

---

# 中欧可转债债券型证券投资基金

## 2019 年半年度报告

2019 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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.....	52
§9 开放式基金份额变动 .....	52
§10 重大事件揭示 .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	56
§11 备查文件目录 .....	58
11.1 备查文件目录 .....	58
11.2 存放地点 .....	59
11.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧可转债债券型证券投资基金	
基金简称	中欧可转债债券	
基金主代码	004993	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017年11月10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	
报告期末基金份额总额	697,527,877.54份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧可转债债券A	中欧可转债债券C
下属分级基金的交易代码	004993	004994
报告期末下属分级基金的份额总额	472,075,966.91份	225,451,910.63份

### 2.2 基金产品说明

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回报。
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	中证可转换债券指数×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴 环路333号五层

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)
---------------	------------------------------

	中欧可转债债券A	中欧可转债债券C
本期已实现收益	11,643,238.53	740,984.62
本期利润	25,160,762.02	-15,028,129.25
加权平均基金份额本期利润	0.0692	-0.0811
本期加权平均净值利润率	6.42%	-7.49%
本期基金份额净值增长率	18.11%	17.98%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	14,369,779.11	5,533,178.69
期末可供分配基金份额利润	0.0304	0.0245
期末基金资产净值	521,832,790.80	247,781,038.65
期末基金份额净值	1.1054	1.0990
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.54%	9.90%

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、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，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

中欧可转债债券A

阶段	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	3.65%	1.04%	1.48%	0.57%	2.17%	0.47%
过去三个月	-1.00%	1.02%	-2.61%	0.69%	1.61%	0.33%
过去六个月	18.11%	1.04%	11.98%	0.77%	6.13%	0.27%
过去一年	18.36%	0.87%	11.75%	0.63%	6.61%	0.24%
自基金合同生效起至今	10.54%	0.72%	4.64%	0.62%	5.90%	0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数\*70%+中债综合指数收益率\*20%+沪深300指数\*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 中欧可转债债券C

阶段	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	3.60%	1.04%	1.48%	0.57%	2.12%	0.47%
过去三个月	-1.11%	1.02%	-2.61%	0.69%	1.50%	0.33%
过去六个月	17.98%	1.04%	11.98%	0.77%	6.00%	0.27%
过去一年	17.99%	0.87%	11.75%	0.63%	6.24%	0.24%
自基金合同生效起至今	9.90%	0.72%	4.64%	0.62%	5.26%	0.10%

注：本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数\*70%+中债综合指数收益率\*20%+沪深300指数\*10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

### 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



中欧可转债债券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

(2017年11月10日-2019年06月30日)



中欧可转债债券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

(2017年11月10日-2019年06月30日)



## § 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有限公司、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以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司。截至2019年6月30日，本基金管理人共管理70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		
刘波	基金经理	2018-06-14	-	11	历任太平养老保险股份有限公司投资管理中心投资经理（2008.07-2011.02），长信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理基金经理2011.02-201612）。2016-12-23加入中欧基金管理有限公司
蒋雯文	基金经理	2018-01-30	2019-02-19	7	历任新际香港有限公司销售交易员（2009.06-2011.07），平安资产管理有限责任公司债券交易员（2013.09-2016.05），前海开源基金投资经理助理2016.09-2016.10）2016-11-17加入中欧基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理

黄华	策略组负责人、基金经理	2017-11-10	2019-01-09	10	历任平安资产管理有限责任公司组合经理(2008.08-2012.06)，中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理(2012.09-2014.07)，中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人(2014.07-2016.11) 2016-11-10加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理
----	-------------	------------	------------	----	---

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。

#### 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不公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有1次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

上半年宏观经济增长整体面临下行压力。分阶段看，一季度在以信贷和社融为代表的宽信用政策作用下，经济下行压力有所缓解。进入二季度，宽信用政策实施力度减弱，中美贸易摩擦力度再次加大，经济下行压力增大。通胀方面，上半年CPI指标逐月抬升，但整体保持在较低水平。流动性方面，上半年宽信用政策实施后，流动性整体宽裕，结构上出现了信用分层迹象。汇率方面，美元进入降息周期，各经济体汇率波动加大。市场方面，一季度权益市场涨幅明显，4月份开始权益市场出现调整，风险偏好回落；4月份债券市场出现调整，其中10年期利率债4月份收益率上行约40bp，4月下旬开始至二季度末债市出现反弹，各类债券收益率整体回落约20bp；一季度转债市场跟随权益走出较好行情，二季度出现一定幅度调整，但调整幅度明显低于权益，体现出转债资产较好的防守特点，部分正股基本面优良的转债资产调整后再次进入较好的配置区域。

