

中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

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

二〇一七年一月

重要提示

本基金经 2011 年 4 月 13 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧鼎利分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]550 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2011 年 6 月 16 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》和《中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日 2016 年 12 月 15 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目 录

一、基金管理人	5
二、基金托管人	9
三、相关服务机构	13
四、基金的名称	34
五、基金的类型	34
六、基金的投资目标	34
七、基金的投资方向	34
八、基金的投资策略	35
九、基金的业绩比较基准	39
十、基金的风险收益特征	39
十一、基金的投资组合报告	39
十二、基金的业绩	45
十三、基金的费用与税收	47
十四、对招募说明书更新部分的说明	49

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层
3. 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层、上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层
4. 法定代表人：窦玉明
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2006 年 7 月 19 日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：袁维
13. 客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.88 亿元人民币
15. 股权结构：
意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；
国都证券股份有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
北京百骏投资有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%。
上述 5 个股东共出资 18,800 万元人民币。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

窦玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco D' Este 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credito Italiano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都证券股份有限公司投资银行总部业务董事、投资银行业务内核小组副组长，兼任国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

2. 基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士，中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士，13 年以上证券及基金从业经验。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，中欧基金管理有限公司客户服务总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士，17 年以上证券及基金从业经验。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3. 公司高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，11年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，15年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，9年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

4. 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

尹诚庸先生，中欧鼎利分级债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。美国莱斯大学统计学专业硕士，5年以上证券及基金从业经验。历任招商证券股份有限公司固定收益总部研究员、投资经理。2014年12月加入中欧基金管理有限公司，曾任基金经理助理兼研究员、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理（2015年5月25日起至2016年6月17日），现任中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理（2015年3月23日起至今）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理（2015年5月25日起至今）、中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金经理（2015年12月31日起至今）、中欧强惠债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月8日起至今）、中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月1日起至今）。

(2) 历任基金经理

聂曙光先生，于2011年6月16日至2014年5月7日期间担任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

袁争光先生，于2014年5月7日至2015年5月25日期间担任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

吴启权先生，于2015年5月25日至2016年6月17日期间担任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

5. 公司投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲径、赵国英、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：010-89936330

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务（有效期至 2017 年 09 月 08 日）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于 1987 年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于 2005 年 8 月，正式更名“中信银行”。

2006 年 12 月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007 年 4 月 27 日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009 年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过近三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009 年，中信银行通过了美国 SAS70 内部控制审计并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、主要人员情况

孙德顺先生，中信银行行长。1958 年出生，东北财经大学经济学硕士。1981 年 4 月至 1984 年 5 月，就职于中国人民银行。1984 年 5 月至 2005 年 11 月，任职中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、总行数据中心（北京）等单位。1995 年 12 月至 2005 年 11 月，任中国工商银行北京分行行长助理、副行长。1999 年 1 月至 2004 年 4 月，兼任中国工商银行总行数据中心（北京）总经理。2005 年 12 月至 2009 年 12 月，任交通银行北京分行行长。2010 年 1 月至 2011 年 10 月，任交通银行北京管理部副总裁，兼任北京分行行长。2011 年 10 月至 2014 年 5 月，任中信银行副行长。2014 年 5 月至 2016 年 6 月，任中信银行常务副行长。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。1962 年 12 月生，2011 年 4 月起担任中国建设银行江苏省分行行长，党委书记；2006 年 7 月至 2011 年 3 月担任中国建设银行河北省分行行长，党委书记；1982 年 8 月至 2006 年 7 月在中国建设银行河南省分行工作，历任计划财务处科员，副处长，信阳地区中心支行副行长，党组成员，计划处处长，中介处处长，郑州市铁路专业支行行长，党组书记，郑州分行行长，党委书记，金水支行行长，党

委书记，河南省分行副行长，党委副书记。

刘泽云先生，现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理，经济学博士。1996年8月进入本行工作，历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。

3、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2016年三季度末，中信银行已托管103公开募集证券投资基金，以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到5.92万亿元人民币。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

(二) 场外发售机构

1. 直销机构：

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：窦玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

