

中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)
更新招募说明书摘要
(2019年第2号)

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二〇一九年八月

重要提示

中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由基金管理人修订《中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金合同》，经中国证券监督管理委员会变更注册而来，并经2016年12月22日中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议通过。自2016年12月26日起，由《中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，原《中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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注册，但中国证监会对本基金的变更注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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。投资者在投资本基金前，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。投资者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，由于基金投资者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。

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其

长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

投资有风险，投资者在认（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新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为2019年6月25日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分	基金管理人	5
第二部分	基金托管人	12
第三部分	相关服务机构	14
第四部分	基金的名称	32
第五部分	基金的类型	32
第六部分	基金的投资目标.....	32
第七部分	基金的投资范围.....	33
第八部分	基金的投资策略.....	33
第九部分	基金的业绩比较基准	34
第十部分	基金的风险收益特征	35
第十一部分	基金的投资组合报告	35
第十二部分	基金的业绩	39
第十三部分	基金费用与税收.....	43
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明.....	45

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号五层
- 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、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：22000万元人民币
- 15、股权结构：

序号	股东名称	出资额 (人民币万元)	出资比例
1	Unione di Banche Italiane S.p.A.	5,500	25.0000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	北京百骏投资有限公司	4,400	20.0000%
4	上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	窦玉明	1,100	5.00000%
6	万盛基业投资有限责任公司	726	3.3000%
7	周玉雄	328.35	1.4925%
8	卢纯青	163.8340	0.7447%
9	于洁	163.8340	0.7447%

10	赵国英	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞玺云	92.4660	0.4203%
14	魏博	87.7580	0.3989%
15	郑苏丹	87.7580	0.3989%
16	曲径	87.7580	0.3989%
17	黎忆海	64.3720	0.2926%
合计		22,000	100%

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，天合光能股份有限公司董事。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。

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，曾在意大利信贷银行(Credito Italiano, 现名：联合信贷银行 Unicredit) 圣雷莫分行、米兰分行、伦敦分行、纽约分行、东京分行(财务部负责人)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，北京大学法学学士、法学硕士，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学教师，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、The Red Flag Group 非执行董事, 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、贵阳银行股份有限公司独立董事、荣威国际集团股份有限公司独立董事、中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事、交银国际信托有限公司独立董事、上海袅之文学艺术创作有限公司执行董事。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, 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，兼任中欧基金管理有限公司策略组负责人，中国籍。上海财经大学金融学硕士，18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，14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，18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，11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	赵国英	性别	女
国籍	中国	毕业院校及专业	清华五道口金融学院金融学专业
其他公司历任	天安保险有限公司债券交易员(2004.07-2005.05)，兴业银行资金营运中心债券交易员(2005.05-2009.12)，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁(2009.12-2015.04)		
本公司历任	投资经理		

本公司现任	策略组负责人、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	中欧纯债债券型 证券投资基金 (LOF)	2018年08月21日	
2	中欧强瑞多策略 定期开放债券型 证券投资基金	2018年08月21日	
3	中欧强势多策略 定期开放债券型 证券投资基金	2018年08月21日	2018年11月22日
4	中欧强盈定期开 放债券型证券投 资基金	2018年08月21日	
5	中欧信用增利债 券型证券投资基 金(LOF)	2018年08月21日	
6	中欧兴利债券型 证券投资基金	2018年08月21日	
7	中欧增强回报债 券型证券投资基 金(LOF)	2018年08月21日	
8	中欧兴华定期开 放债券型发起式 证券投资基金	2018年10月30日	