报告期内，考虑到攻防兼备的转债资产在权益震荡行情中具备较好的配置吸引力，本组合继续维持了较高转债仓位，分散配置于金融、消费、公用事业及部分早周期行业中正股基本面较好，且转债估值合理的品种，以期获得稳定的投资收益，并适当参与了部分弹性品种的交易机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值增长率为18.11%，同期业绩比较基准收益率为11.98%；C类份额净值增长率为17.98%，同期业绩比较基准收益率为11.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增长仍面临小幅下行压力，经济韧性来自于需求托底政策阶段性刺激；受翘尾因素影响，通胀指标在三季度可能会小幅下行，四季度小幅上行，整体仍在温和区域；下半年美元持续降息概率加大，国内货币环境和流动性状况可能依然保持宽松；不确定性仍在于中美贸易摩擦。市场方面，当前综合环境有利于债市，中长期利率债可能存在阶段性机会，未来随着需求托底政策的实施，权益及转债市场可能存在一定机会。全年来看，充足的流动性对各自领域的优质资产形成利好，股市中基本面稳定的蓝筹核心资产、债市中高等级中短期信用债、转债中正股基本面较好的标的均获得超额收益。下一阶段仍然看好转债市场的投资机会，整体保持较高的转债配置比例，

在行业方面，金融、消费、医药、公用事业、交运等行业可能存在相对价值，部分早周期行业机会依赖于需求托底政策驱动。个券方面，坚持立足正股基本面，寻找可能存在超额收益的转债标的。

#### 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验。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

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对中欧可转债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，中欧可转债债券型证券投资基金的管理人—中欧基金管理有限公司在中欧可转债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧可转债债券型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧可转债债券型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：中欧可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	72,367,619.50	2,379,605.15
结算备付金		10,368,838.56	1,988,070.20
存出保证金		146,535.57	33,737.46
交易性金融资产	6.4.7.2	1,003,851,114.80	249,466,043.18
其中：股票投资		112,377,041.16	25,958,796.00
基金投资		-	-
债券投资		891,474,073.64	223,507,247.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		57,018,342.02	6,114,071.70

应收利息	6.4.7.5	1,763,148.40	700,542.37
应收股利		-	-
应收申购款		7,375,420.35	4,037.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,152,891,019.20	260,686,107.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		280,000,000.00	66,000,000.00
应付证券清算款		-	856,577.40
应付赎回款		101,781,998.45	112,920.99
应付管理人报酬		741,257.02	168,449.55
应付托管费		148,251.38	33,689.91
应付销售服务费		115,228.65	8,671.87
应付交易费用	6.4.7.7	238,373.94	11,309.10
应交税费		6,125.38	2,462.49
应付利息		68,636.28	-16,606.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,318.65	300,031.41
负债合计		383,277,189.75	67,477,506.02
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	697,527,877.54	206,573,402.88
未分配利润	6.4.7.10	72,085,951.91	-13,364,800.97
所有者权益合计		769,613,829.45	193,208,601.91
负债和所有者权益总计		1,152,891,019.20	260,686,107.93

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总额为697,527,877.54份，其中下属A类基金份额参考净值为人民币1.1054元，份额总额为472,075,966.91份；下属C类基金份额参考净值为人民币1.0990元，份额总额为225,451,910.63份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧可转债债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		16,322,060.10	-13,913,766.67
1. 利息收入		1,818,910.08	1,662,299.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	182,584.48	47,528.25
债券利息收入		1,636,325.60	1,271,524.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	343,246.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,779,807.57	1,139,991.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,099,778.41	-1,256,172.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,500,351.09	2,335,608.94
资产支持证券投资	6.4.7.13.	-	-
收益	3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,179,678.07	60,555.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,251,590.38	-16,741,818.79



4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	974,932.83	25,761.46
<b>减：二、费用</b>		6,189,427.33	2,300,833.38
1. 管理人报酬		2,925,487.84	1,223,757.82
2. 托管费		585,097.50	244,751.57
3. 销售服务费		396,958.48	52,474.61
4. 交易费用	6.4.7.18	525,575.74	66,929.76
5. 利息支出		1,646,226.56	608,144.36
其中：卖出回购金融资产支出		1,646,226.56	608,144.36
6. 税金及附加		2,694.03	3,568.04
7. 其他费用	6.4.7.19	107,387.18	101,207.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,132,632.77	-16,214,600.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,132,632.77	-16,214,600.05

