

中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）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：广发银行股份有限公司

二〇一八年一月

重要提示

本基金经 2010 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧增强回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1316 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2010 年 12 月 2 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。

根据相关法律法规的规定及本基金《基金合同》的约定，基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，决定自 2015 年 10 月 8 日起对本基金增加 E 类份额并相应修改基金合同。

本基金投资于证券市场，基金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》。本基金的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对本基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书摘要所载内容截止日 2017 年 12 月 1 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

第一部分基金管理人	2
第二部分基金托管人	7
第三部分相关服务机构	10
第四部分基金的名称	39
第五部分基金的类型	39
第六部分基金的投资目标	39
第七部分基金的投资范围	39
第八部分基金的投资策略	40
第九部分基金的业绩比较基准	42
第十部分基金的风险收益特征	43
第十一部分基金的投资组合报告	43
第十二部分基金的业绩	48
第十三部分基金费用与税收	50
第十四部分对招募说明书更新部分的说明	51
第一部分基金管理人	

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：竇玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：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：

序号	股东名称	出资额（万元）	出资比例
1	意大利意联银行股份合作公司	4700	25%
2	国都证券股份有限公司	3760	20%
3	北京百骏投资有限公司	3760	20%
4	万盛基业投资有限责任公司	620.4	3.30%
5	上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）	3760	20%
6	竇玉明	940	5%
7	周玉雄	280.59	1.4925%
8	卢纯青	140	0.7447%
9	于洁	140	0.7447%
10	赵国英	140	0.7447%
11	方伊	100	0.5319%
12	关子阳	100	0.5319%
13	卞玺云	79.01	0.4203%
14	魏博	75	0.3989%
15	郑苏丹	75	0.3989%
16	曲径	75	0.3989%
17	黎忆海	55	0.2926%
	合计	18,800	100%

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

竇玉明先生，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，天合光能有限公司董事。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。

MarcoDEste 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 Credititaliano（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、投行业务董事及内核小组副组长。

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，中国籍。现任北京大学法学院教授、博士生导师，中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士、应用经济学博士后，德国洪堡学者，中国银行法学研究会副会长。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等，毕业于北京大学、美国南美以美大学、哈佛大学法学院。

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 SchulteRothZabellLP 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，监事，现任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。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，监事，现任中欧基金管理有限公司理财规划总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士。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. 基金管理人高级管理人员

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。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16 年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

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、策略组负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12 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，16 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，10 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

姓名 朱晨杰 性别 男

国籍 中国 毕业院校及专业 法国北方高等商业学校金融市场专业

其他公司历任 法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券融资部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员

本公司历任 中欧基金管理有限公司投资经理

本公司现任 基金经理

本基金经理所管理基金具体情况 产品名称 起任日期 离任日期

- 1 中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金 2017年04月07日
- 2 中欧强利债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 3 中欧强裕债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 4 中欧强泽债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 5 中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 6 中欧强盈定期开放债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 7 中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2017年04月07日
- 8 中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 9 中欧骏盈货币市场基金 2017年05月03日
- 10 中欧兴利债券型证券投资基金 2017年04月07日
- 11 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF） 2017年04月07日
- 12 中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF） 2017年04月07日
- 13 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF） 2017年04月07日
- 14 中欧稳健收益债券型证券投资基金 2017年04月07日

(2) 历任基金经理

基金经理 起任日期 离任日期

- 刘德元 2015年08月20日 2017年06月27日
- 赵小强 2015年07月13日 2015年08月20日
- 袁争光 2014年05月07日 2015年07月13日
- 赖海英 2011年07月28日 2012年06月13日
- 聂曙光 2010年12月02日 2014年05月07日

5. 基金管理人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、副总经理顾伟、副总经理兼策略组负责人卢纯青、信用评估部负责人张明、策略组负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、黄华、周玉雄、赵国英、曲径、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。

第二部分基金托管人

一、基金托管人情况

(一) 基本情况

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：杨明生

成立时间：1988年7月8日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363号

联系人：周小磊

联系电话：（010）65169562

广发银行股份有限公司成立于1988年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本154亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

截至2016年12月31日，广发银行总资产20475.92亿元、总负债19416.18亿元、实现营业收入553.18亿元、拨备前利润364.43亿元。据英国《银行家》杂志2016年全球银行排名，广发银行按一级资本列第86位。

（二）主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行处、内控与综合管理处、保险与期货业务处和客户营销处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作十八年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015年1月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理，现主持部门工作。

