

(上接B30版)

19)名称:上海万得基金销售有限公司
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:上海市浦东新区浦东南路1500号得大厦11楼
法定代表人:王征富
客服热线:400-821-0203
网址:暂无

20)名称:北京新浪仓石基金销售有限公司
住所:北京市海淀区西北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部研发楼5层518室

办公地址:北京市海淀区西北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部研发楼5层518室

法定代表人:李昭琛
客服热线:400-62675369
网址:www.sinafund.com

21)名称:上海云基基金管理有限公司
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:朱桂华
客服热线:400-820-1515
网址:www.zhengtongfunds.com

22)名称:北京肯特基业基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路1号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创一街18号院A座京东集团总部
法定代表人:江江
客服热线:400-9988511/400888816
网址:https://fund.jd.com

23)名称:上海华夏财富基金投资管理有限公司
住所:上海市浦东新区东平路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:毛海平
客服热线:400-817-5666
网址:www.equantum.com

24)名称:北京汇金基金销售有限公司
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:李伟刚
客服热线:4006199059
网址:www.hqfund.com

25)名称:上海挖财基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区高南路799号5层01,02,03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区高南路799号5层01,02,03室
法定代表人:冷飞
客服热线:400-50810673
网址:www.wacaijin.com

26)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:孙振林
客服热线:95511-3
网址:www.bank.pingan.com

27)名称:大成基金管理有限公司
住所:辽宁省沈阳市中山区中山路88号
办公地址:辽宁省沈阳市中山区中山路88号
法定代表人:陈立伟
客服热线:4006640099
网址:www.bancifund.com

28)名称:南京汇金基金销售有限公司
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:王峰
客服热线:95177
网址:www.sjzqj.com

基金管理人可以根据实际情况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、登记注册机构

本基金的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:010-5038782
传真:010-50388828
本基金的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33号东方汇经大厦5层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路18号8楼-嘉定大厦7层
法定代表人:黎玉明
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:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号时代金融中心19楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000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:021-3158666

传真:021-3158600
联系人:吕红

五、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:北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层01-12层
办公地址:北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层01-12层
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58133000
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

本基金的投资范围具有良好的流动性的金融工具,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。

本基金投资于债券,包括银行票据、金融债、企业债、地方政府债、短期融资券、资产支持证券、可转债,可分离交易可转债所派发的权证,持有股票所派发的权证和因投资可分离交易证券所派生的权证。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的例合计不低于40%。本基金所指信用债券是不含政策性金融债(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、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,非国家信用的信用类金融工具。

在投资组合构建后,本基金保留的现金(不包括结算准备金、保证金、应收申购款等)或者投资到期日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本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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有关方面,包括宏观经济趋势、利率走势、债券收益率、市场情绪等四个方面。本基金将通过对上述四项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,非常负面并有量化的评分相对应。

本基金将基于量化评分得到资产配置总评分并据此调整固定收益类资产的投资比例。

2. 固定收益类资产投资策略

(1) 利率策略

① 久期管理策略

由于长期预期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走势和利率走势的判断,对固定收益类资产组合的久期进行久期管理。本基金还通过市场上不同期限品种交易的走势来分析固定收益类资产在期限上的投资偏好,并结合对利率走势的判断选择适久期的债券品种进行投资。

(2) 收益率曲线策略

在确定投资组合后,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、哑铃型或期限策略,以获取因收益率曲线形状所变来的投资收益。

③ 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对平坦时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券并以收益率水平相对于持有期限的债券,随着剩余期限的缩短,债券收益率水平将

会较投资初期有所下降,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的资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于长期国债的收益率,息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购利率和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。

(3) 可转债投资策略

本基金将结合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。本基金基于对利率走势、到期收益

率、可转债条款、发行人的情况、行业地位、财务状况、规模水平和

信用水平等因素,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。

(4) 股权资产投资策略

本基金将通过承担适度风险来获取较高的收益,所以在信用债券

的选取时侧重于风险和信用的评估和把控。本基金将根据对宏观经济走势和信用风

险历史情况、判断当前信用债券整体的信用风险水平,从而确定信用债券投资比例。本基金根据信用债券发行人的行业背景、行业地位、财务状况、规模水平和

信用水平等因素,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。

(5) 可转债投资策略

本基金将结合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。本基金基于对利率走势、到期收益

率、可转债条款、发行人的情况、行业地位、财务状况、规模水平和

信用水平等因素,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。

(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五名债券投资明细

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资产支持证券投

资明细

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贵金属投资明

细

9. 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

10. 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资产支持证券

投资明细

11. 本期国债

12. 其他资产

13. 合计

占基金资产净值比例(%)

占基金资产净值比例(%)