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧可转债债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019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）	206,573,402.88	-13,364,800.97	193,208,601.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,132,632.77	10,132,632.77

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)	490,954,474.66	75,318,120.11	566,272,594.77
其中: 1. 基金申购款	1,629,145,359.86	168,063,731.39	1,797,209,091.25
2. 基金赎回款	-1,138,190,885.20	-92,745,611.28	-1,230,936,496.48
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)	697,527,877.54	72,085,951.91	769,613,829.45
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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)	277,097,272.16	571,036.63	277,668,308.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,214,600.05	-16,214,600.05
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)	-45,407,647.97	262,451.83	-45,145,196.14
其中: 1. 基金申购款	2,345,090.90	-9,368.79	2,335,722.11
2. 基金赎回款	-47,752,738.87	271,820.62	-47,480,918.25
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)	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	231,689,624.19	-15,381,111.59	216,308,512.60

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

中欧可转债债券型证券投资基金（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[2017]1201号文《关于准予中欧尊享定增灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（准予中欧尊享定增灵活配置混合型证券投资基金变更注册为中欧可转债债券型证券投资基金）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《中欧可转债债券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302,496,988.81元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2017）验字第61336106\_B06号予以验证。经向中国证监会备案，《中欧可转债债券型证券投资基金基金合同》于2017年11月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为302,624,212.71份基金份额，其中包含认购资金利息折合127,223.90份基金份额。其中A类基金的基金份额总额为272,676,174.34份，包含认购利息折合123,338.58份；C类基金的基金份额总额为29,948,038.37份，包含认购利息折合3,885.32份。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧可转债债券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）、国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、同业存单、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、现金、权证、国债期货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）。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）的比例合计不低于非

现金基金资产的80%；股票、权证的投资比例不超过基金资产的20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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：中证可转换债券指数×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
----	--------------------

活期存款	72,367,619.50
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	72,367,619.50

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	109,313,154.78	112,377,041.16	3,063,886.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	896,304,952.33	881,478,073.64	-14,826,878.69
	银行间市场	9,995,360.00	9,996,000.00	640.00
	合计	906,300,312.33	891,474,073.64	-14,826,238.69
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,015,613,467.11	1,003,851,114.80	-11,762,352.31	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	6,104.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,665.90
应收债券利息	1,751,111.94
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,199.94
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	65.90
合计	1,763,148.40

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	238,373.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	238,373.94

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----



	2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,824.07
预提费用-审计费	29,752.78
预提费用-信息披露费	138,214.16
应付转出补差费	527.64
合计	177,318.65

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧可转债债券A)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	179,619,869.67	179,619,869.67
本期申购	893,387,529.52	893,387,529.52
本期赎回(以“-”号填列)	-600,931,432.28	-600,931,432.28
本期末	472,075,966.91	472,075,966.91

金额单位：人民币元

项目 (中欧可转债债券C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	26,953,533.21	26,953,533.21
本期申购	735,757,830.34	735,757,830.34
本期赎回(以“-”号填列)	-537,259,452.92	-537,259,452.92
本期末	225,451,910.63	225,451,910.63

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中欧可转债债券A

单位：人民币元

项目 (中欧可转债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-4,585,397.00	-6,933,793.98	-11,519,190.98
本期利润	11,643,238.53	13,517,523.49	25,160,762.02
本期基金份额交易产生的变动数	7,311,937.58	28,803,315.27	36,115,252.85
其中：基金申购款	21,127,446.45	69,047,378.72	90,174,825.17
基金赎回款	-13,815,508.87	-40,244,063.45	-54,059,572.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,369,779.11	35,387,044.78	49,756,823.89

#### 6.4.7.10.2 中欧可转债债券C

单位：人民币元

项目 (中欧可转债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-807,179.69	-1,038,430.30	-1,845,609.99
本期利润	740,984.62	-15,769,113.87	-15,028,129.25
本期基金份额交易产生的变动数	5,599,373.76	33,603,493.50	39,202,867.26
其中：基金申购款	19,153,106.60	58,735,799.62	77,888,906.22
基金赎回款	-13,553,732.84	-25,132,306.12	-38,686,038.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,533,178.69	16,795,949.33	22,329,128.02

