

中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月24日

送出日期：2024年6月25日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|----------------|----------------|-----------------------|
| 基金简称 | 中欧增强回报债券（LOF） | 基金代码 | 166008 |
| 下属基金简称 | 中欧增强回报债券（LOF）A | 下属基金交易代码 | 166008 |
| 下属基金简称 | 中欧增强回报债券（LOF）C | 下属基金交易代码 | 007446 |
| 下属基金简称 | 中欧增强回报债券（LOF）E | 下属基金交易代码 | 001889 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月2日 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2011年2月18日 |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 周锦程 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年5月26日 |
| | | 证券从业日期 | 2011年7月1日 |

二、基金投资与净值表现

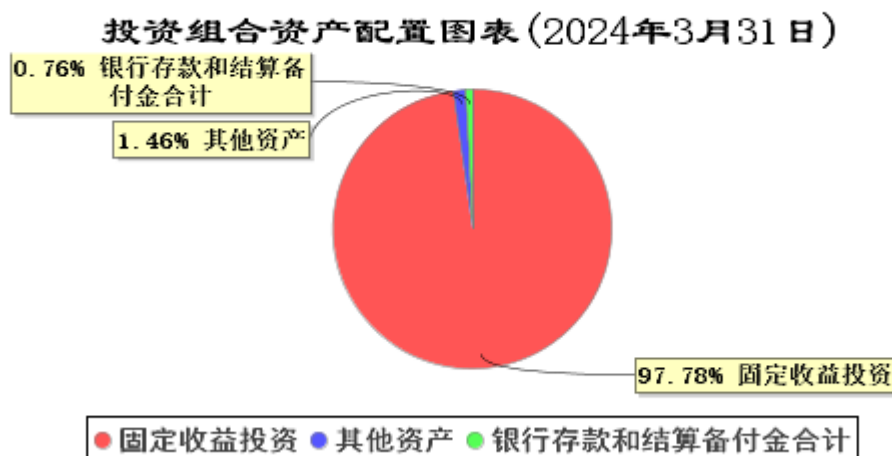
（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况

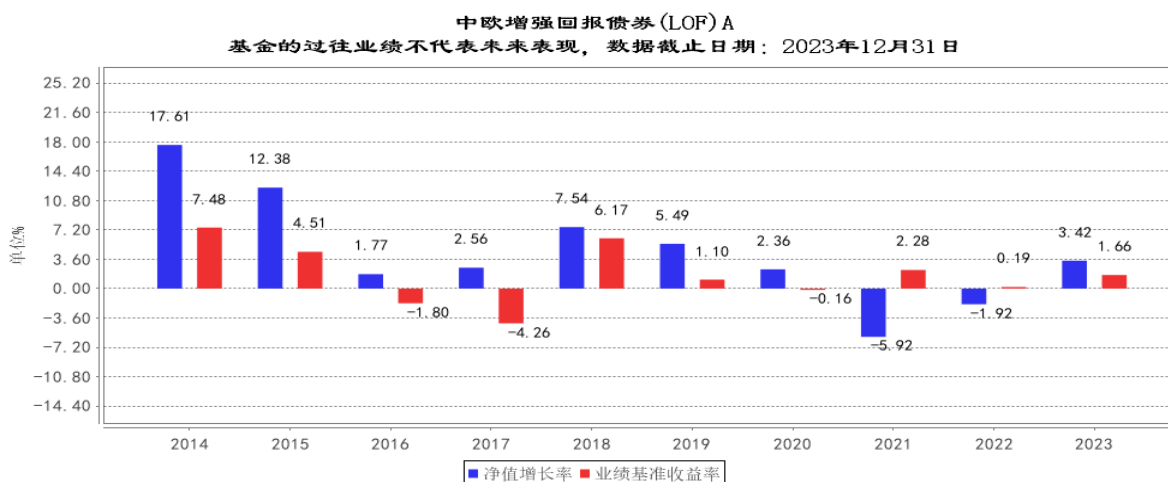
| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，但可以参与新股申购、股票增发，并可持有因可转债转股所形成的股票、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（不包括结算备付金、存出保证金、 |

| | |
|--------|--|
| | <p>应收申购款等) 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。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金的利率策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略。</p> <p>本基金的信用策略是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。</p> <p>其他策略包括可转债投资策略、资产支持证券投资策略和流动性策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数 |
| 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。 |

