(上接B17版)

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的15%;经基金管理人和基金托管人协商,可对以上比例进行调整;

(16)本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的10%,并且不得超过基金净值的10%;

(17)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的,应当根据风险管理的原则,并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例,应当符合中国证监会的有关规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(六)业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:

中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

中证健康产业指数以中证全指的所有样本股为样本空间,突出更为适宜的行业跨度与良好的可投资性原则,选取规模大、流动性好的100余只股票作为成份股;涉及医疗保健、食品健康、环保产业三个领域,以便综合反映沪深两市具有健康产业或相关行业特征的公司股票的整体走势,同时为投资者提供新的投资标的。

标的指数发生变更时,业绩比较基准随之发生变更,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案并公告。

(七)风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看,前海开源中证健康A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;前海开源中证健康B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

(八)基金管理人代表基金行使股东、债权人权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

2.不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

3.有利于基金财产的安全与增值;

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(九)基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

(十)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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年5月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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截至2015年12月31日(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	1,187,463,706.96	90.49
	其中:股票	1,187,463,706.96	90.49
2	基金投资	-	-
	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
6	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	113,535,531.82	8.65
8	其他资产	11,212,611.74	0.85
9	合计	1,312,211,850.52	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	165,245,878.89	12.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	656,112,545.45	50.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	122,750,448.37	9.50
E	建筑业	33,222,004.45	2.57
F	批发和零售业	54,630,105.86	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	85,858,040.16	6.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,985,045.14	1.78
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,140,804,068.32	88.26

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	13,019,418.00	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,276,010.64	1.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,364,210.00	1.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,659,638.64	3.61

2.3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通过沪港通机制投资港股。

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

3.1 报告期末指数投资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	000028	国药一致	258,048	17,069,875.20	1.32
2	600085	同仁堂	356,000	15,881,160.00	1.23
3	600436	片仔癀	202,350	13,919,656.50	1.08
4	600867	通化东宝	506,100	13,750,737.00	1.06
5	600965	福成五丰	841,779	13,720,997.70	1.06
6	002007	华兰生物	310,500	13,662,000.00	1.06
7	002299	圣农发展	621,200	13,660,188.00	1.06
8	002252	上海莱士	340,590	13,545,264.30	1.05
9	600079	人福医药	602,300	13,407,198.00	1.04
10	000538	云南白药	183,814	13,348,572.68	1.03

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002143	印纪传媒	502,200	20,364,210.00	1.58
2	300355	蒙草抗旱	744,171	13,276,010.64	1.03
3	000925	众合科技	636,900	11,769,912.00	0.91
4	600429	三元股份	171,400	1,249,506.00	0.10

注:本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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投资国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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期没有出现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基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,630,455.40
2	应收证券清算款	9,472,372.57
3	应收股利	-
4	应收利息	56,177.77
5	应收申购款	53,606.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,212,611.74

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

11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000028	国药一致	17,069,875.20	1.32	资产重组

11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002143	印纪传媒	20,364,210.00	1.58	筹划非公开发行
2	300355	蒙草抗旱	13,276,010.64	1.03	筹划非公开发行
3	000925	众合科技	11,769,912.00	0.91	资产重组
4	600429	三元股份	1,249,506.00	0.10	资产重组

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金

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 -2015.12.31	19.00%	1.04%	1.46%	2.90%	17.54%	-1.86%

注:本基金的业绩比较基准为:中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

九、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》生效后的标的指数许可使用费;

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费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的开户费用;

9、基金的银行汇划费用、银行账户维护费用;

10、基金的上市费和年费;

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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times$年管理费率$\div$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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times$年托管费率$\div$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5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

标的指数许可使用费按基金资产净值的0.02%年费率计提。

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.02\%\div$当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币4万元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。标的指数许可使用费每日计算,逐日累计至每季度末,按季支付,由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的,本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

如果中证指数有限公司根据指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法,应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

上述"一、基金费用的种类"中第4-11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

下列费用不列入基金费用:

1、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;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、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。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒介上公告。

(五)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。

十、其他应披露事项

(一)前海开源基金管理有限公司(以下简称"本公司")的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理有限公司(以下简称"前海开源资管公司")兼职及领薪情况如下:

本公司总经理、董事蔡颖女士兼任前海开源资管公司董事长、法定代表人;

本公司首席运营官、董事会秘书李志祥先生兼任前海开源资管公司董事;

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事;

本公司联席投资总监付柏瑞先生兼任前海开源资管公司联席总经理、投资经理;

本公司员工吴彦女士、李隽女士、范洁女士、魏淳女士、张洋先生、黄玥先生兼任前海开源资管公司投资经理。

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。

本公司除上述人员以外未有其他董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

(二)2015年10月16日至2016年4月16日披露的公告:

