

中欧基金管理有限公司中欧兴利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:兴业银行股份有限公司
二〇二〇年四月
中国证监会2015年7月24日中国证监会基金监管部(以下简称“中国证监会”)下发的关于准予中欧兴利债券型证券投资基金注册的批复(证监许可[2015]1787号)准予募集注册。本基金基金合同于2015年9月25日正式生效。

基金管理人保证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募集的注册,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。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。

投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为债券型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益/收益的产品。
投资人购买本基金并不等于将资金作为银行存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在取得基金投资权益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人投资管理过程中产生的操作风险以及基金特有的风险等。

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资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不预示其未来表现,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。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“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,由投资人自行承担。

本次更新招募说明书仅根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订,更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的投资与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(财务数据未经审计)。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

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楼-嘉盛大厦7层
4.法定代表人:裘玉明
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:袁进
13.客户服务电话:021-68609600,400-700-9700(免长途话费)
14.注册资本:22,000万人民币
15.股权结构:

Table with 4 columns: 序号, 股东名称, 出资额(人民币万元), 出资比例. Lists shareholders like Unione di Banche Italiane S.p.A., 国都证券股份有限公司, etc.

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员
裘玉明先生, 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、副总经理兼基金投资部、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) 从事意大利、爱尔兰、伦敦分行、纽约分行、东京分行(财务部门负责人)及米兰总部工作。

朱腾华先生, 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, 光大证券股份有限公司, 担任业务董事及风控小组副组长。刘建平先生, 北京大学法学博士, 法学硕士, 美国亚利桑那州立大学法律商学博士, 中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京交通大学工商管理博士, 应用经济学博士, 德国洪堡学者, 中国政法大学法学研究副教授。历任北京交通大学法学院讲师、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, 美国南美洲大学, 哈佛大学法学院。

戴国雄先生, 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董事, 贵阳银行股份有限公司独立董事, 赛富国际集团股份有限公司独立董事, 中国绿地环球集团有限公司独立董事, 交银国际信托有限公司独立董事。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, 中欧基金管理有限公司副总经理, 国都证券股份有限公司副总经理、监察部, 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, 上海泰泰律师事务所合伙人, 中国籍。武汉大学法学学士, 复旦大学金融研究院博士。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问, 广东致广律师事务所合伙人, 美国纽约州 Schulze 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助理, 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主管。

3. 基金管理人高级管理人员
裘玉明先生, 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(中国)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助理, 副总经理、总经理。

尹海华先生, 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研究总监, 策略组负责人, 中国籍。加拿大圣母玛利亚大学金融学硕士, 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。

肖欣先生, 中欧基金管理有限公司分管风控副总经理, 中国籍。中国人民大学金融学硕士, 18 年以上基金从业经验。历任平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。

卜雁女士, 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

Table with 4 columns: 姓名, 国籍, 毕业院校及专业, 清华五道口金融学院金融学专业. Lists current fund managers like 魏国英, etc.

Table with 3 columns: 基金经理, 起止日期, 离任日期. Lists past fund managers like 朱晨杰, etc.

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、策略组负责人卢迪青, 策略组负责人周文、陆文俊、周玉雄、刁羽、黄华、陈霞、魏国英、曲径、曹名长、培、王健、信用评估部总监张明、风险管理部总监孙自刚、中央交易室总监陆芳组成。其中总经理刘建平担任投资决策委员会主任。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况
1. 基金托管人: 兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)
注册地址: 福州市湖东路154号
办公地址: 上海市江宁路168号
法定代表人: 高建平
成立时间: 1988年8月22日
注册资本: 207.74亿元人民币
存续期间: 持续经营
基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[2005]74号
托管部联系人: 黄玉婷
电话: 021-52629999
传真: 021-62192121

2. 发展概况及财务状况
兴业银行成立于1988年8月, 是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一, 总行设在福建省福州市, 2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码: 601166), 注册资本207.74亿元。