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	105,304.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	40,384.23
其他	36,895.76
合计	182,584.48

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	135,451,607.59
减：卖出股票成本总额	133,351,829.18
买卖股票差价收入	2,099,778.41

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,500,351.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,500,351.09

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	876,565,170.82
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	861,016,169.25
减：应收利息总额	3,048,650.48
买卖债券差价收入	12,500,351.09

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,179,678.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,179,678.07

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,251,590.38
——股票投资	9,139,032.29
——债券投资	-11,390,622.67
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,251,590.38

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	909,308.56
转换费收入	65,624.27
合计	974,932.83

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	525,400.74
银行间市场交易费用	175.00
合计	525,575.74

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	58,214.16
汇划手续费	820.24
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	107,387.18

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司	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

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	210,843,798.63	60.92%	23,571,164.02	51.43%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买	成交金额	占当期 债券买

		卖成交 总额的 比例		卖成交 总额的 比例
国都证券	1,464,723,389.40	61.38%	277,518,587.06	70.66%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	4,458,700,000.00	74.64%	1,590,900,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019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	占期 末应 付佣 金总 额的 比例
国都证券	196,356.07	60.9	154,944.31	65.0

		2%		0%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	21,952.61	51.44%	2,231.11	21.32%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,925,487.84	1,223,757.82
其中：支付销售机构的客户维护费	484,340.80	760,085.19

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费



E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初2个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	585,097.50	244,751.57

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初2个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧可转债债券A	中欧可转债债券C	合计
工商银行	0.00	10,516.78	10,516.78
国都证券	0.00	1.12	1.12
中欧基金	0.00	247,553.02	247,553.02
合计	0.00	258,070.92	258,070.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧可转债债券A	中欧可转债债券C	合计

工商银行	0.00	11,472.48	11,472.48
国都证券	0.00	30.84	30.84
中欧基金	0.00	39,143.78	39,143.78
合计	0.00	50,647.10	50,647.10

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费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计

算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期期末及上年度可比期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

##### 6.4.10.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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

中国工商银行股份有限公司	72,367,619.50	105,304.49	5,515,225.45	30,869.50
--------------	---------------	------------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上半年度末均未持有中国工商银行发行的同业存单。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06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金融资产款余额为人民币280,000,000.00元，分别于2019年7月1日、2019年7月2日、2019年7月3日、2019年7月4日、2019年7月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，属证券投资基金中的中低风险收益品种，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超额收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	-	-

未评级	41,970,400.00	0.00
合计	41,970,400.00	0.00

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以内未有三方评级的国债、政策性金融债。3. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	486,832,294.05	96,805,391.64
AAA以下	362,671,379.59	115,653,455.54
未评级	0.00	11,048,400.00
合计	849,503,673.64	223,507,247.18

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。在开放期，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2019年06月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金流动性情况良好，持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种，均能及时以合理的价格及时变现以满足流动性的需求。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。综合来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	72,367,619.50	-	-	-	72,367,619.50
结算备付金	10,368,838.56	-	-	-	10,368,838.56
存出保证金	146,535.57	-	-	-	146,535.57
交易性金融资产	102,947,372.80	344,918,623.23	443,608,077.61	112,377,041.16	1,003,851,114.80
应收证券清算款	-	-	-	57,018,342.02	57,018,342.02
应收利息	-	-	-	1,763,148.40	1,763,148.40
应收申购款	5,000,000.00	-	-	2,375,420.35	7,375,420.35
资产总计	190,830,366.43	344,918,623.23	443,608,077.61	173,533,951.93	1,152,891,019.20
负债					
卖出回购金融资产款	280,000,000.00	-	-	-	280,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	101,781,998.45	101,781,998.45
应付管理人报酬	-	-	-	741,257.02	741,257.02
应付托管费	-	-	-	148,251.38	148,251.38
应付销售服务费	-	-	-	115,228.65	115,228.65