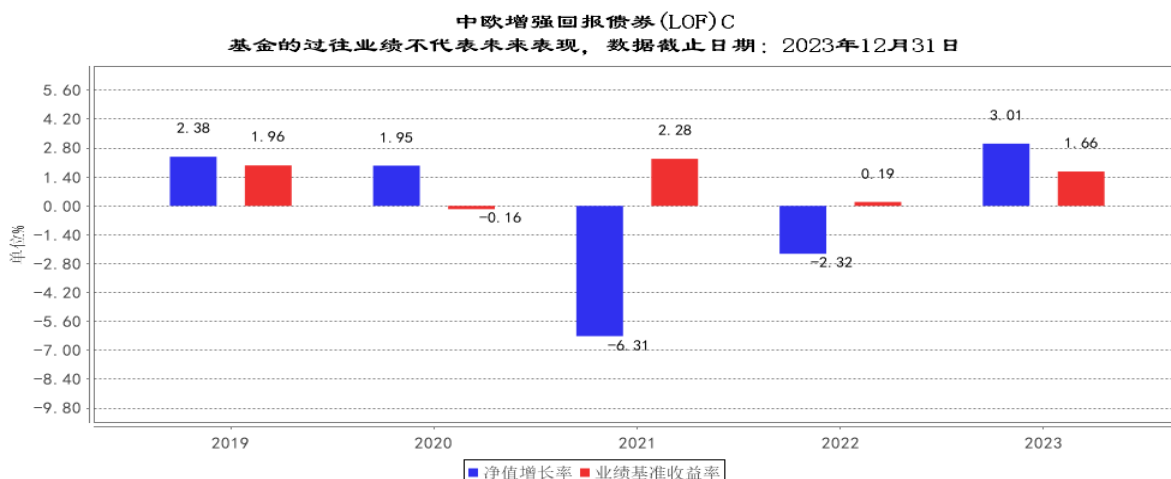
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



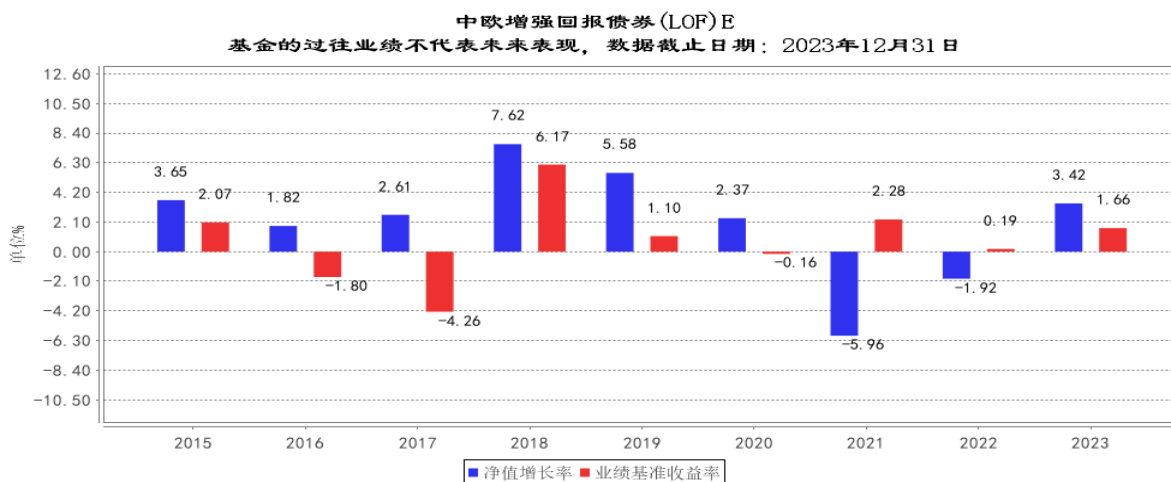
(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注: 本产品于 2020/10 修改投资范围, 增加存托凭证为投资标的。