（三）基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363号。截至2016年12月末，托管资产规模20,429.55亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面的托管服务。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专设内控与综合管理处，配备了专职内部监察稽核人员，负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

（三）内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方

式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用资产托管业务基金监督系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1、每工作日按时通过基金监督系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

第三部分相关服务机构

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

（一）A类份额销售机构

1. 直销机构（A类）

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：竇玉明

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（A类）

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：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.psbc.com

4)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

5)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

6)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：常振明

联系人：王媛

电话：010-65556689

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

7)名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636388

传真：010-63636713

客服热线：95595

网址：www.cebbank.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：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

10)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 3845 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

11)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

12)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

13)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

14)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.xyjq.com.cn

15)名称：光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 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

16)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

17)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

18)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>

19)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

20)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

21)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

22)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

23)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

24)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

25)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

26)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

27)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

28)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

29)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

30)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

31)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

32)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

33)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

34)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

35)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

36)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

37)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

38)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

39)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

40)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

41)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

42)名称: 方正证券股份有限公司

住所: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址: 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人: 高利

联系人: 高洋

电话: 010-59355546

传真: 010-56437013

客服热线: 95571

公司网站: <http://www.foundersc.com/>

43)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

44)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

45)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

46)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

47)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

48)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

49)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

50)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

51)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

52)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

53)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

54)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>

55)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

56)名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

57)名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com>

58)名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

59)名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号E世界A座1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界A座1108号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：www.hcjijin.com

60)名称：上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服热线：021-50810673

（二）E类份额销售机构

1. 直销机构（E类）

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（E类）

1)名称：广东南海农村商业银行股份有限公司

住所：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

办公地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号

法定代表人：李宜心

联系人：吴泳施

电话：0757-86369512

传真：0757-86250627

客服热线：96138

网址：www.nanhaibank.com

2)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

3)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>

4)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

5)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

6)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

7)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：徐晔绯
电话：0571-28829790
传真：0571-26698533
客服热线：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

8)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

9)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>

10)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

11)名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F
法定代表人：钱昊旻
联系人：孙雯
电话：010-59336519
传真：010-59336500
客服热线：400-890-9998
网址：www.jnlc.com

12)名称：上海利得基金销售有限公司
住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼法定
代表人：李兴春联系人：徐鹏电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服热线：400-921-7755 网址：
www.leadfund.com.cn

13)名称：上海联泰资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人：燕斌
联系人：兰敏
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服热线：4000-466-788
网址：www.66zichan.com

14)名称：北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层
法定代表人：钟斐斐
联系人：吴季林
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客服热线：4000-618-518
网址：<https://danjuanapp.com>

15)名称：天津国美基金销售有限公司
住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室
办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层
法定代表人：丁东华
联系人：郭宝亮

电话: 010-59287984

传真: 010-59287825

客服热线: 400-111-0889

网址: www.gomefund.com

16)名称: 北京广源达信投资管理有限公司

住所: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人: 齐剑辉

联系人: 王英俊

电话: 13911468997

传真: 010-92055860

客服热线: 400-623-6060

网址: www.niuiufund.com

17)名称: 上海万得投资顾问有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人: 王廷富

联系人: 徐亚丹

电话: 021-51327185

传真: 021-50710161

客服热线: 400-821-0203

网址: 暂无

18)名称: 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人: 李昭琛

联系人: 付文红

电话: 010-62676405

传真: 010-62676582

客服热线: 010-62675369

网址: www.xincai.com

19)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

20)名称: 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人: 陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客服热线：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

21)名称：上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-88066552

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

22)名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471/13466546744

传真：010-62680827

客服热线：4006199059

网址：www.hcjijin.com

23)名称：上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.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、注册登记机构

本基金 A 类份额注册登记机构信息如下：

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：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938828

本基金 E 类份额注册登记机构信息如下：

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：竇玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

四、出具法律意见书的律师事务所

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：吕红安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：吕红

五、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

第四部分基金名称

中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）

第五部分基金的类型

契约型开放式

第六部分基金的投资目标

在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。

第七部分基金的投资范围

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、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。

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%。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，但可以参与新股申购、股票增发，并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。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%。

本基金投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产比例合计不低于 40%。本基金所指信用债券是指金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债券、可转债、可分离交易可转债、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

在封闭期结束后，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。

第八部分基金的投资策略

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债券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、债券市场收益率、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固定收益类资产投资比例。