应付交易费用	-	-	-	238,373.94	238,373.94
应交税费	-	-	-	6,125.38	6,125.38
应付利息	-	-	-	68,636.28	68,636.28
其他负债	-	-	-	177,318.65	177,318.65
负债总计	280,000,000.00	-	-	103,277,189.75	383,277,189.75
利率敏感度缺口	-89,169,633.57	344,918,623.23	443,608,077.61	70,256,762.18	769,613,829.45
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,379,605.15	-	-	-	2,379,605.15
结算备付金	1,988,070.20	-	-	-	1,988,070.20
存出保证金	33,737.46	-	-	-	33,737.46
交易性金融资产	11,048,400.00	154,393,023.98	58,065,823.20	25,958,796.00	249,466,043.18
应收证券清算款	-	-	-	6,114,071.70	6,114,071.70
应收利息	-	-	-	700,542.37	700,542.37
应收申购款	-	-	-	4,037.87	4,037.87
资产总计	15,449,812.81	154,393,023.98	58,065,823.20	32,777,447.94	260,686,107.93
负债					
卖出回购金融资产款	66,000,000.00	-	-	-	66,000,000.00



应付证 券清算 款	-	-	-	856,577.40	856,577.40
应付赎 回款	-	-	-	112,920.99	112,920.99
应付管 理人报 酬	-	-	-	168,449.55	168,449.55
应付托 管费	-	-	-	33,689.91	33,689.91
应付销 售服务 费	-	-	-	8,671.87	8,671.87
应付交 易费用	-	-	-	11,309.10	11,309.10
应交税 费	-	-	-	2,462.49	2,462.49
应付利 息	-	-	-	-16,606.70	-16,606.70
其他负 债	-	-	-	300,031.41	300,031.41
负债总 计	66,000,000.00	-	-	1,477,506.02	67,477,506.02
利率敏 感度缺 口	-50,550,187.19	154,393,023.98	58,065,823.20	31,299,941.92	193,208,601.91

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	利率下降25BP		108,361.69
利率上升25BP		-6,980.25	-1,841,828.11

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例( %)	公允价值	占基金 资产净 值比例( %)
交易性金融资产—股票投资	112,377,041.16	14.60	25,958,796.00	13.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	112,377,041.16	14.60	25,958,796.00	13.44
----	----------------	-------	---------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2019年06月30日,本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为14.60%(2018年12月31日:13.44%),因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日:同)。

#### 6.4.14 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

##### 1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产以及其他金融负债,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

##### 1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019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人民币961,880,714.80元,属于第二层次的余额为人民币41,970,400.00元,无划分为第三层次的余额(2018年12月31日:属于第一层次的余额为人民币237,617,143.18元,属于第二层次的余额为人民币11,848,900.00元,无划分为第三层次的余额)。

##### 1.2.2 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和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和可转换债券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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 2. 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 3. 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

##### 4. 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月23日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	112,377,041.16	9.75
	其中：股票	112,377,041.16	9.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	891,474,073.64	77.33
	其中：债券	891,474,073.64	77.33
	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	82,736,458.06	7.18
8	其他各项资产	66,303,446.34	5.75
9	合计	1,152,891,019.20	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

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	71,513,851.16	9.29
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	5,051,200.00	0.66

G	交通运输、仓储和邮政业	6,916,000.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	25,638,990.00	3.33
K	房地产业	3,257,000.00	0.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	112,377,041.16	14.60

### 7.2.2 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港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	132,000	7,260,000.00	0.94
2	600004	白云机场	380,000	6,916,000.00	0.90
3	600519	贵州茅台	7,000	6,888,000.00	0.89
4	000333	美的集团	130,000	6,741,800.00	0.88
5	601318	中国平安	75,000	6,645,750.00	0.86
6	600276	恒瑞医药	100,000	6,600,000.00	0.86

7	600887	伊利股份	196,000	6,548,360.00	0.85
8	601688	华泰证券	292,000	6,517,440.00	0.85
9	002035	华帝股份	460,000	5,602,800.00	0.73
10	600030	中信证券	230,000	5,476,300.00	0.71
11	002024	苏宁易购	440,000	5,051,200.00	0.66
12	600660	福耀玻璃	220,000	5,000,600.00	0.65
13	000895	双汇发展	199,933	4,976,332.37	0.65
14	000858	五粮液	40,000	4,718,000.00	0.61
15	000786	北新建材	250,083	4,534,004.79	0.59
16	002078	太阳纸业	640,000	4,358,400.00	0.57
17	600104	上汽集团	167,950	4,282,725.00	0.56
18	601628	中国人寿	150,000	4,248,000.00	0.55
19	600340	华夏幸福	100,000	3,257,000.00	0.42
20	600196	复星医药	117,930	2,983,629.00	0.39
21	601336	新华保险	50,000	2,751,500.00	0.36
22	002916	深南电路	10,000	1,019,200.00	0.13