2. 代销机构（排名不分先后）

1) 名称：招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站：www.cmbchina.com

2) 名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66215533

传真：010-66218888

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

3) 名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

4) 名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：杨娟

电话：010-68858076

传真：010-68858057

客服热线：95580

网址：www.psb.com

5) 名称：兴业银行股份有限公司

住所：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021-52629999-218966

客服热线：95561

网址：www.cib.com.cn

6) 名称：中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：穆婷

电话：010-57092845

传真：010-57092611

客服热线：95568

网站：www.cmbc.com.cn

7) 名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

联系人：王媛

电话：010-65556689

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

8) 名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：潘逸

电话：020-38322888

传真：020-87310779

客服热线：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

9) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

传真：0755-82080387

客服热线：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

10) 名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：010-85238670

传真：010-85238680

客服热线：95577

网址：www.hxb.com.cn

11) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：刘信义

联系人：唐苑

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客服热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

12) 名称：国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

13) 名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

14) 名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

15) 名称：广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87550265

传真：020-87553600

网址：www.gf.com.cn

16) 名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

17) 名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：福建省福州市湖东路 268 号;上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20-22 层

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：0591-38507869

传真：0591-38507538

客服热线：95562c

网址：www.xyzq.com.cn

18) 名称：光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

19) 名称：华福证券有限责任公司

住所：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层
办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-96326
传真：010-88085195、010-88085265-8191
客服热线：0591-96326
网址：www.hfzq.com.cn

20) 名称：中国银河证券股份有限公司
住所：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层
办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2 至 6 层
法定代表人：陈有安
联系人：邓颜
电话：010-66568062
传真：010-66568704、010-66568532、010-66568640
客服热线：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

21) 名称：中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市经七路 86 号
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 66 号
法定代表人：李玮
联系人：马晓男
电话：021-20315255
传真：021-20315137
客服热线：95538
网址：http://www.zts.com.cn

22) 名称：申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
法定代表人：储晓明
联系人：黄莹
电话：4008895523
传真：021-33388224
客服热线：95523
网址：www.swhysc.com

23) 名称：申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
法定代表人：许建平
联系人：李巍
电话：010-88085858
传真：010-88085195
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

24) 名称: 海通证券股份有限公司

住所: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

联系人: 王立群

电话: 021-23219000

传真: 021-63410707、021-63410627

客服热线: 95553

网址: www.htsec.com

25) 名称: 国元证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法人代表: 蔡咏

联系人: 李飞

电话: 0551-62207323

传真: 021-38670767

客服热线: 95578、400-888-8777

网址: www.gyzq.com.cn

26) 名称: 平安证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

联系人: 周一涵

电话: 021-3863746

传真: 0755-82435367

客服热线: 95511-8

网址: www.stock.pingan.com

27) 名称: 国泰君安证券股份有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

联系人: 芮敏祺

电话: 021-38676798

传真: 021-38670798

客服热线: 95521

网址: www.gtja.com

28) 名称: 安信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人: 牛冠兴

联系人: 张晨

电话: 021-66581727

传真: 010-66581721

客服热线: 4008-001-001

网址: www.essences.com.cn

29) 名称: 信达证券股份有限公司

住所: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 张志刚

联系人: 唐静

电话: 010-63080985

传真: 010-63081173

客服热线: 400-800-8899

网址: www.cindasc.com

30) 名称: 华泰证券股份有限公司

住所: 江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962 (深圳)

客服热线: 95597

网址: www.htsc.com.cn

31) 名称: 德邦证券有限责任公司

住所: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人: 姚文平

联系人: 朱磊

电话: 021-68761616-8259

传真: 021-68761616

客服热线: 400-8888-128

网址: www.tebon.com.cn

32) 名称: 英大证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址: 广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层

法定代表人: 吴骏

联系人: 李欣

电话: 0755-83007179

传真: 0755-83007167

客服热线: 4008-698-698

网址: www.ydsc.com.cn

33) 名称: 中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383

传真：010-60836031；0755-23835525

客服热线：95558

网址：www.citics.com

34) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022313

传真：0532-85022301

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

35) 名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、

14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪城

电话：0755-23953913

客户热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

36) 名称：爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：王薇

电话：021-32229888

传真：010-60836221

客服热线：021-63340678

网址：www.ajzq.com

37) 名称：金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025500

传真：0755-83025625

客服热线：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

38) 名称：西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服热线：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