2. 固定收益类资产投资策略

(1) 利率策略

久期管理策略

由于久期反映了利率变化对债券价格的影响程度，因此本基金将根据对宏观经济趋势和利率走势的预判，对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

收益率曲线策略

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，并相应选择子弹型、哑铃型或梯形策略，以获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获得价差收益。

息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于中长期债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

(2) 信用策略

本基金力争通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在信用债券的选择时特别重视信用风险的评估和防范。本基金通过分析宏观经济趋势和信用风险历史情况，判断当前信用债券市场整体的信用风险水平，从而确定信用债券整体投资比例。本基金根据信用债券发行人的行业前景、行业地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价信用债券发行人的信用风险，同时根据信用债券的特别条款，评估信用债券的信用风险。

(3) 可转债投资策略

本基金将结合可转债发行公司的基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、基本面良好、定价偏低的公司的可转债进行投资。本基金还基于对利率走势、到期收益率、可转债特别条款、发行公司信用风险、个券流动性等因素，分析可转债的债券投资价值。同时，采用期权定价模型，估算可转债的转换期权价值。综合以上因素，对可转债进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

(4) 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资产池所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

(5) 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) 新股申购策略

本基金的新股申购策略包括新股发行和股票增发的申购策略。在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定差价，从而使新股申购成为一种风险较低的投资方式。

本基金同时也认为，该差价是暂时现象，新股申购策略是一种阶段性投资策略。

本基金将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。

本基金还综合考虑新股中签率、上市首日涨幅、锁定期限内股价表现和市场资金供求关系等因素，选择网上申购或网下申购及申购数量。所中签的新股在上市交易后择机卖出。

(2) 权证投资策略

本基金不主动投资权证但可持有因持有股票或可分离债而获得的权证。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，谨慎进行持有并择机卖出。

第九部分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。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制并于 2001 年 12 月 31 日推出的中国全市场债券指数，该指数同时覆盖了交易所和银行间两个债券市场的主要固定收益证券并以债券托管量市值为样本权重。该指数能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性，适合作为本基金的业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，报中国证监会备案。

第十部分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。

第十一部分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 2017 年第 3 季度报告，所载数据截至 2017 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 -- --

其中：股票 -- --

2 基金投资 -- --

3 固定收益投资 750,591,930.60 93.65

其中：债券 730,591,930.60 91.16

资产支持证券 20,000,000.00 2.50

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 17,517,513.47 2.19

8 其他资产 33,338,236.75 4.16

9 合计 801,447,680.82 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

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。

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。

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 499,050.00 0.08

2 央行票据 — —

3 金融债券 49,538,000.00 8.00

其中：政策性金融债 49,538,000.00 8.00

4 企业债券 313,979,460.60 50.73

5 企业短期融资券 230,508,000.00 37.25

6 中期票据 117,762,000.00 19.03

7 可转债(可交换债) 18,305,420.00 2.96

8 同业存单 — —

9 其他 — —

10 合计 730,591,930.60 118.05

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 1480472 14 浏阳城建债 400,000 33,308,000.00 5.38

2 041778001 17 宿迁经发 CP001 300,000 30,069,000.00 4.86

3 011754120 17 鲁钢铁 SCP001 300,000 30,063,000.00 4.86

4 011764100 17 柳工 SCP001 300,000 30,006,000.00 4.85

5 011760107 17 山东海洋 SCP001 300,000 30,000,000.00 4.85

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 146199 借呗 24A1 200,000 20,000,000.00 3.23

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

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。

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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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

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。

11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 44,241.28

2 应收证券清算款 —

3 应收股利 —

4 应收利息 13,189,334.17

5 应收申购款 20,104,661.30

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 33,338,236.75

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113011 光大转债 10,027,800.00 1.62

2 110032 三一转债 3,187,620.00 0.52

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。

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。

第十二部分基金的业绩

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 2010 年 12 月 2 日，基金业绩截止日 2017 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

中欧增强回报债券(LOF)A

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2010.12.22-2010.12.31 -0.04% 0.08% 0.25% 0.09% -0.29% -0.01%

