

# 中欧基金管理人一年定期开放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：中国工商银行股份有限公司**  
**二〇一八年十月**

本基金经2017年1月6日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]25号文）准予募集注册。本基金基金合同于2017年3月3日正式生效。

3	中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金	2017年07月04日	
4	中欧睿泽定期开放混合型证券投资基金	2016年12月01日	
5	中欧睿泽定期开放混合型证券投资基金	2016年11月08日	2018年03月30日
6	中欧天颐稳健养老型证券投资基金	2015年12月31日	
7	中欧悦盈利分级债券型证券投资基金	2015年03月22日	
8	中欧悦盈利分级债券型证券投资基金	2015年06月26日	2018年06月17日
9	中欧悦盈利分级债券型证券投资基金	2015年06月26日	

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高级决策机构,由总经理刘建平、副总经理顾伟、副总经理策略组负责人卢纯青、信用评估部总监张勇、风险管理总监孙自刚、策略组负责人周丽文、陆文俊、刁羽、黄华、周玉雄、赵国英、曲径、曹名长、王健、王培组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主任。

6. 基金管理人高级管理人员  
 姓名：中国工商银行股份有限公司  
 注册地址：北京市西城区复兴门内大街56号  
 成立时间：1984年1月1日  
 法定代表人：易会满  
 注册资本：人民币36,640,625.71万元  
 联系电话：010-66105799  
 联系人：郭明

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33.96%,以上员工均拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况  
 作为中国工商银行服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务流程、先进的营运系统和管理的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产托管机构和广大客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券基金、银行理财、保险资管、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QDII资产、ODI资产、股权投资类资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展跨境托管,风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券基金474只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、《全球托管人》、《香港《财资》》、美国《环球金融》、《托管》、《上海证券报》等海内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外权威机构的广泛认可和好评。

(四) 基金托管资产内部控制制度  
 中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视加强和健全内部风险控制工作,在拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和风险控制力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来抓。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性评价,充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面肯定,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为行业化、常规化的内控工作手段。

1. 内部风险控制目标  
 保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度,强化和建立守法经营、规范运作的内部控制体系,防范和化解经营风险,确保托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2. 内部风险控制组织架构  
 中国工商银行资产托管部内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部(内控合规部、内部审计部)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核控制工作的内部控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律法规,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3. 内部风险控制原则  
 (1) 合法性原则。内部控制制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。  
 (2) 客观性原则。托管业务经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。  
 (3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。  
 (5) 有效性原则。内部控制制度应根据国家政策法规及监管管理的要求适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内部控制的责任,评价部门必须独立于内部控制的制定和执行部门。

4. 内部风险控制措施  
 (1) 严格隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立清晰的岗位职责、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,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务隔离和管理独立,网络独立。  
 (2) 人员检查。管理层与员工签订高级管理责任书,作为独立资产策略的制定者和管理者,要求与高级管理目标及时报告经营业绩情况和特别风险,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查结果提出内部控制措施,督促内部控制部门改进。  
 (3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,实行“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道防线机制,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育风险精神和集体荣誉感,并通过内控培训、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制意识。  
 (4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方式开展各项业务营销活动,处理各项事务,从而对风险控制机制落实贯穿,达到资源利用和效益最大化目的。  
 (5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险控制、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。  
 (6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据备份和真实加密、数据传输线路的加密、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。  
 (7) 应急准备和响应。资产托管业务建立了完备的灾难恢复中心,制定了详细的业务连续性计划,包括应急预案及处置流程,并定期组织开展应急演练,提高灾难恢复能力。同时,通过建立完善的数据备份策略,保障数据的安全。资产托管部通过定期和不定期开展应急演练,提升灾难恢复能力,业务恢复时间力争不超过合理上限。  
 (8) 业务连续性保障。资产托管部建立了完善的应急响应机制,通过建立业务连续性计划,包括:岗位职责、业务操作过程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。  
 (9) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一系统、高效的防范风险和内部控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况也不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,规范风险防范和控制是托管业务生存发展的生命。  
 (10) 基金托管人对基金管理人运作基金业务的方法与程序,根据《基金法》、基金合同、托管协议及有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象,基金投融资比例,基金的投资禁止行为,基金参与银行间债券市场、基金资产净值计算,基金份额申购赎回、应收款项清理、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和复核,其中对基金的投资比例、监督和核查自基金合同生效之日起后六个月开始。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及有关基金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确认。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。基金管理人拒不履行通知的违规事项未在限期内纠正的,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。

