

中欧短债债券型证券投资基金
(原中欧强泽债券型证券投资基金转型)

2018年第4季度报告

2018年12月31日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2019年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

自2018年10月25日起，中欧强泽债券型证券投资基金正式变更为中欧短债债券型证券投资基金，原中欧强泽债券型证券投资基金报告期自2018年10月1日起至2018年10月24日止，中欧短债债券型证券投资基金报告期自2018年10月25日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

转型后

基金简称	中欧短债债券
基金主代码	002920
基金运作方式	契约型、开放式
基金转型合同生效日	2018年10月25日
报告期末基金份额总额	4,174,543,109.67份
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	本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，“自上而下”在各类债券资产类别之间进行类属配置，“自下而上”进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利

	差策略等增强组合收益。	
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中欧短债债券A	中欧短债债券C
下属分级基金的交易代码	002920	006562
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 853, 433, 729. 79份	2, 321, 109, 379. 88份

注：本基金于2018年10月8日至2018年10月22日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2018年10月23日表决通过了《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。修订和更新后的基金法律文件将自基金份额持有人大会决议生效并公告的下一工作日起即2018年10月25日生效。自2018年10月25日起，中欧强泽债券型证券投资基金正式变更为中欧短债债券型证券投资基金。

转型前

基金简称	中欧强泽债券
基金主代码	002920
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年02月24日
报告期末基金份额总额	232, 984, 347. 70份
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	本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，“自上而下”在各类债券资产类别之间进行类属配置，“自下而上”进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程

	中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。当市场收益率上行时，基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值，以回避一定的市场风险。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月25日(基金转型合同生效日) - 2018年12月31日)	
	中欧短债债券A	中欧短债债券C
1. 本期已实现收益	7,832,652.39	6,285,747.52
2. 本期利润	7,162,300.79	6,445,506.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0065	0.0054
4. 期末基金资产净值	1,922,246,897.64	2,405,525,522.80
5. 期末基金份额净值	1.0371	1.0364

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年10月24日)
1. 本期已实现收益	1,373,248.49
2. 本期利润	1,399,839.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0044

4. 期末基金资产净值	252,264,809.34
5. 期末基金份额净值	1.0830

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧短债债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.10.25- 2018.12.31	0.69%	0.02%	0.68%	0.01%	0.01%	0.01%

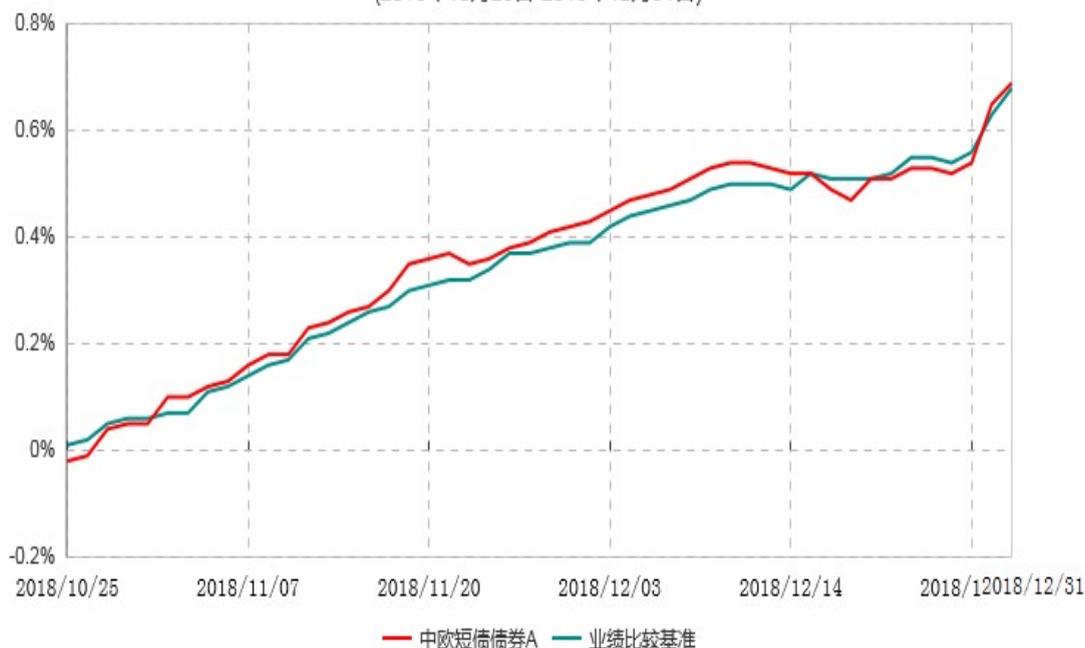
中欧短债债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.10.26- 2018.12.31	0.64%	0.02%	0.67%	0.02%	-0.03%	0.00%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧短债债券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