姓名	蒋雯文	性别	女
----	-----	----	---

国籍	中国	毕业院校及专业	香港中文大学财务学专业
其他公司历任	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)		
本公司历任	交易员、基金经理助理		
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	中欧瑾泰债券型证券投资基金	2018年01月30日	
2	中欧双利债券型证券投资基金	2018年01月30日	
3	中欧骏泰货币市场基金	2018年01月30日	
4	中欧康裕混合型证券投资基金	2018年01月30日	
5	中欧可转债债券型证券投资基金	2018年01月30日	2019年02月19日
6	中欧滚钱宝发起式货币市场基金	2018年01月30日	2019年02月19日
7	中欧骏益货币市场基金	2018年01月30日	2018年09月05日
8	中欧货币市场基金	2018年01月30日	
9	中欧短债债券型证券投资基金	2018年01月30日	2019年02月19日
10	中欧弘涛一年定期开放债券型证	2018年01月30日	2019年02月19日

	券投资基金		
11	中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金	2018年01月30日	2019年02月19日
12	中欧聚信债券型证券投资基金	2018年02月13日	2018年11月02日
13	中欧安财定期开放债券型发起式证券投资基金	2018年05月29日	
14	中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金	2018年07月12日	
15	中欧睿泓定期开放灵活配置混合型证券投资基金	2018年07月12日	
16	中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金	2018年07月12日	
17	中欧鼎利债券型证券投资基金	2018年09月21日	
18	中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金	2018年09月21日	
19	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金	2018年09月21日	
20	中欧强裕债券型证券投资基金	2018年09月21日	2018年11月02日

21	中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金	2019年01月16日	
22	中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金	2019年01月16日	
23	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)	2019年02月11日	

(2) 历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
朱晨杰	2017年04月07日	2018年08月21日
刘德元	2015年12月02日	2017年06月27日
孙甜	2014年12月15日	2015年12月25日
姚文辉	2012年06月13日	2014年12月15日
聂曙光	2012年04月16日	2014年01月17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,副总经理兼策略组负责人顾伟,副总经理兼研究总监、策略组负责人卢纯青,策略组负责人周蔚文、陆文俊、周玉雄、刁羽、黄华、陈岚、赵国英、曲径、曹名长、王培、王健,信用评估部总监张明,风险管理部总监孙自刚,中央交易室总监陆正芳组成。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

1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：张金良

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：810.31亿元

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕673号

联系人：王瑛

联系电话：010—68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；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；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部,下设资产托管处、产品管理处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工23人,全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格,90%员工具有三年以上基金从业经历,具备丰富的托管服务经验。

3、托管业务经营情况

2009年7月23日,中国邮政储蓄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联合批准,获得证券投资基金托管资格,是我国第16家托管银行。2012年7月19日,中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准,获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念,依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务,并获得了合作伙伴一致好评。

截至2019年6月30日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共92只。至今,中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达39810.55亿元。

第三部分 相关服务机构

一、场内销售机构

具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见相关公告)。

二、本基金C类份额场外销售机构

1. 直销机构(C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. 其他销售机构（C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

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：田国立

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：彭纯

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

客服热线：95580

网址：www.psbc.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

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：洪崎

客服热线：95568

网站：www.cmbc.com.cn

7) 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

客服热线：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

8) 名称：杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

客服热线：400-888-8508

网址：www.hzbank.com.cn

9) 名称：阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人: 李科

客服热线: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com>

10) 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

客服热线: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

11) 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: 霍达

客服热线: 95565、4008888111

网址: www.newone.com.cn

12) 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

客服热线: 95536

网址: www.guosen.com.cn

13) 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

客服热线: 95575

网址: www.gf.com.cn

14) 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

客服热线: 400-888-8108

网址: www.csc108.com

15) 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; 上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人: 杨华辉

客服热线: 95562

网址: www.xyzq.com.cn

16) 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: 周健男

客服热线: 95525

网址: www.ebscn.com

17) 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

客服热线: 0591-96326

网址: www.hfzq.com.cn

18) 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: 陈共炎

客服热线: 4008-888-888

网址: www.chinastock.com.cn

19) 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

客服热线: 95538

网址: <http://www.zts.com.cn>

20) 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: 李梅

客服热线: 95523

网址: www.swhysc.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: 周杰

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

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：刘世安

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

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：王连志

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：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层（信达证券）

