.57  |
| 资产支持证券投资收益        | —             | —              |
| 贵金属投资收益           | —             | —              |
| 衍生工具收益            | —             | —              |
| 股利收益              | 53,084.77     | 1,827,060.73   |
| 3.公允价值变动收益        | -8,285,594.31 | -12,325,936.45 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | —             | —              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 3,913.28      | 438,346.10     |
| 减：二、费用            | 9,727,012.18  | 26,966,131.88  |
| 1. 管理人报酬          | 3,830,300.99  | 11,521,909.36  |
| 2. 托管费            | 957,575.27    | 2,880,477.34   |
| 3. 销售服务费          | 3,180,496.23  | 9,152,589.98   |
| 4. 交易费用           | 182,817.01    | 2,575,097.30   |
| 5. 利息支出           | 1,402,559.64  | 675,722.13     |
| 其中：卖出回购金融资产支出     | 1,402,559.64  | 675,722.13     |
| 6. 其他费用           | 173,263.04    | 160,335.77     |

|                     |               |                |
|---------------------|---------------|----------------|
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 17,807,129.28 | 198,150,950.35 |
| 减：所得税费用             | —             | —              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 17,807,129.28 | 198,150,950.35 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日               |                |                   |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|----------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 2,539,146,740.15                            | 116,189,482.04 | 2,655,336,222.19  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                                           | 17,807,129.28  | 17,807,129.28     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -1,781,674,331.77                           | -83,934,699.45 | -1,865,609,031.22 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,388,764.44                                | 247,712.53     | 1,636,476.97      |
| 2.基金赎回款                                | -1,783,063,096.21                           | -84,182,411.98 | -1,867,245,508.19 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | —                                           | —              | —                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 757,472,408.38                              | 50,061,911.87  | 807,534,320.25    |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |                |                   |
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 3,254,529,077.18                            | —              | 3,254,529,077.18  |

|                                        |                   |                |                   |
|----------------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 值)                                     |                   |                |                   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                 | 198,150,950.35 | 198,150,950.35    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 9,845,152,410.95  | 339,978,082.46 | 10,185,130,493.41 |
| 其中：1.基金申购款                             | 10,149,213,047.63 | 343,471,141.37 | 10,492,684,189.00 |
| 2.基金赎回款                                | -304,060,636.68   | -3,493,058.91  | -307,553,695.59   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | —                 | —              | —                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 13,099,681,488.13 | 538,129,032.81 | 13,637,810,520.94 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第282号《关于准予中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,254,487,319.32元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第194号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年3月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,254,529,077.18份基金份额，包含认购资金利息折合41,757.86份，其中瑾泉A的基金份额总额为125,258,783.14份，包含认购资金利息折合4,413.82份，瑾泉C的基金份额总额为3,129,270,294.04份，包含认购资金利息折合37,344.04份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据基金手续费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申(认)购、赎回时收取申(认)购、赎回费用的，称为A类；不收取申(认)购、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类。本基金A类、C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，各类别基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合中：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2016年8月24日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局/财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起

计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                                      | 与本基金的关系             |
|--------------------------------------------|---------------------|
| 中欧基金管理有限公司（"中欧基金"）                         | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中信银行股份有限公司（"中信银行"）                         | 基金托管人、基金销售机构        |
| 国都证券股份有限公司（"国都证券"）                         | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| 万盛基业投资有限责任公司（"万盛基业"）                       | 基金管理人的股东            |
| 北京百骏投资有限公司（"北京百骏"）                         | 基金管理人的股东            |
| Unione di Banche Italiane S.p.a（"意大利意联银行"） | 基金管理人的股东            |
| 上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（"上海睦亿合伙"）               | 基金管理人的股东            |
| 中欧盛世资产管理（上海）有限公司（"中欧盛世资管"）                 | 基金管理人的控股子公司         |
| 钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司（"钱滚滚财富"）                 | 基金管理人的控股子公司         |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

|      | 2016年01月01日-2016年06月30日 |              | 2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |              |
|------|-------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|      | 成交金额                    | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国都证券 | 24,786,472.02           | 25.16%       | 81,742,066.62                    | 4.84%        |

#### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日               |            |           |            |
|-------|---------------------------------------------|------------|-----------|------------|
|       | 当期佣金                                        | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占应付佣金余额的比例 |
| 国都证券  | 23,084.84                                   | 25.16%     | 20,707.78 | 46.75%     |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |            |           |            |
|       | 当期佣金                                        | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占应付佣金余额的比例 |
| 国都证券  | 74,417.93                                   | 4.84%      | 74,417.93 | 4.84%      |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |            |
|-------|-------------------------------|------------|---------------------------------------------|------------|
|       | 成交金额                          | 占当期债券成交总额的 | 成交金额                                        | 占当期债券成交总额的 |

|      |                | 比例     |                | 比例      |
|------|----------------|--------|----------------|---------|
| 国都证券 | 306,426,391.45 | 64.12% | 158,542,800.00 | 100.00% |

