

中欧基金管理有限公司中欧瑾泉灵活配置混合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:中信银行股份有限公司
二零一五年十月

本基金经2015年2月16日中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]282号文)准予募集注册。本基金合同于2015年3月16日正式生效。

重要提示

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,但中国证监会不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保证。

投资有风险,投资人认购(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,自行做出投资决策,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,降低单只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。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易量不足而不能迅速、低成本地转为现金的流动性风险,以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险,可能影响基金资产变现能力,造成本基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则,审慎参与中小企业私募债券的投资,严格控制中小企业私募债券的投资风险。

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

投资人购买本基金并不等于将资金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,投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各项风险,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、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有的风险等。

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。基金的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人注意基金投资的“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,由投资人自行负担。

本招募说明书所载内容截止日为2015年9月15日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计)。

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:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

3.办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路66号东亚银行金融大厦8层

4.法定代表人:窦玉明

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.存续期限: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:1.88亿元人民币

15.股权结构:

意大利意联银行股份合作公司(简称 UBI)出资6,580万元人民币,占公司注册资本的35%;

国都证券股份有限公司出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;

北京百骏投资有限公司出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;

上海腾亿投资管理合伙企业(有限合伙)出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;

万基业投资有限公司出资940万元人民币,占公司注册资本的5%;

上述五个股东共出资18,800万元人民币。

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,民航投资管理有限公司董事。曾担任君安证券有限公司、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,联合信贷银行(Unicredit)米兰总部客户服务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人,联合信贷银行东京分行资金部经理,意大利意联银行股份合作公司(UBI)机构银行事业部总监,并在Credito Italiano(意大利信贷银行)圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏先生,中国籍,现任中欧基金管理有限公司董事,国都证券股份有限公司投资银行总部董事局,投资银行业务内核小组副组长,兼任国都瑞信投资有限公司副总经理。曾任职工于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司、大连铂荣工程技术有限公司,国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、计划财务部总经理,中欧基金管理有限公司董事。

朱鹏先生,中国籍,现任中欧基金管理有限公司董事局,国都证券股份有限公司监事,上海万国证券公司监事长,国都证券股份有限公司监事长,兼任国都瑞信投资有限公司副总经理。曾任职工于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司、大连铂荣工程技术有限公司,国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、计划财务部总经理,中欧基金管理有限公司董事。

David Youngson先生,英国籍。现任IPM(亚洲)有限公司公司创办者及合伙人,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/副经理,中欧基金管理有限公司独立董事。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。

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,国都证券有限责任公司副总监、总经理助理,中欧基金管理有限公司董事长。

朱鹏先生,中国籍,现任中欧基金管理有限公司监事,上海财经大学证券期货系学士,13年以上证券及基金从业经验。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李群女士,中欧基金管理有限公司客户服务总监,中国籍。历任大通证券上海番禺营业部系统管理员,大通证券上海番禺营业部客户服务部主管。

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,14年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司销售经理,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。

黄桦先生,中欧基金管理有限公司督察长,中国籍。复旦大学经济学硕士,25年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司金融市场交易员,上海万国证券公司部门经理助理、部门经理,申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理,光大证券有限责任公司助理总经理,光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监,信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监,中欧基金管理有限公司分管营运部副总经理。

4.本公司高级管理人员

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。

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,事业部负责人,中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士,10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,中欧基金管理有限责任公司研究员,中欧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,14年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司销售经理,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。

黄桦先生,中欧基金管理有限公司督察长,中国籍。复旦大学经济学硕士,25年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司金融市场交易员,上海万国证券公司部门经理助理、部门经理,申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理,光大证券有限责任公司助理总经理,光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监,信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监,中欧基金管理有限公司分管营运部副总经理。

葛兰女士,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍。国西北工业大学医学工程专业博士,3年以上证券投资及基金从业经验。历任国证证券股份有限公司研究所研究员,民生加银基金管理有限公司研究员。2014年10月加入中欧

基金管理有限公司,曾任研究员,现任中欧睿新起点混合型证券投资基金基金经理(2015年1月29日起至今),中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年3月16日起至今),中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年3月31日起至今)、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年4月13日起至今)。

吴启权先生,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍。天津大学管理科学专业博土,7年以上证券及基金从业经验。历任中信建投证券股份有限公司研究发展部高级副总裁。2015年3月加入中欧基金管理有限公司,曾任基金经理助理兼研究员,现任中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理(2015年5月25日起至今),中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年5月25日起至今)、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年5月25日起至今)、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年5月25日起至今)。

孙甜女士,中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍。上海财经大学应用经济学(金融数学与金融工程)专业博士,6年以上证券及基金从业经验。历任长江养老保险股份有限公司投资经理,上海银行资产管理有限公司海通季季红、海通半年鑫、海通年年鑫投资经理。2014年8月加入中欧基金管理有限公司,曾任投资经理,现任中欧货币市场基金基金经理(2014年11月18日起至今)、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理(2014年12月1日起至今)、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理(2014年12月1日起至今)、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2014年12月15日起至今)、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2014年12月15日起至今)、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年1月18日起至今)、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年1月18日起至今)、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年1月18日起至今)。

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、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陈文俊、刁羽、曹剑、刘明刚、周玉维、赵国英、徐风控制部总监卞云霞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主任。

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.基金托管人的基本情况

名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)

住所:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦8层

法定代表人:常凯

联系人:黄静

电话:010-68609600

传真:010-68609601

客服热线:010-84183389

网址:www.zofund.com

(二)其他销售机构

1.中信银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:常凯

联系人:管志斌

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:上海市世纪中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市世纪中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

经办律师:黎明、孙睿

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人:窦玉明

联系人:杨绍信

电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:俞伟敏

经办会计师:单峰 俞伟敏

第五部分 基金的名称

中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金

第六部分 基金的类型

契约型开放式基金

第七部分 基金的投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。

第八部分 基金的投资方向

本基金的投资范围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、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票),固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转债、可交换债券、分离交易可转债、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、质押及买断式回购、银行存款及现金、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会认定的其他金融工具)。

第九部分 基金的投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类别配置、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

本基金将根据自上而下和自下而上相结合的方法进行大类

资产配置,强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋

势分析有机结合形成前瞻性的决策,综合考虑本基金的投资目

标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金的大类资

产配置比例。

(2)期限结构配置

本基金将根据利率走势、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

短期债券之间进行配置,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