法定代表人：张志刚

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

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

28) 名称：德邦证券股份有限公司

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 29 楼

法定代表人：武晓春

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

29) 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

客服热线：95558

网址：www.citics.com

30) 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：姜晓林

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

31) 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

客户热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

32) 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：祝健

客服热线：021-63340678

网址：www.ajzq.com

33) 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：王作义

客服热线：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

34) 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：廖庆轩

客服热线：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

35) 名称：联讯证券股份有限公司

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

客服热线：95564

网址：www.lxzq.com.cn

36) 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

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

网址：www.hlzqgs.com

37) 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

客服热线：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

38) 名称：中国民族证券有限责任公司

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：何亚刚

客服热线：400-889-5618

网址：www.e5618.com

39) 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

客服热线：400-860-1555

网址：www.dwzq.com.cn

40) 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

客服热线：4009101166

公司网站：www.cicc.com.cn

41) 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

客服热线：95571

公司网站：<http://www.foundersc.com/>

42) 名称: 上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济
发展区)

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人: 王翔

客服电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

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

客服热线: 010-66045678

网址: www.txsec.com、www.jjm.com.cn

44) 名称: 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

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

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

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

客服热线: 400-920-0022

网址: licaike.hexun.com

48) 名称: 诺亚正行基金销售有限公司

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

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文一西路 1218 号 1 楼 202 室

办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人: 陈柏青

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

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: 凌顺平

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

客服热线: 400-818-8000

网址: www.myfp.cn

网址: www.5irich.com

53) 名称: 上海陆金所基金销售有限公司

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: 王之光

客户热线: 400-821-9031

网址: www.lufunds.com

54) 名称: 上海汇付基金销售有限公司

住所: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址: 上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人: 金佶

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

客户热线: 020-89629099

网址: www.yingmi.cn

56) 名称: 北京肯特瑞基金销售有限公司

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: 江卉

客服热线: 4000988511/ 4000888816

网址: <http://fund.jd.com/>

57) 名称: 中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司

住所: 上海自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S 室

办公地址: 上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B301-305

法定代表人: 许欣

客服热线: 400-700-9700

58) 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 世界财富中心 A 座 1108 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 1108 号

法定代表人: 王伟刚

客服热线: 4006199059

网址: www.hcjijin.com

59) 名称: 嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

客服热线: 400-021-8850

网址: <https://www.harvestwm.cn/>

60) 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: 谢永林

客服热线: 95511-3

网址: www.bank.pingan.com

61) 名称: 南京苏宁基金销售有限公司

住所: 江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址: 江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人: 王锋

客服热线: 95177

网址: www.snjijin.com

三、本基金E类份额场外销售机构

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. 其他销售机构(E类)

1) 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

客服热线: 400-888-8108

网址: www.csc108.com

2) 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: 陈共炎

客服热线: 4008-888-888

网址: www.chinastock.com.cn

3) 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

客服热线: 95558

网址: www.citics.com

4) 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: 姜晓林

客服热线: 0532-96577

网址: www.zxwt.com.cn

5) 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

客户热线: 400-990-8826

网址: www.citicsf.com

6) 名称: 上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济
发展区)

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人:王翔

客服电话:400-820-5369

网址:www.jiyufund.com.cn

7)名称:北京肯特瑞基金销售有限公司

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:江卉

客服热线:4000988511/4000888816

网址:http://fund.jd.com/

8)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世界财富中心A座1108号

办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座1108号

法定代表人:王伟刚

客服热线:4006199059

网址:www.hc jijin.com

9)名称:大连银行股份有限公司

住所:辽宁省大连市中山区中山路88号

办公地址:辽宁省大连市中山区中山路88号

法定代表人:陈占维

客服热线:4006640099

网址:www.bankofdl.com

10)名称:南京苏宁基金销售有限公司

住所:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址:江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人:王锋