39) 名称：联讯证券有限责任公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

联系人：宋航

电话：0752-2119391

传真：0931-4890628

网址：www.lxzq.com.cn

40) 名称：华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

41) 名称：华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

电话：010-85556100

传真：010-85556153

客服热线：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

42) 名称：民族证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法人代表人：赵大建

联系人：李微

电话：400-889-5618

传真：010-66553216

客服热线：400-889-5618

网址：www.e5618.com

43) 名称：东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：0512-62601555
传真：0512-62938812
客服热线：400-860-1555
网址：www.dwzq.com.cn

44) 名称：中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇
电话：010-65051166
传真：010-85679535
客服热线：4009101166
公司网站：www.cicc.com.cn

45) 名称：天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：尹伶
电话：010-66045152
传真：010-66045518
客服热线：010-66045678
网址：www.txsec.com、www.jjm.com.cn

46) 名称：深圳众禄金融控股股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227953
传真：0755-82080798
客服热线：4006-788-887
众禄基金销售网：www.zlfund.cn
基金买卖网：www.jjmmw.com

47) 名称：上海好买基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
客服热线：400-700-9665
网址：www.howbuy.com

48) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-58788678

传真：021-58787698

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

49) 名称：和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

50) 名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

51) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐映绯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

52) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层

法定代表人：其实

联系人：李广宇

电话：021-54509977-8400

传真：021-54509953

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

53) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
法定代表人：李晓涛
联系人：汪林林
电话：0571-88920810
传真：0571-86800423
客服热线：400-877-3772
网址：www.5ifund.com

54) 名称：北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人：闫振杰
联系人：马林
电话：010-59601366
传真：010-62020355
客服热线：400-818-8000
网址：www.myfp.cn

55) 名称：上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客户热线：400-821-9031
网址：www.lufunds.com

56) 名称：上海汇付金融服务有限公司
住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼
法定代表人：冯修敏
联系人：陈云卉
电话：021-33323999
传真：021-33323837
客户热线：400-821-3999
网址：<https://tty.chinapnr.com>

57) 名称：珠海盈米财富管理有限公司
住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客户热线：020-89629099
网址：www.yingmi.cn

58) 名称：上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

电话：021-20538888

传真：021-20539999

客服热线：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（三）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

（四）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：吕红、黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

（五）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：俞伟敏

经办会计师：单峰、俞伟敏

四、基金的名称

中欧鼎利分级债券型证券投资基金。

五、基金的类型

契约型 开放式

六、基金的投资目标

在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的长期回报。

七、基金的投资方向

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。

本基金可以从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的 3%。

中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1. 资产配置策略

本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、证券市场收益率、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。

本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整大类资产的配置比例。

2. 固定收益类资产投资策略

（1）久期配置策略

久期反映了利率变化对债券价格的敏感程度，本基金将通过宏观经济趋势和利率走势的预判确定组合整体久期，有效的控制组合的利率风险。预期利率上升时，本基金降低组合久期；预期利率下行时，拉长组合久期。

（2）利率期限结构配置策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化。一般情况下，在债券收益率曲线变陡时，采取子弹型策略组合；在债券收益率曲线变平时，采取哑铃型策略组合；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采取梯形策略。

（3）骑乘策略

在预期未来收益率曲线变动较为平稳时，通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

（4）息差策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金可先投入初始资金买入国债，并用所持有的国债进行回购，回购后的资金再买入收益率高于回购利率的其他国债或金融债、企业债，并在回购期末，出售全部现券，并偿还回购融入资金。

（5）信用策略

本基金通过对行业及个券信用评级等方法有效的控制投资的信用风险，在承担适度信用风险的基础上，挖掘收益能有效覆盖风险的投资品种来获取较高的收益，力争做到投资组合安全与收益相结合。

（6）可转债投资策略

本基金在充分研究的基础上，选择条款有利、行业前景看好、公司基本面良好的可转债进行一级市场申购，并根据二级市场转债价格的估值水平、股性特征和债性特征评估等进行二级市场投资。

（7）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指将缺乏流动性但可预测未来现金流的资产组成资产池并以其所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金充分分析基础资产质量及未来现金流，严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资。