2011.1.1-2011.12.31 -0.57% 0.13% 2.52% 0.11% -3.09% 0.02%

2012.1.1-2012.12.31 5.15% 0.09% -0.67% 0.07% 5.82% 0.02%

2013.1.1-2013.12.31 4.83% 0.11% -5.28% 0.11% 10.11% 0.00%

2014.1.1-2014.12.31 17.61% 0.23% 7.48% 0.15% 10.13% 0.08%

2015.1.1-2015.12.31 12.38% 0.23% 4.51% 0.11% 7.87% 0.12%

2016.1.1-2016.12.31 1.77% 0.08% -1.80% 0.13% 3.57% -0.05%

2017.1.1-2017.6.30 1.24% 0.06% -2.48% 0.11% 3.72% -0.05%
2017.1.1-2017.9.30 2.05% 0.06% -2.88% 0.09% 4.93% -0.03%
2010.12.2-2017.9.30 50.39% 0.15% 3.58% 0.11% 46.81% 0.04%

数据来源：中欧基金

中欧增强回报债券(LOF)E

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015.10.8-2015.12.31 3.65% 0.09% 2.07% 0.11% 1.58% -0.02%

2016.1.1-2016.12.31 1.82% 0.08% -1.80% 0.13% 3.62% -0.05%

2017.1.1-2017.6.30 1.27% 0.06% -2.48% 0.11% 3.75% -0.05%

2017.1.1-2017.9.30 2.08% 0.06% -2.88% 0.09% 4.96% -0.03%

2015.10.8-2017.9.30 7.74% 0.08% -2.66% 0.11% 10.40% -0.03%

数据来源：中欧基金

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

中欧增强回报债券（LOF）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

（2010年12月02日-2017年09月30日）

中欧增强回报债券（LOF）E

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10月12日-2017年09月30日）

注：本基金于2015年10月8日新增E份额，图示日期为2015年10月12日至2017年9月30日。

第十三部分基金的费用与税收

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：

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

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：

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

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。

第十四部分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 2017 年 7 月刊登的《中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了重要提示部分中的相关内容。

更新了本更新招募说明书所载内容截止日 2017 年 12 月 1 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。。

（二）更新了第三部分基金管理人部分中的相关内容。

1、更新了股权结构。

2、更新了董事会成员信息、监事会成员信息、高级管理人员、基金经理和投资决策委员会成员的信息。

（三）更新了第四部分基金托管人部分中的相关内容。

更新了托管人的信息。

（四）更新了第五部分相关服务机构部分中的相关内容。

1、更新了代销机构的信息。

2、更新了注册登记机构的联系人。

3、补充了改聘会计师事务所的期后事项。

（五）更新了第九部分基金份额的场外申购、转换与赎回部分中的相关内容。

更新了场外申购与赎回的数量限制。

（六）更新了第十二部分基金的投资部分中的相关内容。

更新了十一、基金投资组合报告，所载数据取自本基金 2017 年第 3 季度报告，所载数据截至 2017 年 9 月 30 日。

（七）更新了第十三部分基金的业绩部分中的相关内容。

更新了基金的业绩，基金业绩截止日 2017 年 9 月 30 日。

（八）更新了第十五部分基金资产的估值部分中的相关内容。

补充了调整流通受限股票估值方法的期后事项。

（九）更新了第二十六部分其他应披露事项部分中的相关内容。

更新了自 2017 年 06 月 02 日至 2017 年 12 月 1 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。

以下为本基金管理人自 2017 年 06 月 02 日至 2017 年 12 月 1 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 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告 2017-06-28
- 2 中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2017 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 2017-07-01
- 3 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2017 年第 2 号） 2017-07-15
- 4 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2017 年第 2 号） 2017-07-15
- 5 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）2017 年第 2 季度报告 2017-07-21
- 6 中欧基金管理有限公司关于新增中泰证券为旗下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 2017-08-03
- 7 中欧基金管理有限公司关于股权转让及股东变更的公告 2017-08-08
- 8 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过中泰证券代销基金定投最低申购金额的公告 2017-08-24
- 9 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过盈米财富代销基金定投最低申购金额的公告 2017-08-25
- 10 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告 2017-08-29
- 11 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告摘要 2017-08-29
- 12 中欧基金管理有限公司关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠的公告 2017-09-08
- 13 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过平安证券代销基金定投最低申购金额的公告 2017-09-15
- 14 中欧基金管理有限公司关于新增蛋卷基金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 2017-10-20
- 15 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）2017 年第 3 季度报告 2017-10-26
- 16 中欧基金管理有限公司关于子公司办公地址变更的公告 2017-11-11
- 17 中欧基金管理有限公司关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠的公告 2017-11-21
- 18 中欧基金管理有限公司关于子公司名称变更的公告 2017-11-22
- 19 中欧基金管理有限公司关于新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下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 2017-11-30

中欧基金管理有限公司

2018 年 1 月 15 日