开业二十年来, 兴业银行始终恪守“真诚服务, 相伴成长”的经营理念, 致力为客户提提供全面、优质、高效的金融服务。截至2017年12月31日, 兴业银行资产总额达6.42万亿元, 实现营业收入1399.75亿元, 全年实现归属于母公司股东的净利润572.00亿元。根据2017年美国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名, 兴业银行一级资本排名第28位, 按总资产排名第30位, 终身身全球银行50强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单, 兴业银行以426.21亿美元总资产强排名第250位。同时, 过去一年, 在国际外权威机构组织的各项评比中, 先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

二、托管业务部门设置及人员情况
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部, 下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室, 共有员工100余人, 业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管人内部控制制度
兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批文文号: 证监基金字[2005]74号。截至2018年12月31日, 兴业银行已托管开放式基金248只, 托管基金资产规模8964.38亿元。

四、基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规, 行业监管规章和行内有关管理规定, 守法经营, 规范运作, 严格监控, 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。

2. 内部控制组织结构
兴业银行基金托管业务内部控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内部稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。前中后台相互独立、相互制约, 确保托管业务的安全运行。稽核监察处保持高度的独立性和客观性, 负责对托管业务的内部控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则: 各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制, 建立不同岗位之间的制衡体系。
(4) 授权性和职责分明原则: 建立完善的风险管理指标体系, 使风险管理更具客观性和可操作性。
(5) 防堵漏洞原则: 托管部自身财务与基金财务严格分开; 托管业务日常操作部门与研发、研发和管理等部门严格分离。

(6) 有效性原则: 内部控制体系所处的环境必须适应, 以合理的成本实现内部控制目标。内部制度的制订应当具有前瞻性, 并应当根据国家政策、法律及监管管理的要求, 适时进行相应修改和完善; 内部控制应当具有高度的权威性, 任何人不得拥有不受内部控制约束的权力, 内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

(7) 审慎性原则: 内控与风险管理必须以防范风险, 审慎经营, 保证托管资产的安全与完整为出发点; 托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则, 在新设机构或新增业务时, 做到先期完成内部控制建设。
(8) 责任追究原则: 各业务环节都应有明确的责任人, 并按规定对违反制度的直接责任人以及负有领导责任的主管领导追究问责。

4. 内部控制制度及监督
(1) 制度建设: 建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
(2) 建立健全的组织管理架构: 前中后台分离, 不同部门、岗位相互牵制。
(3) 风险识别与评估: 稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估, 制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间: 业务操作区相对独立, 实施门禁管理和音像监控。
(5) 人员管理: 进行定期的业务与职业道德培训, 使员工树立风险防范与控制意识, 并签订承诺书。
(6) 应急预案: 制定完善的应急预案, 并定期组织员工定期演练; 建立异地设备备份中心, 保证业务不中断。

五、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进行监督的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定, 托管人对基金的投资对象和投资组合比例、投资限制、费用计提和支付、基金会计核算、基金资产净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行为, 对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有关违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为, 应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为, 应立即报告中国证监会, 同时, 通知基金管理人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人指令违反法律法规、行政法和其他有关规定, 或者违反基金合同约定的, 应当拒绝执行, 立即通知基金管理人, 并及时向中国证监会报告。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
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5层
办公地址: 上海市虹口区公平路18号8楼-嘉盛大厦7层
法定代表人: 裘玉明
联系人: 倪丹
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
名称: 国都证券股份有限公司
住所: 北京市东城区东直门内大街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内大街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.zofund.com
基金管理人可以根据情况变化, 增加或者减少销售机构, 并在基金管理人网站公示。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。

一、登记机构
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5层
办公地址: 上海市虹口区公平路18号8楼-嘉盛大厦7层
法定代表人: 裘玉明
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: 杨敏

三、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

四、审计会计师事务所(特殊普通合伙)
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
负责人: 吴港
经办注册会计师: 徐冲、印艳玲

第四部分 基金的名称
中欧兴利债券型证券投资基金

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
在有效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固定收益类品种, 包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规和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。
本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%; 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