## 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 (%)
1	600004	白云机场	14,490,895.10	7.50
2	600276	恒瑞医药	13,092,837.22	6.78
3	000858	五粮液	10,331,254.02	5.35
4	601318	中国平安	9,760,714.42	5.05
5	002035	华帝股份	9,529,906.86	4.93
6	000786	北新建材	8,941,240.52	4.63
7	600519	贵州茅台	8,567,166.78	4.43
8	601688	华泰证券	8,226,388.40	4.26
9	600030	中信证券	7,976,385.00	4.13

10	000651	格力电器	6,951,036.96	3.60
11	002916	深南电路	6,571,141.73	3.40
12	600887	伊利股份	6,058,423.99	3.14
13	603288	海天味业	6,009,053.61	3.11
14	000333	美的集团	5,927,078.00	3.07
15	600660	福耀玻璃	5,634,733.98	2.92
16	002024	苏宁易购	5,397,977.00	2.79
17	601628	中国人寿	5,164,720.00	2.67
18	600340	华夏幸福	5,089,639.48	2.63
19	300188	美亚柏科	4,994,358.40	2.58
20	002078	太阳纸业	4,858,230.78	2.51
21	600867	通化东宝	4,693,430.57	2.43
22	000895	双汇发展	4,651,285.60	2.41
23	002456	欧菲光	4,400,338.00	2.28
24	600104	上汽集团	4,139,807.50	2.14
25	601336	新华保险	4,067,971.00	2.11
26	603589	口子窖	4,036,075.00	2.09
27	600196	复星医药	4,024,539.70	2.08
28	000063	中兴通讯	3,879,330.00	2.01

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600004	白云机场	10,423,423.45	5.39
2	600276	恒瑞医药	8,164,934.74	4.23
3	000858	五粮液	7,885,716.22	4.08
4	601318	中国平安	6,763,611.00	3.50
5	603288	海天味业	6,257,367.50	3.24
6	603589	口子窖	6,040,874.00	3.13

7	002916	深南电路	6,018,256.00	3.11
8	000786	北新建材	5,419,553.46	2.81
9	000063	中兴通讯	5,367,874.31	2.78
10	600867	通化东宝	5,262,766.62	2.72
11	300188	美亚柏科	4,793,873.00	2.48
12	600519	贵州茅台	4,391,380.00	2.27
13	600030	中信证券	4,155,100.00	2.15
14	601688	华泰证券	4,071,206.92	2.11
15	002035	华帝股份	3,625,005.28	1.88
16	600588	用友网络	3,321,848.29	1.72
17	600315	上海家化	3,207,641.80	1.66
18	601336	新华保险	2,903,538.40	1.50
19	002456	欧菲光	2,827,441.00	1.46
20	600055	万东医疗	2,677,740.00	1.39

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	210,631,042.05
卖出股票收入（成交）总额	135,451,607.59

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	31,974,400.00	4.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,996,000.00	1.30
	其中：政策性金融债	9,996,000.00	1.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-



6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	849,503,673.64	110.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	891,474,073.64	115.83

### 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	127010	平银转债	1,284,955	153,050,990.05	19.89
2	113011	光大转债	1,200,720	130,158,048.00	16.91
3	110048	福能转债	592,020	65,939,187.60	8.57
4	110049	海尔转债	506,790	60,976,972.80	7.92
5	113008	电气转债	485,450	54,914,104.00	7.14

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 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

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的光大转债的发行主体中国光大银行股份有限公司于2018年11月9日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监银罚决字〔2018〕10号），主要违法事实包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。共罚款1120万元。本基金投资的平银转债的发行主体平安银行于2018年7月17日发布的《关于平安银行股份有限公司公开发行可转债申请文件反馈意见的回复》称，因涉嫌违反法律法规，平安银行及其分支机构受到中国银保监会及其派出机构（包括原中国银监会及其派出机构、原中国保监会及其派出机构）的处罚。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视为，认为上述处罚不会对光大转债（113011.SH）和平银转债（127010.SZ）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。其余前十大持有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	146,535.57
2	应收证券清算款	57,018,342.02
3	应收股利	-
4	应收利息	1,763,148.40
5	应收申购款	7,375,420.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,303,446.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113011	光大转债	130,158,048.00	16.91
2	110048	福能转债	65,939,187.60	8.57
3	110049	海尔转债	60,976,972.80	7.92
4	113008	电气转债	54,914,104.00	7.14
5	110046	圆通转债	45,030,543.00	5.85
6	127006	敖东转债	43,339,555.04	5.63
7	128029	太阳转债	35,044,902.23	4.55
8	128048	张行转债	30,153,483.40	3.92
9	128027	崇达转债	28,935,297.93	3.76