2016-04-06前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加华龙证券为代销机构并开通定投和转换业务的公告

2016-03-31前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加新兰德费率优惠活动的公告

2016-03-30前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加英大证券为代销机构的公告

2016-03-30前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2015年年度报告摘要

2016-03-30前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2015年年度报告

2016-03-23前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏银行为代销机构并开通定投和转换业务的公告

2016-03-22前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加同花顺费率优惠活动的公告

2016-03-18前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构并参与其费率优惠活动的公告

2016-03-11前海开源基金管理有限公司关于旗下基金在大同证券开通定投业务的公告

2016-03-03前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告

2016-02-29前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-01-22前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2015年第4季度报告

2016-01-18前海开源基金管理有限公司关于降低旗下开放式基金在天天基金销售平台申购金额下限的公告

2016-01-08前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加积木基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2016-01-06关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告

2016-01-06关于前海开源健康分级A定期份额折算后次日前收盘价调整的公告

2016-01-05关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间前海开源健康分级A份额停复牌的公告

2016-01-05关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之前海开源健康分级A份额约定年基准收益率调整的公告

2016-01-04前海开源基金管理有限公司旗下基金2015年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告

2015-12-31前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

2015-12-29前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金第一次定期份额折算的公告

2015-12-04前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告

2015-12-01前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参加长量基金费率优惠活动的公告

2015-11-28前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2015-11-27前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告

2015-11-27前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告

2015-11-20前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2015-11-19前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加天风证券为代销机构并开通定投和转换业务的公告

2015-11-06前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其优惠活动的公告

2015-11-02前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务并在直销机构实行申购补差费率优惠的公告

2015-10-24前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金2015年第3季度报告

2015-10-23前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加中国邮政储蓄银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其优惠活动的公告

2015-10-16前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加大通证券为代销机构并开通转换业务的公告

2015-10-16前海开源基金管理有限公司关于旗下基金增加国金证券为代销机构并开通转换业务的公告

十一、备查文件

(一)备查文件名录

1、中国证监会准予注册前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金募集的文件

2、《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》

3、《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金登记结算服务协议》

4、《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金托管协议》

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二)备查文件的存放地点和投资人查阅方式

1、存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式

投资人可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按工本费购买复印件。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、对"基金管理人"部分,对人员信息进行了更新。

2、对"基金托管人"相关信息进行了更新。

3、在"相关服务机构"部分,对管理人相关信息及代销机构名单进行了更新。

4、对"基金份额的申购与赎回"相关信息进行了更新,包括基金申购赎回费率、开放、定投、转换等。

5、在"基金的投资"部分,对"(十)基金的投资组合报告"、"(十一)基金的业绩"相关信息进行了相关更新。

6、在"对基金份额持有人的服务"部分,对"电子网上查询服务"、"电子直销交易系统网上开户与交易服务"部分表述进行了更新。

7、在"其他应披露事项"部分,披露了本基金管理人董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司前海开源资产管理有限公司兼职及领薪情况;披露了期间涉及本基金的公告。

8、对部分表述进行了更新。

前海开源基金管理有限公司

二〇一六年五月三十日

(上接B18版)

客服热线:400-920-0022

网址:licaike.hexun.com

(47)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

(48)杭州数米基金销售有限公司

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:徐昳绯

电话:0571-28829790

传真:0571-26698533

客服热线:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

(49)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:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人:其实

联系人:李广宇

电话:021-54509998-7019

传真:021-64385308

客服热线:400-1818-188

网址:www.1234567.com.cn

(50)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

(51)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

(52)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

(53)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

(三)本基金E类份额场外发售机构

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:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

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

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

本基金C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

法人代表:周明

联系人:朱立元

电话:010-59378839

传真:010-59378907

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:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

法定代表人:窦玉明

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:管志斌

(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、安冬

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:安冬

(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

中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)。

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超额收益。

七、基金的投资方向

本基金投资于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)。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,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。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券的资产占基金资产净值的比例不低于80%;投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%;在增利A的开放日及该日前4个工作日和分级运作期终止后,本基金所持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

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

八、基金的投资策略

(一)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。

(二)固定收益类资产投资策略

本基金的固定收益类资产投资将主要采取信用策略,同时辅之以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。

1.信用策略

个券信用风险管理的主要依据为该证券的外、内部评级结果。信用评级包括主体信用评级、债项信用评级和评级展望,评级对象包括除国债、央行票据和政策性金融债之外的其他各类固定收益证券。