（8）流动性策略

本基金还将根据个券发行总量、流通量、上市时间、交易量等流动性指标，决定该个券投资总量的上限。

3. 非固定收益类资产投资策略

（1）二级市场股票投资策略

本基金的股票类资产投资作为整体投资组合管理的辅助工具，为投资人提供适度参与股票市场的机会。

本基金的备选股票库由公司投研团队负责建立和维护。投研团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等，预测上市公司未来盈利前景，并据此申请将股票纳入备选股票库。

在备选股票库的基础上，本基金量化考察上市公司净资产收益率等财务指标和市净率、市盈率等估值指标以及市盈增长比率等指标，以兼顾和平衡公司增长能力和股票估值水平。同时，本基金根据公司投研团队的研究成果，对个股基本面进行定性分析，选择具有增长潜力且估值水平合理的个股进行投资。

（2）新股申购策略

本基金将综合考虑近期市场估值水平、上市首日涨幅、新股中签率和申购机会成本、锁定期限内股价表现和市场资金供求关系等因素，结合公司基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、公司基本面良好、定价偏低的个股进行申购，规避质量较差的公司。

（3）权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

（二）投资决策

1. 投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

2. 投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

3. 投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资事业部负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和基金运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，对基金投资的重大问题进行决策，并在必要时做出修改。

投资事业部负责人负责本事业部内投资管理和内外部沟通工作，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神，结合股票池及有关研究报告，负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

4. 投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

(1) 投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

(2) 在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

(3) 基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

(4) 中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

5. 风险分析与绩效评估

数量分析师负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

6. 组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：中国债券总指数×90%+沪深 300 指数×10%。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。其中，鼎利 A 份额表现出低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。鼎利 B 份额表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额，类似于具有收益杠杆性的债券型基金份额。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2016 年第 3 季度报告，所载数据截至 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	15,806,427.89	2.83
其中：股票	15,806,427.89	2.83
2 基金投资		
3 固定收益投资	497,076,487.40	88.86
其中：债券	477,072,375.62	85.28
资产支持证券	20,004,111.78	3.58
4 贵金属投资	—	—
5 金融衍生品投资	—	—
6 买入返售金融资产	9,000,000.00	1.61
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	25,862,876.54	4.62
8 其他资产	11,664,518.59	2.09
9 合计	559,410,310.42	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	22,902.45	0.01
B 采矿业	1,656.80	—
C 制造业	7,374,720.28	1.78
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	989,604.00	0.24
E 建筑业	20,711.04	0.01
F 批发和零售业	523,129.29	0.13
G 交通运输、仓储和邮政业	80,542.95	0.02
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	25,756.20	0.01
J 金融业	5,159,767.43	1.25
K 房地产业	994,869.48	0.24
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	599,311.97	0.14
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	13,456.00	—
S 综合	—	—
合计	15,806,427.89	3.82

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

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	600036	招商银行	112,734	2,029,212.00	0.49
2	002042	华孚色纺	129,400	1,498,452.00	0.36
3	002705	新宝股份	63,981	1,036,492.20	0.25
4	600104	上汽集团	47,352	1,034,641.20	0.25
5	603818	曲美家居	49,600	1,007,376.00	0.24
6	601318	中国平安	29,200	997,472.00	0.24
7	000895	双汇发展	41,950	989,600.50	0.24
8	600622	嘉宝集团	61,500	988,920.00	0.24
9	000598	兴蓉环境	167,300	966,994.00	0.23
10	600219	南山铝业	331,300	954,144.00	0.23

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	19,892,025.50	4.81
2	央行票据	—	—
3	金融债券	70,185,000.00	16.97
	其中：政策性金融债	70,185,000.00	16.97
4	企业债券	275,251,350.12	66.57
5	企业短期融资券	10,001,000.00	2.42
6	中期票据	101,743,000.00	24.61
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	477,072,375.62	115.38

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	160210 16 国开 10	500,000	50,195,000.00	12.14	
2	122396 15 时代债	200,000	21,416,000.00	5.18	
3	122486 15 旭辉 01	205,000	21,395,850.00	5.17	
4	136078 15 禹洲 01	200,000	20,668,000.00	5.00	
5	101660022 16 吉利 MTN001	200,000	20,172,000.00	4.88	