客服热线:95177

网址:www.snjijin.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，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。

四、登记机构

本基金C类份额登记机构信息如下：

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

法人代表：周明

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938828

本基金E类份额登记机构信息如下：

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

五、出具法律意见书的律师事务所

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：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

六、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、印艳萍

第四部分 基金的名称

中欧信用增利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。

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,包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、债券回购、银行存款、同业存单,以及国债期货等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)。

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

基金的投资组合比例为:

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;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,本基金持有现金(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不低于基金资产净值的5%。

第八部分 基金的投资策略

1. 固定收益投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。

(1) 久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期偏离策略,根据对利率水平的预期调整组合久期。

(2) 期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

(3) 类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置,包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

(4) 个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的过程。

2. 资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券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。

3. 国债期货投资策略

本基金对国债期货的投资以组合利率风险管理为主要目的。本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上,按照“利率风险评估——套期保值比例计算——保证金、期现价格变化等风险控制”的流程,构建并动态管理国债期货合约数量。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债综合(全价)指数

中债综合(全价)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,是以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日起发布。中债综合(全价)指数的样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势,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

本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

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2019年第1季度报告,所载数据截至2019年3月31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	174,372,432.70	69.99
	其中:债券	172,372,432.70	69.19
	资产支持证券	2,000,000.00	0.80
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	40,000,180.00	16.06
	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	31,308,260.12	12.57

	合计		
8	其他资产	3,450,481.36	1.39
9	合计	249,131,354.18	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,850,100.00	11.19
	其中：政策性金融债	23,850,100.00	11.19
4	企业债券	57,853,332.70	27.13
5	企业短期融资券	9,998,000.00	4.69
6	中期票据	80,671,000.00	37.84
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	172,372,432.70	80.85

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	018005	国开 1701	110,000	11,001,100.00	5.16
2	108901	农发 1801	105,000	10,535,700.00	4.94
3	136417	16 万达 02	103,710	10,409,372.70	4.88
4	1018010 67	18 豫园商 城 MTN00 2	100,000	10,272,000.00	4.82
5	1018014 16	18 伊泰 M TN001	100,000	10,143,000.00	4.76

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比 例(%)
1	156762	禹物优 01	20,000	2,000,000.00	0.94

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

本基金对国债期货的投资以组合利率风险管理为主要目的。本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上, 按照“利率风险评估—套期保值比例计算—保证金、期现价格变化等风险控制”的流程, 构建并动态管理国债期货合约数量。

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持有国债期货。

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。

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	23,388.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,426,042.85
5	应收申购款	1,050.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,450,481.36

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。

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2016年12月26日,基金业绩截止日2019年3月31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

转型前：中欧信用增利分级债券型证券投资基金成立以来的业绩如下：

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
2012.4.16-2012.12.31	5.53%	0.08%	0.23%	0.06%	5.30%	0.02%
2013.1.1-2013.12.31	1.17%	0.10%	-3.75%	0.08%	4.92%	0.02%
2014.1.1-2014.12.31	8.51%	0.11%	6.54%	0.11%	1.97%	0.00%
2015.1.1-2015.4.15	1.14%	0.06%	0.36%	0.10%	0.78%	-0.04%
2012.4.16-2015.4.15	17.17%	0.10%	3.15%	0.09%	14.02%	0.01%

数据来源：中欧基金

转型后：中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF) C类份额的业绩如下：

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
2015.4.16(转型为中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF))-2015.12.31	3.33%	0.06%	3.82%	0.08%	-0.49%	-0.02%
2016.1.1-2016.12.31	0.46%	0.12%	-1.63%	0.09%	2.09%	0.03%
2017.1.1-2017.12.31	2.19%	0.06%	-3.38%	0.06%	5.57%	0.00%
2018.1.1-2018.12.31	0.26%	0.18%	4.79%	0.07%	-4.53%	0.11%
2019.1.1-2019.3.31	0.96%	0.05%	0.47%	0.05%	0.49%	0.00%