在内部评级过程中需要进行包括行业分析、企业分析、财务分析和增信措施在内的综合分析,并运用信用评级方法,结合国内主要信用评级机构的评级结果,给出内部信用评估结果和建议,并经讨论后形成信用风险评级报告并审定,经内部审定后最终确定固定收益证券的内部信用评级。同时还将进行信用评级跟踪,及时、准确的修正评级结果;若发现重大信用风险,及时应对。

本基金在信用风险内部评估时,遵循以下原则:审慎评级原则,在对主体及债项进行信用风险评级过程中,应遵循审慎的原则评估其经营状况和财务风险;定性分析与定量分析相结合的原则,经营风险评估和财务风险评估是信用分析的两大主要内容,前者采用以定性为主、定量为辅的分析方法,后者采取以定量为主、定性为辅的分析方法,在对主体及债项进行信用风险评级过程中,需综合考虑两方面的因素,综合评定;历史考察和未来预测相统一的原则:债券评级的目的是预测发行主体未来的偿债能力和违约风险,在评级过程中,需要根据其历史经营业绩、竞争优势和劣势、发展规划以及管理层的经营能力,着重考察其未来经营和现金流状况,预测和评价发行主体的营运周期、未来资本运作以及其对未来财务状况的影响。

2.久期策略

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场的未来走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。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。

3.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。并针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中(子弹)策略、两端(哑铃)策略和梯形(阶梯)策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

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。

4.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。

5.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。

6.资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产信托给受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该财产所产生的现金支付其收益的证券。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。

7.流动性策略

本基金还将从市场环境,债券发行人特征和债券特征等方面充分考察固定收益类资产的流动性风险,具体包括个券的发行方式、发行规模、交易规模、交易方式、交易场所、交易成本、交易即时性、信用评级、剩余期限、债券票息、债券复杂性等方面,充分考察固定收益类资产的流动性风险,并确定该个券投资总量的上限。

(三)权益资产投资策略

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。本基金根据内外部新股研究报告,选择行业前景看好、公司基本面良好、定价偏低的新股进行申购。本基金还综合考虑过往新股的中签率、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,选择申购方式和申购数量。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,择机卖出。

九、基金的业绩比较基准

中债综合(全价)指数

十、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。

从投资者具体持有的基金份额来看,由于基金收益分配的安排,基金分级运作期内,增利A将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额;增利B则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人邮储银行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1季度报告,所载数据截至2016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	1,629,114,768.80	96.64
	其中:债券	1,629,114,768.80	96.64
	资产支持证券	-	-
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	20,277,104.26	1.20
8	其他资产	36,326,029.34	2.15
9	合计	1,685,717,902.40	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

本基金本报告期末未持有股票。

(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.报告期末按券种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	62,072,400.00	5.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,014,000.00	11.18
	其中:政策性金融债	135,014,000.00	11.18
4	企业债券	1,042,373,368.80	86.33
5	企业短期融资券	109,689,000.00	9.08
6	中期票据	279,966,000.00	23.19
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,629,114,768.80	134.93

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1480092	14余经开债	500,000	55,175,000.00	4.57
2	1480579	14郑州恒润债	500,000	54,460,000.00	4.51
3	150405	15农发05	500,000	52,135,000.00	4.32
4	150208	15国开08	500,000	52,075,000.00	4.31
5	019515	15国债15	520,000	52,062,400.00	4.31

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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名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)本基金投资国债期货的投资政策

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)本基金投资国债期货的投资评价

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,没有投资于备选库以外的股票。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,569.37
2	应收证券清算款	4,996,303.09
3	应收股利	-
4	应收利息	30,971,993.57
5	应收申购款	264,080.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	45,082.37
8	其他	-
9	合计	36,326,029.34

(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

本基金本报告期末未持有股票。

(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2012年4月16日,基金业绩截止日2016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(中欧信用分级债券型证券投资基金基金合同生效日)-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%	0.79%	-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,wind

转型后:中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)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%
2016.1.1-2016.3.31	1.74%	0.07%	0.31%	0.07%	1.43%	0.00%
2015.4.16(转型为中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF))-2016.3.31	5.13%	0.07%	4.14%	0.08%	0.99%	-0.01%

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

基金转型后:

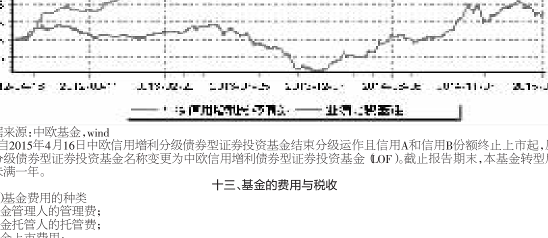
中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2015年4月16日至2016年3月31日)

基金转型前:

中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2012年4月16日至2015年4月15日)