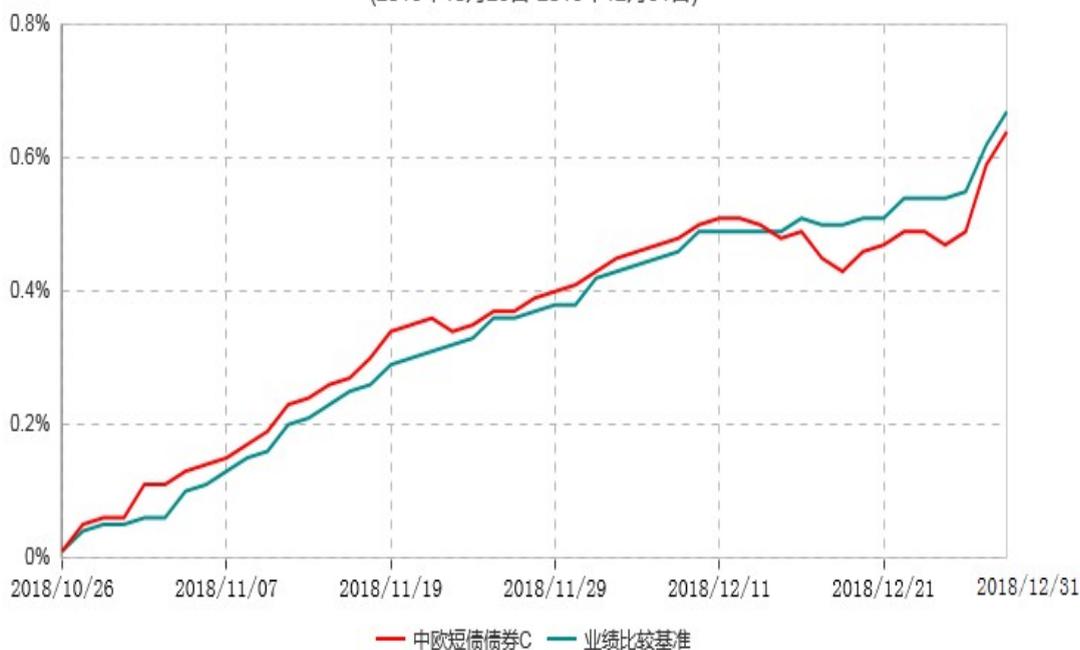
(2018年10月25日-2018年12月31日)



注：自2018年10月25日起，原中欧强泽债券型证券投资基金名称变更为中欧短债债券型证券投资基金。2018年10月24日为基金份额转换基准日，转换后基金合同已于转换基准日的次一工作日（2018年10月25日）生效。截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。图示为2018年10月25日至2018年12月31日数据。

中欧短债债券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

(2018年10月25日-2018年12月31日)



注：自2018年10月25日起，原中欧强泽债券型证券投资基金名称变更为中欧短债债券型证券投资基金。2018年10月24日为基金份额转换基准日，转换后基金合同已于转换基准日的次一工作日（2018年10月25日）生效。截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。图示为2018年10月26日至2018年12月31日数据。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.10.01-2018.10.24	0.46%	0.05%	0.45%	0.04%	0.01%	0.01%

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

中欧强泽债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业	说明
		自	至		

		日期	日期	业 年 限	
王慧 杰	基金经理	2018- 08-13	-	7	历任彭博咨询社（纽约）利率衍生品研发员（2009.06-2011.08），光大保德信基金管理有限公司研究员、基金经理（2011.08-2017.04）。2017-04-17加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理
蒋雯 文	基金经理	2018- 01-30	-	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- 10-10	-	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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年四季度，全球政治经济环境、我国的经济基本面和宏观政策可以总结为以下几个方面：第一，全球经济增长延续了小幅度放缓的态势。从OECD经济领先指标和全球制造业PMI等领先指标来看，全球制造业边际上出现了走弱的迹象。一个重大的变化是美联储主席的表态释放了鸽派信号，美联储加息的预期次数降低，货币政策紧缩进程预期放缓。

第二，国内经济基本面发生了一些边际变化。首先是地产在三季度末四季度初出现了拐点。地产投资增速出现了下滑，销售出现了放缓迹象，百城未成交土地数量上升，成交土地溢价率下降都预示了行业景气度的下降。其次是基建投资，在三季度基金投资出现了单月的同比负增长，四季度单月增速明显改善，政策稳增长的效果开始显现。再次是出口，11月出口增速出现了断崖式下跌。前三季度出口增速屡次超出投资者的预期。出口增速的下滑持续性还有待观察，但全球经济增长放缓和中美贸易摩擦的缓和，基本确定了出口增速下滑的方向。其他方面，四季度制造业投资依然强劲增长，消费如期回落，工业生产放缓。由于支撑着经济增长的地产和出口出现了明显放缓，对于经济增长的预期更为悲观。

第三，通胀预期四季度也出现了明显变化。前三季度因为多重原因，对通货膨胀甚至滞涨出现了几次担忧。四季度由于国际油价的明显下挫，叠加经济增长放缓，对通胀的担忧明显缓解。