#### 6.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |                | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |                |
|-------|-------------------------------|----------------|---------------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                                        | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国都证券  | 3,192,000,000.00              | 33.92%         | —                                           | —              |

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日 | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,830,300.99                  | 11,521,909.36                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,443.52                      | 11,717.53                                   |

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日 | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 957,575.27                    | 2,880,477.34                                |

注：支付基金托管人 中信银行 的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日               |                 |              |
|--------------------|---------------------------------------------|-----------------|--------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |                 |              |
|                    | 中欧瑾泉灵活配置<br>混合A                             | 中欧瑾泉灵活配置<br>混合C | 合计           |
| 中欧基金               | —                                           | 3,180,446.57    | 3,180,446.57 |
| 中信银行               | —                                           | —               | —            |
| 国都证券               | —                                           | —               | —            |
| 合计                 | —                                           | 3180446.57      | 3180446.57   |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年<br>06月30日 |                 |              |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |                 |              |
|                    | 中欧瑾泉灵活配置<br>混合A                             | 中欧瑾泉灵活配置<br>混合C | 合计           |
| 中欧基金               | —                                           | 9,152,589.98    | 9,152,589.98 |
| 中信银行               | —                                           | —               | —            |
| 国都证券               | —                                           | —               | —            |
| 合计                 | —                                           | 9152589.98      | 9152589.98   |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年率为0.50%，销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.50%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性划付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2015年03月16日（基金合同生效日）-2015年06月30日 |            |
|------------|-------------------------------|------------|---------------------------------------------|------------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                                        | 当期利息收入     |
| 中信银行股份有限公司 | 1,854,979.31                  | 203,111.70 | 3,995,744,659.09                            | 755,533.32 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.9 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |       |           |           |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    |
| 601966              | 玲珑轮胎 | 2016-06-24 | 2016-07-06 | 未上市    | 12.98 | 12.98  | 6,454 | 83,772.92 | 83,772.92 |
| 002805              | 丰元股份 | 2016-06-29 | 2016-07-07 | 未上市    | 5.80  | 5.80   | 971   | 5,631.80  | 5,631.80  |

|        |            |            |            |     |        |        |         |               |               |
|--------|------------|------------|------------|-----|--------|--------|---------|---------------|---------------|
| 300520 | 科大<br>国创   | 2016-06-30 | 2016-07-08 | 未上市 | 10.05  | 10.05  | 926     | 9,306.30      | 9,306.30      |
| 603016 | 新宏<br>泰    | 2016-06-23 | 2016-07-01 | 未上市 | 8.49   | 8.49   | 1,602   | 13,600.98     | 13,600.98     |
| 127003 | 海印<br>转债   | 2016-06-15 | 2016-07-01 | 未上市 | 100.00 | 100.00 | 3,990   | 399,000.00    | 399,000.00    |
| 131848 | 16远<br>东3A | 2016-06-14 | 2016-08-22 | 未上市 | 100.00 | 100.00 | 300,000 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 |

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|
| 000002 | 万科A  | 2015-12-18 | 重大资产重组 | 18.20  | 2016-07-04 | 21.99  | 200,000 | 2,809,955.52 | 3,640,000.00 |
| 600330 | 天通股份 | 2016-05-23 | 重大资产重组 | 15.90  |            |        | 120,000 | 1,506,330.00 | 1,908,000.00 |
| 002059 | 云南旅游 | 2016-06-01 | 筹划重大事项 | 8.56   |            |        | 180,000 | 1,559,557.00 | 1,540,800.00 |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 股价异常波动 | 20.92  | 2016-07-01 | 23.01  | 22,034  | 76,457.98    | 460,951.28   |

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额69,000,000.00元，于2016年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属

的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为14,068,521.77元，属于第二层次的余额为737,560,190.98元，属于第三层次的余额为80,000,000.00（2015年12月31日：第一层次26,252,661.68元，第二层次465,379,967.60元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 21,730,585.05  | 2.48          |
|    | 其中：股票             | 21,730,585.05  | 2.48          |
| 2  | 固定收益投资            | 809,898,127.70 | 92.28         |
|    | 其中：债券             | 729,898,127.70 | 83.17         |
|    | 资产支持证券            | 80,000,000.00  | 9.12          |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 6,196,994.46   | 0.71          |
| 7  | 其他各项资产            | 39,819,841.02  | 4.54          |
| 8  | 合计                | 877,645,548.23 | 100.00        |