注: 1. 基金增加份额当年期间的相关数据按实际存续期计算。
2. 本产品于 2020/10 修改投资范围, 增加存托凭证为投资标的。



注: 1. 基金增加份额当年期间的相关数据按实际存续期计算。
2. 本产品于 2020/10 修改投资范围, 增加存托凭证为投资标的。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

中欧增强回报债券 (LOF) A

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|---------------------------|--------------|------|
| 申购费 (前收费) | 0 ≤ M < 50 万 | 0.80% | |
| | 50 万 ≤ M < 100 万 | 0.50% | |
| | 100 万 ≤ M < 500 万 | 0.30% | |
| | M ≥ 500 万 | 1,000.00 元/笔 | |
| 赎回费 | 0 天 ≤ N < 7 天 | 1.50% | 场外份额 |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.10% | 场外份额 |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | 0.05% | 场外份额 |

| | | | |
|--|---------------|-------|------|
| | N ≥ 730 天 | 0.00% | 场外份额 |
| | 0 天 ≤ N < 7 天 | 1.50% | 场内份额 |
| | N ≥ 7 天 | 0.10% | 场内份额 |

注:1、场内交易费用以证券公司实际收取为准;

2、上表适用于投资者(通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户除外)申购 A 类基金份额的情形;通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户费率适用情况详见本基金招募说明书及相关公告。

中欧增强回报债券 (LOF) C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费 | 0 天 ≤ N < 7 天 | 1.50% |
| | 7 天 ≤ N < 30 天 | 0.10% |
| | N ≥ 30 天 | 0.00% |

申购费

本基金 C 类份额不收取申购费。

中欧增强回报债券 (LOF) E

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|--------------|-----------------------------|--------------|
| 申购费 (前收费) | 0 ≤ M < 50 万 | 0.80% |
| | 50 万 ≤ M < 100 万 | 0.50% |
| | 100 万 ≤ M < 500 万 | 0.30% |
| | M ≥ 500 万 | 1,000.00 元/笔 |
| 赎回费 | 0 天 ≤ N < 7 天 | 1.50% |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.10% |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | 0.05% |
| | N ≥ 730 天 | 0.00% |

注:上表适用于投资者(通过基金管理人的直销中心申购本基金 E 类基金份额的养老金客户除外)申购 E 类基金份额的情形;通过基金管理人的直销中心申购本基金 E 类基金份额的养老金客户费率适用情况详见本基金招募说明书及相关公告。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | | 收取方 |
|-------|------------------|-------|------------|
| 管理费 | 0.30% | | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.08% | | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 中欧增强回报债券 (LOF) C | 0.40% | 销售机构 |
| 审计费用 | 70,000.00 元 | | 会计师事务所 |
| 信息披露 | 120,000.00 元 | | 规定披露报刊 |

| | | |
|------|--------------------|--------|
| 露费 | | |
| 其他费用 | 详见招募说明书的基金费用与税收章节。 | 相关服务机构 |

注：1. 年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准

2. 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

中欧增强回报债券 (LOF) A

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.42% |

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

中欧增强回报债券 (LOF) C

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.82% |

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

中欧增强回报债券 (LOF) E

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.42% |

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：

- 市场风险；
- 流动性风险；
- 管理风险；
- 信用风险；
- 其他风险；

-本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

（二）重要提示

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作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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

对于因本基金基金合同的订立、内容、履行和解释或与本基金基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。本基金基金合同受中国法律管辖。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.zofund.com][客服电话：400-700-9700]

- 1、《中欧增强回报债券型证券投资基金基金合同》
《中欧增强回报债券型证券投资基金托管协议》
《中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无