2015.4.16(转型为中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)) -2019.3.31	7.35%	0.12%	3.88%	0.08%	3.47%	0.04%
--	-------	-------	-------	-------	-------	-------

中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)E类份额的业绩如下:

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
2016.4.6-2016.12.31	-1.08%	0.14%	-1.82%	0.10%	0.74%	0.04%
2017.1.1-2017.12.31	1.60%	0.06%	-3.38%	0.06%	4.98%	0.00%
2018.1.1-2018.12.31	0.49%	0.18%	4.79%	0.07%	-4.30%	0.11%
2019.1.1-2019.3.31	1.05%	0.05%	0.47%	0.05%	0.58%	0.00%
2016.4.11-2019.3.31	2.06%	0.13%	-0.13%	0.08%	2.19%	0.05%

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

中欧信用增利债券(LOF)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

(2012年04月16日-2019年03月31日)



中欧信用增利债券(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

(2016年04月11日-2019年03月31日)



注：自2016年4月6日起，本基金增加E类份额，图示日期为2016年4月11日至2019年3月31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. 基金的销售服务费;
4. 基金上市费及年费;
5. 基金的银行汇划费用;
6. 基金的相关账户的开户及维护费用;
7. 基金合同生效后的与基金相关的基金信息披露费用;
8. 基金份额持有人大会费用;
9. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
10. 基金的证券/期货交易费用;
11. 按照国家有关规定和基金合同约定,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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人于次月首日起3个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核无误后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核无误后从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

3. 基金的销售服务费

本基金 E 类基金份额不收取基金销售服务费, C 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核无误后从基金财产中一次性划付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等以及其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目不得从基金财产中列支。

四、违规处理方式

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、《运作办法》及其他有关规定从基金财产中列支费用时,基金托管人可要求基金管理人予以说明解释,如基金管理人无正当理由,基金托管人可拒绝支付。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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2019年2月刊登的《中欧信用增利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为2019年6月25日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。”的描述。

(二)更新了“第三部分 基金管理人”部分中的相关内容。

- 1、更新了基金管理人的住所、注册资本和股权结构。
- 2、更新了董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理、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、更新了直销机构和登记机构的住所。
- 2、更新了代销机构。

(五)更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分中的相关内容。

更新了相关表述。

(六)更新了“第九部分 基金投资组合报告”部分中的相关内容

所载数据取自本基金2019年第1季度报告,所载数据截至2019年3月31日。

(七)更新了“第十部分 基金的业绩”部分中的相关内容。

更新了基金业绩,截止日2019年3月31日。

(八) 更新了“第二十二部分 其他应披露事项”部分中的相关内容。

更新了自2018年12月26日至2019年6月25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。

(九) 更新了“附件一 基金合同内容摘要”、“附件二 基金托管协议内容摘要”部分中的相关内容。

更新了管理人的信息。

以下为本基金管理人自2018年12月26日至2019年6月25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调整旗下部分基金在广发证券定投起点的公告	2019-05-15
2	中欧基金管理有限公司旗下基金2019年第一季度报告	2019-04-18
3	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	2019-04-12
4	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报摘要	2019-03-28
5	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报	2019-03-28
6	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	2019-03-13
7	中欧基金管理有限公司关于新增基煜基金为部分基金代销机构同步开通转换业务并享受费率优惠的公告	2019-03-13
8	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	2019-02-12
9	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要(2019年第1号)	2019-02-02
10	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2019年第1号)	2019-02-02

11	中欧基金管理有限公司旗下基金 2018 年第四季度报告	2019-01-22
12	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	2019-01-18
13	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	2019-01-18
14	中欧基金管理有限公司关于新增苏宁基金为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并享受费率优惠的公告	2019-01-16
15	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	2019-01-01

中欧基金管理有限公司

2019 年 8 月 10 日