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —             |
| B  | 采矿业              | 1,446,000.00 | 0.18          |
| C  | 制造业              | 8,988,015.27 | 1.11          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,569,000.00 | 0.32          |
| E  | 建筑业              | 460,951.28   | 0.06          |
| 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 | 70,492.40     | 0.01 |
| J | 金融业             | 2,995,200.00  | 0.37 |
| K | 房地产业            | 3,640,000.00  | 0.45 |
| L | 租赁和商务服务业        | —             | —    |
| M | 科学研究和技术服务业      | 20,126.10     | —    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 1,540,800.00  | 0.19 |
| 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              | 21,730,585.05 | 2.69 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本报告本期末未持有沪港通股票投资。

### 7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000002 | 万科A  | 200,000 | 3,640,000.00 | 0.45         |
| 2  | 600330 | 天通股份 | 120,000 | 1,908,000.00 | 0.24         |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 400,000 | 1,776,000.00 | 0.22         |
| 4  | 002059 | 云南旅游 | 180,000 | 1,540,800.00 | 0.19         |
| 5  | 601857 | 中国石油 | 200,000 | 1,446,000.00 | 0.18         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 60,000  | 1,423,200.00 | 0.18         |
| 7  | 600660 | 福耀玻璃 | 100,000 | 1,400,000.00 | 0.17         |
| 8  | 600066 | 宇通客车 | 70,000  | 1,386,000.00 | 0.17         |
| 9  | 000423 | 东阿阿胶 | 25,000  | 1,320,750.00 | 0.16         |
| 10 | 600886 | 国投电力 | 200,000 | 1,320,000.00 | 0.16         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.zofund.com网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------------|
| 1  | 600588 | 用友网络 | 1,745,750.00 | 0.07               |
| 2  | 600525 | 长园集团 | 1,673,849.00 | 0.06               |
| 3  | 002665 | 首航节能 | 1,616,802.38 | 0.06               |
| 4  | 600606 | 绿地控股 | 1,612,846.63 | 0.06               |
| 5  | 002414 | 高德红外 | 1,595,600.00 | 0.06               |
| 6  | 601208 | 东材科技 | 1,560,262.56 | 0.06               |
| 7  | 002059 | 云南旅游 | 1,559,557.00 | 0.06               |
| 8  | 300196 | 长海股份 | 1,541,627.88 | 0.06               |
| 9  | 002701 | 奥瑞金  | 1,529,067.80 | 0.06               |
| 10 | 600330 | 天通股份 | 1,506,330.00 | 0.06               |
| 11 | 600236 | 桂冠电力 | 1,490,737.00 | 0.06               |
| 12 | 600487 | 亨通光电 | 1,490,644.50 | 0.06               |
| 13 | 000601 | 韶能股份 | 1,447,662.00 | 0.05               |
| 14 | 300120 | 经纬电材 | 1,439,205.00 | 0.05               |
| 15 | 002402 | 和而泰  | 1,434,902.00 | 0.05               |
| 16 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,358,671.40 | 0.05               |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 1,352,040.00 | 0.05               |
| 18 | 600066 | 宇通客车 | 1,350,060.88 | 0.05               |
| 19 | 002597 | 金禾实业 | 1,345,772.00 | 0.05               |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 1,332,500.00 | 0.05               |

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|--------------|--------------------|
| 1  | 000858 | 五 粮 液 | 5,668,107.40 | 0.21               |
| 2  | 601398 | 工商银行  | 4,347,500.00 | 0.16               |
| 3  | 601857 | 中国石油  | 3,188,502.00 | 0.12               |
| 4  | 600525 | 长园集团  | 2,063,144.90 | 0.08               |
| 5  | 300196 | 长海股份  | 1,968,053.94 | 0.07               |
| 6  | 600236 | 桂冠电力  | 1,805,489.80 | 0.07               |
| 7  | 300120 | 经纬电材  | 1,672,062.52 | 0.06               |
| 8  | 603508 | 思维列控  | 1,647,752.00 | 0.06               |
| 9  | 601208 | 东材科技  | 1,627,495.88 | 0.06               |
| 10 | 002402 | 和而泰   | 1,601,953.25 | 0.06               |
| 11 | 002414 | 高德红外  | 1,556,789.92 | 0.06               |
| 12 | 600487 | 亨通光电  | 1,542,991.90 | 0.06               |
| 13 | 002665 | 首航节能  | 1,531,138.60 | 0.06               |
| 14 | 002074 | 国轩高科  | 1,486,165.39 | 0.06               |
| 15 | 000601 | 韶能股份  | 1,428,192.00 | 0.05               |
| 16 | 300496 | 中科创达  | 1,425,952.80 | 0.05               |
| 17 | 600588 | 用友网络  | 1,413,960.00 | 0.05               |
| 18 | 600606 | 绿地控股  | 1,330,639.42 | 0.05               |
| 19 | 601668 | 中国建筑  | 1,326,000.00 | 0.05               |
| 20 | 002701 | 奥瑞金   | 1,316,885.85 | 0.05               |