第四，货币政策基调延续，银行间流动性保持充裕。央行10月再次降准，MLF到期等额续作。但由于MPA考核等因素的影响，跨年资金仍然出现阶段冲高的现象。

债券市场运行方面，2018年四季度的债券市场值得关注的地方有以下几方面：第一，四季度股债跷跷板效应明显，股市下跌成为债券收益率下行的催化剂。第二，美联储鸽派表态，美债收益率下行，打开了我国利率债收益率下行的空间。第三，从机构投资者行为来看，四季度出现了银行的配置力量，并带动了收益率的下行。第四，受民企座谈会和央行、银保监会长期以来对小微民企融资的政策支持的影响，民企规避情绪出现了部分缓解。但信用利差仍然出现了分化。我们观察到15年下半年以来和之前相比，信用利差整体压缩了一个台阶，可能和债券市场的发展，理财委外的扩容等相关。18年以来，我们观察到AA+和AAA之间的利差处于在低位，而AA和AA+的利差仍然在走扩。我们认为信用利差的结构变化仍将持续。

在上述场环境下，债券基金以风险管理为首位，严控信用风险，主动规避有瑕疵的个券，稳健操作，防范估值风险和或有的违约风险。组合持仓集中在高等级。由于资金面平稳，并且资金利率处于偏低水平，组合维持中等偏高杠杆，低久期，主要采用票息策略和杠杆策略以提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内（2018年10月1日至2018年10月24日），基金份额净值增长率为0.46%，同期业绩比较基准增长率为0.45%；本报告期内（2018年10月25日至2018年12月21日），A类份额净值增长率为0.69%，同期业绩比较基准增长率为0.68%；C类份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准率为0.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,235,955,652.00	96.72
	其中：债券	5,235,955,652.00	96.72
	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	51,000,196.50	0.94
	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	14,697,447.73	0.27
8	其他资产	111,751,332.77	2.06
9	合计	5,413,404,629.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	256,541,400.00	5.93
	其中：政策性金融债	256,541,400.00	5.93
4	企业债券	273,325,252.00	6.32
5	企业短期融资券	3,127,167,000.00	72.26
6	中期票据	1,452,149,000.00	33.55
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	126,773,000.00	2.93
9	其他	-	-
10	合计	5,235,955,652.00	120.99

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比
----	-----	------	-------	---------	----------

	码)		例(%)
1	011802 358	18首钢SCP 012	1,800,00 0	180,090,000.00	4.16
2	180209	18国开09	1,600,00 0	160,512,000.00	3.71
3	011802 393	18宁河西S CP003	1,400,00 0	140,112,000.00	3.24
4	041800 258	18南京高 科CP001	1,100,00 0	111,177,000.00	2.57
5	011802 548	18首钢SCP 014	1,000,00 0	100,100,000.00	2.31

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的18兴业银行CD496的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年4月19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〕1号），主要违法事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。共罚款5870万元。

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18兴业银行CD496(总价)(111810496. IB)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。其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,861.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,729,006.38
5	应收申购款	42,994,464.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	111,751,332.77

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	317,876,070.20	76.29
	其中：债券	317,876,070.20	76.29
	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	87,692,759.00	21.04
8	其他资产	11,125,653.85	2.67
9	合计	416,694,483.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,065,800.00	5.58
	其中：政策性金融债	14,065,800.00	5.58
4	企业债券	125,848,770.20	49.89
5	企业短期融资券	35,226,500.00	13.96
6	中期票据	142,735,000.00	56.58
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	317,876,070.20	126.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101460041	14济西城投MTN001	200,000	20,498,000.00	8.13
2	122295	13川投01	200,000	20,242,000.00	8.02
3	101654107	16津城建MTN006	200,000	20,140,000.00	7.98
4	1280161	12首开债	900,000	18,315,000.00	7.26
5	1280289	12锡建发债	700,000	14,343,000.00	5.69

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

5.10.2 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投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,976.71
2	应收证券清算款	4,101,673.70
3	应收股利	-
4	应收利息	7,015,003.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	11,125,653.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧短债债券A	中欧短债债券C
基金转型合同生效日(2018年10月25日)的基金份额总额	232,984,347.70	0.00
基金转型合同生效日起至报告期末基金总申购份额	1,855,301,813.42	2,557,449,216.43
减：基金转型合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	234,852,431.33	236,339,836.55
基金转型合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期末基金份额总额	1,853,433,729.79	2,321,109,379.88

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	中欧短债债券A	中欧短债债券C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-	0.00
基金合同生效日起至报告期末买	-	138,529.74

入/申购总份额		
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	138,529.74
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	0.01

注：买入/申购总份额包含红利再投份额、转换入份额，卖出/赎回总份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申赎	2018-10-26	138,529.74	150,000.00	0.00
合计			138,529.74	150,000.00	

注：本基金管理人运用固有资金申赎本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年10月24日至2018年10月30日	48,731,968.81	2,506,593.90	0.00	51,238,562.71	1.23%
	2	2018年10月24日至2018年10月25日	46,597,390.49	0.00	0.00	46,597,390.49	1.12%
	3	2018年10月1日至2018年10月23日	84,111,214.95	0.00	84,111,214.95	0.00	0.00%
产品特有风险							

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中欧强泽债券型证券投资基金、中欧短债债券型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》、《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧强泽债券型证券投资基金托管协议》、《中欧短债债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧强泽债券型证券投资基金招募说明书》、《中欧短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

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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

2019年01月22日