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119163 15 中和 1A	100,000	10,000,000.00	2.42	
2	123708 15 环球 1B	80,000	8,000,000.00	1.93	
3	119164 15 中和 1B	20,000	2,004,111.78	0.48	

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 981,162.47

2 应收证券清算款 922,625.28

3 应收股利 —

4 应收利息 9,753,736.44

5 应收申购款 6,994.40

6 其他应收款

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 11,664,518.59

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

十二、基金的业绩

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。

本基金合同生效日 2011 年 6 月 16 日，基金业绩截止日 2016 年 9 月 30 日。

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 ①净值增长率 ②净值增长率标准差 ③业绩比较基准收益率 ④业绩比较基准收益率
标准差 ①-③ ②-④

2011.6.16-2011.12.31	-0.60%	0.18%	0.47%	0.18%	-1.07%	0.00%
2012.1.1-2012.12.31	4.93%	0.16%	0.31%	0.14%	4.62%	0.02%
2013.1.1-2013.12.31	4.41%	0.16%	-5.33%	0.18%	9.74%	-0.02%
2014.1.1-2014.12.31	18.64%	0.29%	11.43%	0.18%	7.20%	0.11%
2015.1.1-2015.12.31	8.28%	0.24%	5.34%	0.27%	2.94%	-0.03%
2016.1.1-2016.6.30	0.56%	0.11%	-1.87%	0.21%	2.43%	-0.10%
2016.1.1-2016.9.30	3.11%	0.12%	-0.46%	0.18%	3.57%	-0.06%
2011.6.16-2016.9.30	44.25%	0.21%	11.46%	0.19%	32.79%	0.02%

数据来源：中欧基金 Wind

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
中欧鼎利分级债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011 年 6 月 16 日-2016 年 9 月 30 日)

数据来源： 中欧基金 Wind

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市费；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费、托管费外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2016 年 7 月刊登的《中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书》

（2016 年第 2 号）进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“重要提示”部分

更新了“本更新招募说明书所载内容截止日 2016 年 12 月 15 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。”的描述。

（二）“三、基金管理人”部分

更新了基金管理人的办公地址、董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理和公司投资决策委员会成员基本信息。

（三）“四、基金托管人”部分

更新了基金托管人的基本信息。

（四）“五、相关服务机构”的部分

更新了直销机构、代销机构的信息。

（五）“十三、基金的投资”部分

更新了“（十）基金投资组合报告”的内容，数据截至 2016 年 9 月 30 日。

（六）“十四、基金的业绩”部分

更新了“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”和“基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至 2016 年 9 月 30 日。

（七）“二十五、基金合同的内容摘要”部分

更新了基金管理人的办公地址和基金托管人的基本信息。

（八）“二十六、基金托管协议的内容摘要”部分

更新了基金托管人的基本信息。

（九）“二十八、其他应披露事项”部分

更新了自 2016 年 6 月 16 日至 2016 年 12 月 15 日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自 2016 年 6 月 16 日至 2016 年 12 月 15 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 披露日期

- 1 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金定投业务并参与费率优惠的公告 2016-06-17
- 2 中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理变更公告 2016-06-18
- 3 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过广发证券代销基金定投最低申购金额的公告 2016-06-27
- 4 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 2016-06-28
- 5 中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年 6 月 30 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告 2016-07-01
- 6 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告 2016-07-19
- 7 中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 2 号） 2016-07-30
- 8 中欧鼎利分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 2 号） 2016-07-30
- 9 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2016 年半年度报告 2016-08-24
- 10 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要 2016-08-24
- 11 中欧基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告 2016-09-07
- 12 中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告 2016-09-14
- 13 中欧基金管理有限公司关于子公司办公地址变更的公告 2016-09-20
- 14 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告 2016-09-20
- 15 中欧基金管理有限公司关于新增盈米财富为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告 2016-09-23
- 16 中欧鼎利分级债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告 2016-10-26
- 17 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在国都证券开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告 2016-11-21
- 18 中欧基金管理有限公司关于新增云湾投资为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告 2016-11-25
- 19 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告 2016-11-29

上述内容仅为摘要，须与本基金《更新招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

中欧基金管理有限公司

2017 年 1 月 26 日