(一) 固定收益投资策略
本基金采取久期偏离、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) 久期配置
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, 根据对利率水平短期和中长期趋势的判断, 进行久期配置。
(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, 以便更灵活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品种间的配置, 包括国债、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, 确定一定期限内的债券品种的过程。
(二) 资产支持证券投资策略
本基金通过投资于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、预期提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响, 谨慎选择资产支持证券。

(三) 中小企业私募债投资策略
与传统的信用债相比, 中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让, 普遍具有高风险和高收益的显著特征。本基金将通过基本面研究, 结合公司分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量, 选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为: ①研究债券发行人的公司背景, 产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位; ②治理结构等基本信息, 分析企业的长期运作情况; ③运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价, 评估发行人财务状况; ④利用历史数据, 评估市场以及资产质量等指标, 评估私募债券发行人的违约率及违约损失率; ⑤考察债券发行人的增信措施, 如担保、抵押、质押、银行授信、增信基金、有序偿债安排等; ⑥综合上述分析结果, 确定信用风险的合理水平, 利用市场的相对差异, 选择具有投资价值品种进行投资。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 中债综合指数收益率
中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的资产配置和投资风格, 选用上述业绩比较基准能够客观、合理地衡量本基金的收益实现情况。
如果今后法律法规发生变化, 或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时, 本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则, 根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须经基金托管人同意, 并报中国证监会备案, 无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金, 预期收益和预期风险水平高于货币市场基金, 但低于混合型基金、股票型基金, 属于中低风险/收益的产品。

第十一部分 基金的投资组合报告

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
基金托管人根据基金合同规定, 复核了本报告投资报告, 保证报告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2018年第四季度报告, 所载数据截至2018年12月31日, 本报告中所有财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists portfolio items like 权益投资, 其中: 股票, 债券投资, etc.

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. 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股投资股票。

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond investments like 国家债券, 央行票据, etc.

7. 基金的证券/期货交易费用:

8. 基金的销售费用:
9. 基金托管费:
10. 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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 1.5% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前3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、公休假等, 支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H = E × 0.25% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的托管费
E 为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前3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、公休假等, 支付日期顺延。

三、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. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
6. 基金份额持有人大会费用;

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 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, 并依据基金管理人及基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动, 对《招募说明书》进行了更新, 主要更新内容如下:
一、本次更新招募说明书仅根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订, 更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容, 有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(财务数据未经审计)。

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond investments.

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10名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 10 asset-backed investments.

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5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5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
本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

10. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本报告期末本基金未持有国债期货。

11. 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
本报告期末本基金未持有期权。

12. 本基金为资产支持证券, 未涉及股票相关投资。

13. 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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

本报告因四舍五入原因, 投资组合报告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预示其未来表现。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2015年9月25日, 基金业绩截止日2018年12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



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

中欧兴利债券型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

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. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金的销售服务费;
7. 基金的银行汇划费用;
8. 基金的相关账户的开户及维护费用;
9. 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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H = E × 0.30% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前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、公休假等, 支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H = E × 0.10% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的托管费
E 为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前3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、公休假等, 支付日期顺延。

三、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. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
6. 基金份额持有人大会费用;

四、基金税收

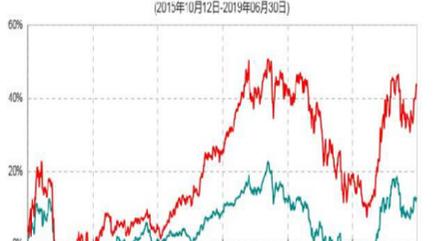
本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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, 并依据基金管理人及基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动, 对《招募说明书》进行了更新, 主要更新内容如下:
一、本次更新招募说明书仅根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订, 更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容, 有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(财务数据未经审计)。

(上接 C131 版)

中欧兴利债券型(L0F)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



注: 本基金自2015年10月8日新增E类份额, 图示日期为2015年10月12日至2019年06月30日。

三、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. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;
6. 基金份额持有人大会费用;

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

中欧兴利债券型(L0F)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