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号东方汇经大厦  
 法定代表人:裘玉明  
 联系人:袁彬  
 电话:021-68609602  
 传真:021-68609601

(2018年第2号)  
 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  
 (1)名称:中国工商银行股份有限公司  
 住所:北京市西城区复兴门内大街56号  
 办公地址:北京市西城区复兴门内大街56号  
 法定代表人:易会满  
 客服热线:95588  
 网址:www.icbc.com.cn  
 (2)名称:国都证券股份有限公司  
 住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦10层  
 办公地址:北京市东城区东直门南大街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.guodu.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。

二、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号东方汇经大厦  
 办公地址:上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦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:021-31358660  
 传真:021-31358606  
 联系人:陆奇  
 四、基金资产的会计师事务所  
 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
 办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼  
 执行事务合伙人:李丹  
 负责人:朱建弟  
 联系电话:021-23231899  
 联系人:俞俊佳  
 经办注册会计师:许康玮、俞俊佳

中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金  
 第三部分 基金类型  
 契约型 开放式

第六部分 基金的投资目标  
 在严格控制投资风险的前提下,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发行的股票)、国债、地方政府债、金融债、企业债、可转债、次级债、中小企业私募债,可转换债券,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、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、国债期货、股指期货、现金以及经中国证监会允许并批准其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:  
 本基金投资于股票的比例不高于基金资产的30%。在开放期,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金(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国债投资不低于基金资产净值的5%,在封闭期,本基金不受前述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。  
 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略  
 1. 固定收益投资策略  
 本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资,根据基本价值评估、经济环境和市场流动性预期未来市场利率水平以及利率曲线形变确定债券组合的久期配置,在确定组合久期基础上进行组合期限配置和财务的调配。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析,“自上而下”在各类债券资产类别之间进行资产配置,“自下而上”进行个券选择。在市场收益率及各个券种收益率变化过程中,灵活运用骑乘策略、息差策略、利差策略等增强组合收益。  
 2. 资产支持证券投资策略  
 本基金管理人将对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、担保情况、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。  
 3. 中小企业私募债投资策略  
 与传统的信用债相比,中小企业私募债由于以非公开方式进行发行,普遍具有高风险和高收益的特征。本基金将采用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用资质进行深度剖析,选择风险与收益相匹配的优质品种进行投资。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、治理结构等基本面信息,分析企业的长期发展前景;②利用财务评价体系对债券发行人的资产质量、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,评估发行人财务风险;③利用历史数据、市场价格以及资产负债率等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;④考察债券发行人的偿债保障措施,如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有价证券安排等;⑤综合上述分析结论,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值品种进行投资。  
 4. 股票投资策略  
 本基金的首选股票资产由公司研发团队负责建设和维护。研发团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等,预先上市公司未来盈利前景,并据此选择业绩优秀个股投资标的。  
 在备选股票库的基础上,本基金将通过上市公司净资产收益率等财务指标和净资产、市盈率等估值指标以及市盈率增长率等指标,以兼顾成长和长期增长能力为股票估值水平。同时,本基金将根据公司研发团队的研究成果,对个股基本情况进行定性分析,选择具有确定性成长特征个股进行投资。  
 5. 股指期货投资策略  
 本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股指期货合约的交易成本。本基金力争通过动态调整股指期货合约的数量,以萃取相应投资组合的超额收益。  
 6. 国债期货投资策略  
 国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将根据相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析,构建宏观分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度内保障基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。  
 7. 股票期权投资策略  
 本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将充分对证券市场的预判,并结合股指期货定价模型,选择价值合理的期权合约。  
 基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权投资事项的审批和执行,以防範违规操作的风险。  
 8. 权证投资策略  
 本基金将权证投资作为控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对其标的资产的基本面研究选择未来走势判断,估值权合理价值,同时充分考量权证自身的流动性,谨慎进行投资。  
 第九部分 基金业绩比较基准  
 本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%。  
 沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制,具有代表性的债券市场指数,其选择债券品种类别覆盖全面,期限结构广泛,选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。  
 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。根据本基金的投资范围和资产配置比例,选用上述业绩比较基准客观、合理地反映本基金的风险收益特征。  
 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管理人同意,并报中国证监会备案,无需召开基金份额持有人大会。基金托管人应在调整实施前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。