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 41,748,581.49 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 58,537,238.65 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 40,889,451.60  | 5.06         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —            |
| 4  | 企业债券      | 355,436,676.10 | 44.02        |
| 5  | 企业短期融资券   | 200,555,000.00 | 24.84        |
| 6  | 中期票据      | 132,618,000.00 | 16.42        |
| 7  | 可转债(可交换债) | 399,000.00     | 0.05         |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 729,898,127.70 | 90.39        |

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 136447    | 16复星03      | 600,000 | 60,582,000.00 | 7.50         |
| 2  | 1182289   | 11电网MTN2    | 500,000 | 50,740,000.00 | 6.28         |
| 3  | 019533    | 16国债05      | 409,140 | 40,889,451.60 | 5.06         |
| 4  | 101554032 | 15鲁宏桥MTN002 | 400,000 | 40,724,000.00 | 5.04         |
| 5  | 041556029 | 15国电集CP003  | 400,000 | 40,228,000.00 | 4.98         |

#### 7.7 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

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          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 131242 | 16碧桂1A | 500,000 | 50,000,000.00 | 6.19         |

|   |        |        |         |               |      |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 2 | 131848 | 16远东3A | 300,000 | 30,000,000.00 | 3.72 |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 123,152.16    |
| 2  | 应收证券清算款 | 29,389,089.71 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 10,292,927.85 |
| 5  | 应收申购款   | 14,671.30     |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 39,819,841.02 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 3,640,000.00 | 0.45         | 停牌       |
| 2  | 600330 | 天通股份  | 1,908,000.00 | 0.24         | 停牌       |
| 3  | 002059 | 云南旅游  | 1,540,800.00 | 0.19         | 停牌       |

#### 7.12.6 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。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别 | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |       |
|----------|--------------|---------------|-------|-------|
|          |              |               | 机构投资者 | 个人投资者 |

|             |       |              | 持有<br>份额       | 占总份<br>额<br>比例 | 持有<br>份额     | 占总份<br>额<br>比例 |
|-------------|-------|--------------|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 中欧瑾泉灵活配置混合A | 852   | 4,121.95     | 0              | 0.00%          | 3,511,903.17 | 100.00%        |
| 中欧瑾泉灵活配置混合C | 586   | 1,286,622.02 | 752,408,477.84 | 99.79%         | 1,552,027.37 | 0.21%          |
| 合计          | 1,438 | 526,754.11   | 752,408,477.84 | 99.33%         | 5,063,930.54 | 0.67%          |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别        | 持有份额总数(份)  | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中欧瑾泉灵活配置混合A | 0          | 0.00%    |
|                  | 中欧瑾泉灵活配置混合C | 188,946.67 | 0.03%    |
|                  | 合计          | 188,946.67 | 0.02%    |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别        | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中欧瑾泉灵活配置混合A | 0                 |
|                                | 中欧瑾泉灵活配置混合C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中欧瑾泉灵活配置混合A | 0                 |
|                                | 中欧瑾泉灵活配置混合C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 中欧瑾泉灵活配置混合A    | 中欧瑾泉灵活配置混合C      |
|--------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年03月16日)<br>基金份额总额 | 125,258,783.14 | 3,129,270,294.04 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 3,820,317.35   | 2,535,326,422.80 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 617,288.29     | 771,476.15       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 925,702.47     | 1,782,137,393.74 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | —              | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 3,511,903.17   | 753,960,505.21   |

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金

提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |             | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|-------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 光大证券 | 1      | 5,689,876.5   | 5.78%       | 5,299.06  | 5.78%      |    |
| 广发证券 | 1      | 45,316,744.47 | 46.01%      | 42,204.19 | 46.01%     |    |
| 国都证券 | 1      | 24,786,472.02 | 25.16%      | 23,084.84 | 25.16%     |    |
| 兴业证券 | 1      | 22,709,084.01 | 23.05%      | 21,148.9  | 23.05%     |    |

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |             | 债券回购交易        |               | 权证交易 |             |
|------|---------------|-------------|---------------|---------------|------|-------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 光大证券 | —             | —           | —             | —             | —    | —           |
| 广发证券 | 6,246,169.96  | 1.33%       | 330,000,000   | 3.51%         | —    | —           |
| 国都证券 | 300,879,340.4 | 64.08%      | 3,192,000,000 | 33.92%        | —    | —           |

|      |               |        |               |        |   |   |
|------|---------------|--------|---------------|--------|---|---|
| 兴业证券 | 162,383,777.4 | 34.59% | 5,888,800,000 | 62.57% | — | — |
|------|---------------|--------|---------------|--------|---|---|

中欧基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十四日