数据来源:中欧基金,wind

注:自2015年4月16日中欧信用增利分级债券型证券投资基金结束分级运作且信用A和信用B份额终止上市起,原中欧信用增利分级债券型证券投资基金名称变更为中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)。截止报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

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.基金上市费用;

4.基金财产拨划支付的银行费用;

5.基金合同生效后的基金信息披露费用;

6.基金份额持有人大会费用;

7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

8.基金的证券交易费用;

9.基金销售服务费;

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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0.70%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.70\%\div$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

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

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0.20%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.20\%\div$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

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3.基金销售服务费

(1)基金分级运作期内的销售服务费

本基金的销售服务费按前一日增利A的基金资产净值的0.35%年费率计提,增利B不收取销售服务费。

计算方法如下:

$H=E\times 0.35\%\div$当年天数

H为增利A每日应计提的基金销售服务费

E为增利A前一日基金资产净值

(2)基金分级运作期届满后的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金E类基金份额不收取销售服务费,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0.35%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.35\%\div$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

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

(四)基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费和基金上市初费及年费、基金银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

(五)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不得从基金财产中列支。

(六)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人的公司网站上刊登公告。

(七)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2015年11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(2015年第2号)》进行了更新,主要更新内容如下:

(一)"重要提示"部分

1、增加了本基金新增E份额的相关内容并对应调整本招募说明书的相关表述;

2、更新了本招募说明书更新所载内容的截止时间。

(二)"二、释义"部分

更新了基金销售网点、注册登记机构、注册登记系统、基金份额类别、跨系统转托管、基金份额转换的释义。

(三)"三、基金管理人"部分

更新了基金管理人的住所、办公地址、董事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理、公司投资决策委员会成员相关信息。

(四)"四、基金托管人"部分

更新了基金托管人的基本信息。

(五)"五、相关服务机构"部分

1、更新了代销机构的信息;

2、更新了E类份额注册登记机构的基本信息。

(六)"八、基金合同的生效"

增加了基金份额的类别部分的内容。

(七)"九、基金份额的上市交易"

完善了新增E类份额后的相关表述。

(八)"十、基金份额的申购与赎回"

完善了"分级运作期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回"部分的表述,更新了新增E类份额的申购与赎回的数额限制、申购费用和赎回费用等内容。

(九)"十一、基金份额的登记、非交易过户、转托管、冻结与质押"

完善了基金的转托管部分的表述。

(十)"十二、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3月31日。

(十一)"十三、基金的业绩"部分

更新了整章的信息,包括"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3月31日。

(十二)"十五、基金资产的估值"

完善了不同类别基金份额分别估值的相关表述。

(十三)"十六、基金的收益分配"

完善了基金收益分配的相关表述。

(十四)"二十三、基金合同的内容摘要"

更新了基金管理人的住所和办公地址信息。

(十五)"二十四、基金托管协议的内容摘要"

更新了基金管理人的住所和办公地址信息。

(十六)"二十六、其他应披露事项"

更新了自2015年10月16日至2016年4月15日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自2015年10月16日至2016年4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	事项名称	披露日期
1	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)2015年第3季度报告	2015/10/24
2	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台上线的公告	2015/10/30
3	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇付金融为代销机构并开通定期定额投资和费率优惠的公告	2015/11/27
4	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2015年第2号)	2015/11/28
5	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(2015年第2号)	2015/11/28
6	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	2015/12/3
7	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金通过汇付金融开通转换业务的公告	2015/12/9
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	2015/12/26
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与邮政储蓄银行费率优惠活动的公告	2015/12/30
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增陆金所资管为代销机构并参与费率优惠的公告	2015/12/30
11	中欧基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整的提示性公告	2015/12/31
12	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2015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	2016/1/1
13	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	2016/1/4
14	中欧基金管理有限公司督察长离任公告	2016/1/5
15	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书	2015/1/5
16	中欧基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	2016/1/6
17	中欧基金管理有限公司关于指数发生不可恢复交易熔断后旗下基金开放时间调整的公告	2016/1/7
18	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告	2016/1/8
19	中欧基金管理有限公司住所变更公告	2016/1/20
20	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)2015年第4季度报告	2016/1/22
21	中欧基金管理有限公司代行督察长公告	2016/2/19
22	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)2015年年度报告	2016/3/29
23	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)2015年年度报告摘要	2016/3/29
24	中欧基金管理有限公司关于中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)新增E类基金份额并修改合同公告	2016/4/6
25	中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金合同(修订)	2016/4/6
26	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率优惠的公告	2016/4/8
27	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台开通部分基金转换业务的公告	2016/4/8
28	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告	2016/4/15

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

2016年5月30日