第十一部分 基金的投资报告  
 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。  
 基金托管人根据基金合同规定,复核了本报告组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
 本报告组合报告所载数据取自本基金2018年第2季度报告,所载数据期间为2018年6月30日,报告中列明数据未经审计。  
 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	3,311,196.36	1.86
2	基金投资	3,311,196.36	1.86

3	固定收益投资	161,589,510.40	90.75
	其中:债券	161,589,510.40	90.75
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	3,700,000.00	2.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	1,437,682.04	0.81
9	其他资产	8,015,463.41	4.50
10	合计	176,063,852.11	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合  
 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,298,564.09	1.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	900,280.16	1.06
I	信息技术、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	1,022,251.11	1.09
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	服务业、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	3,311,196.36	3.53

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
 本基金本报告期末未持有港股通股票  
 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

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	601888	中国国旅	15,871	1,022,251.11	1.09
2	600754	东方航空	26,796	960,380.16	1.06
3	600309	振华重工	17,900	813,018.00	0.87
4	600196	复星医药	11,731	485,546.09	0.52

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
 4.1 国债期货投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-
2	金融债券	-	-
3	企业债	-	-
4	金融中期票据	166,581,510.40	167.04
5	金融短期融资券	5,008,000.00	5.24
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	161,589,510.40	172.28

5. 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投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140306	14国债06	80,000	7,983,200.00	8.52
2	112196	13苏宁债	70,000	7,066,000.00	7.54
3	136180	16国债01	70,000	6,959,800.00	7.40
4	112077	14年国债	60,000	6,048,600.00	6.45
5	122330	13年国债	60,000	5,996,200.00	6.40

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  
 1. 报告期末本基金投资的股指期货合约和损益说明  
 本基金本报告期末未投资股指期货。  
 2. 本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股指期货合约的交易成本。  
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
 1. 本期国债期货投资政策  
 国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将根据相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析,构建宏观分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度内保障基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。  
 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  
 本基金股指期货投资以套期保值为目的,以回避市场风险。股指期货合约头寸的公允价值主要与投资组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态调整国债期货合约的数量,以萃取相应投资组合的超额收益。  
 11. 投资组合报告附注  
 11.1 本基金投资的12中泰债(112070.SZ)发行主体新疆中泰化学股份有限公司以真实方式收到国家发改委和证监会《行政处罚决定书》,处罚金额为人民币1107.111万元。因新疆中泰公司在2016年销售协议之诈骗行为(以下简称“PVC”)过程中,存在达成并实施价格垄断协议的事实事实,同时考虑到新疆中泰公司在调查过程中积极配合,如实供述其犯罪事实,依据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条第一款,第四十九条的规定,本机关对新疆中泰公司作出以下决定:(一)责令新疆中泰化学股份有限公司立即停止上述违法行为;(二)对新疆中泰化学股份有限公司处以2016年度市场占有率销售总额一百一十二万四千五百元百分之二即罚款,计二千一百一十四万五千元。在上述公告公布后,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对12中泰债(112070.SZ)的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司投资的判断未发生主要变化。第九名投资发行主体报告期内未被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
 11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。  
 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,650.02
2	应收证券清算款	4,904,013.31
4	应收利息	2,987,528.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,015,463.41

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受争议情况的说明  
 11.6 投资组合报告期末持有的其他资产描述部分  
 本基金因合同持有人原因,投资组合报告中总资产中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2017年3月3日,基金业绩截止日2018年6月30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

阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017/3/31-2017/12/31	4.22%	0.14%	-0.50%	0.09%	5.40%	0.06%
2018/1/1-2018/6/30	2.15%	0.14%	0.62%	0.13%	1.53%	0.01%
2017/3/31-2018/6/30	7.07%	0.14%	0.04%	0.10%	7.02%	0.04%

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



注:本基金基金合同生效日期为2017年3月3日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

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、诉讼费及仲裁费;

6. 基金份额持有人大会费用;  
 7. 基金的证券/期货交易费用;  
 8. 基金的银行汇划费用;  
 9. 基金的相关账户的开户及维护费用;  
 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  
 2. 基金托管人的托管费  
 3. 基金的销售服务费  
 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下:  
 $H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$   
 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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。  
 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
 $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$   
 H为每日应计提的基金托管费  
 E为前一日的基础基金托管费  
 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。固定支付的销售服务费由基金管理人代扣,基金管理人收到扣款相关凭证后按规定支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。  
 上述“一、基金费用的种类”中第4-10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;  
 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、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于2018年4月刊登的中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:  
 (一) 更新了“第九部分 基金管理人”中的相关内容。