10	128046	利尔转债	27,541,464.44	3.58
11	127007	湖广转债	17,950,335.63	2.33
12	128016	雨虹转债	12,255,723.00	1.59
13	110040	生益转债	10,066,380.10	1.31
14	113515	高能转债	7,001,663.40	0.91
15	128047	光电转债	5,201,281.32	0.68
16	128024	宁行转债	4,017,000.00	0.52
17	110042	航电转债	3,341,461.60	0.43
18	110050	佳都转债	2,959,018.80	0.38
19	113015	隆基转债	2,499,871.80	0.32
20	110041	蒙电转债	1,676,250.00	0.22
21	113019	玲珑转债	719,693.90	0.09

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
中欧 可转 债债 券A	6,473	72,930.01	375,682,159.53	79.58%	96,393,807.38	20.42%

中欧可转债债券C	14,610	15,431.34	149,066,016.95	66.12%	76,385,893.68	33.88%
合计	21,083	33,084.85	524,748,176.48	75.23%	172,779,701.06	24.77%

### 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	中欧可转债债券A	113,154.43	0.02%
	中欧可转债债券C	-	0.00%
	合计	113,154.43	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	中欧可转债债券A	0~10
	中欧可转债债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧可转债债券A	0
	中欧可转债债券C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧可转债债券A	中欧可转债债券C
基金合同生效日(2017年11月10日) 基金份额总额	272,676,174.34	29,948,038.37
本报告期期初基金份额总额	179,619,869.67	26,953,533.21

本报告期基金总申购份额	893,387,529.52	735,757,830.34
减：本报告期基金总赎回份额	600,931,432.28	537,259,452.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	472,075,966.91	225,451,910.63

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未发生重大的人事变动。

#### 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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	注
安信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	135,238,851.01	39.08%	125,949.45	39.08%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	210,843,798.63	60.92%	196,356.07	60.92%	-

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。

2. 本报告期内，本基金新增财通证券上海交易单元，减少中信证券上海交易单元。

#### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例



				比例				
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	921,739,458.54	38.62%	1,515,270,000.00	25.36%	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	1,464,723,389.40	61.38%	4,458,700,000.00	74.64%	-	-	-	-

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。  
2. 本报告期内，本基金新增财通证券上海交易单元，减少中信证券上海交易单元。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2018年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证监会指定媒介	2019-01-01
2	中欧可转债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2019-01-10
3	中欧基金管理有限公司中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2019-01-18
4	中欧基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证监会指定媒介	2019-01-18
5	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2019-01-22
6	中欧可转债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2019-02-20
7	中欧基金管理有限公司关于新增微众银行为中欧可转债债券型证券投资基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-01
8	中欧基金管理有限公司关于新增腾安基金为中欧可转债债券型证券投资基金代销机构同步开通转换、定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-04
9	中欧基金管理有限公司关于新增基煜基金为部分基金代	中国证监会指定媒介	2019-03-13

	销机构同步开通转换业务并享受费率优惠的公告		
10	中欧基金管理有限公司关于新增中信建投为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-13
11	中欧基金管理有限公司关于新增安信证券为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-25
12	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-28
13	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报	中国证监会指定媒介	2019-03-28
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的电子银行及AI投申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-04-01
15	中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为中欧可转债债券型证券投资基金代销机构同步开通转换、定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-04-03
16	中欧基金管理有限公司旗下基金2019年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2019-04-18
17	中欧可转债债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号）	中国证监会指定媒介	2019-06-22
18	中欧可转债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要2019年第1号）	中国证监会指定媒介	2019-06-22
19	中欧基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板股票投	中国证监会指定媒介	2019-06-22

	资及相关风险揭示的公告		
20	中欧基金管理有限公司关于新增广发证券为中欧可转债债券型证券投资基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-25

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中欧可转债债券型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧可转债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧可转债债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧可转债债券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

### 11.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

### 11.3 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  
二〇一九年八月二十六日