# 中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 中欧天添债券 | |
| 基金主代码 | 002478 | |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年04月01日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 64,577,041.40份 | |
| 投资目标 | 本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超额收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将采取久期偏离、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。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。 | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧天添债券A | 中欧天添债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002478 | 002479 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 27,991,537.22份 | 36,585,504.18份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日) | |
|---|---|---|
| | 中欧天添债券A | 中欧天添债券C |
| 1.本期已实现收益 | -607,046.76 | -827,376.97 |
| 2.本期利润 | -272,418.13 | -394,616.35 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0097 | -0.0108 |
| 4.期末基金资产净值 | 28,817,354.89 | 37,231,434.67 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.030 | 1.018 |

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

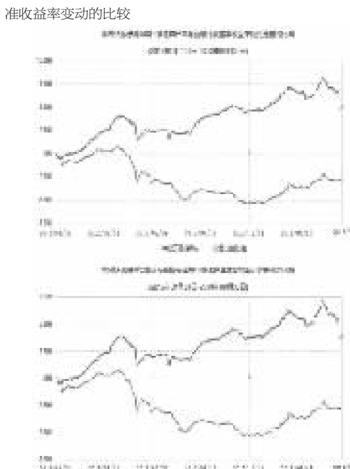
中欧天添债券A净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.87% | 0.25% | 0.57% | 0.07% | -1.44% | 0.18% |

中欧天添债券C净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.97% | 0.24% | 0.57% | 0.07% | -1.54% | 0.17% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王家柱 | 基金经理 | 2017-05-04 | - | 5年 | 历任工银瑞信基金管理有限公司信用评级研究员。2016-12-05加入中欧基金管理有限公司,历任基金经理助理 |

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

流动性货币政策方面,7月份中美贸易摩擦升级,叠加上半年社融数据超预期加速下滑,经济可能面临失速压力。国常会提出的维持流动性合理宽裕的政策在三季度得以落地:央行货币政策进一步宽松,实施了MLF的超额投放并实施了降准;理财新规等表外业务也比征求意见稿有所宽松。三季度基本确定了货币和信用双宽松的格局,新增社融数据和人民币贷款数据有所回升。但是从货币政策向信用的传导需要时滞,社融和贷款数据结构依然较差,流动性紧张导致的实体经济尤其是民营实体经济流动性紧张依然挥之不去。

宏观经济方面,2018年以来中国经济受累于内忧外患的双重冲击,三季度尤其面临一定压力。7月份中美贸易摩擦升级,出口作为2017年拉动经济改善的重要边际因素遭遇较大不确定性。投资和消费增速均出现下行:其中基建投资延续之前受制于资金来源和项目政策收紧保持低位的状态;地产投资作为2017年拉动经济的重要因素在三季度也面临拐点压力;制造业投资保持低位且分化进一步加剧,下游企业和民营企业的利润不及预期为后续制造业投资带来不确定性。通胀担忧在三季度有所抬头,猪肉价格经历了2年的下行周期后低位回升。

利率方面,三季度出现了一个小幅调整。主要原因是:1,受累于宏观调控政策转向,宽信用预期增强,对利率偏空。2,地方政府专项债供给持续放量,供给压力凸显;3,通胀上行担忧。期限利差上出现较为明显陡峭化,三季度以来,短端收益率大幅下行,但是长债收益率有所上行,陡峭化特征明显。

信用债方面,六月底的国常会精神落地后,信用市场出现了年内最为显著的一波牛市。但是三季度违约事件密集爆发,市场的偏好集中于短久期高等级的信用债上。三季度信用风险形势依然不容乐观,新增违约主体9家,其中民营企业7家。受累于融资渠道不畅,民营企业在之前去杠杆的环境下出现再融资困难的情况。尤其是前些年进行了高杠杆对外投资或者建设产能的企业面临较大的还款压力。非民企的两家分别是农六师和美兰机场打破了市场的"信仰",影响深远。

操作上,本基金三季度卖出长端利率债,兑现前期收益。继续集中于短久期高等级债券,利用一年内收益率曲线较为陡峭较高的时间窗口获取套息收益,进步一加强对持仓发债主体的跟踪力度,清仓部分还款压力较大的低等级民营企业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值增长率为-0.87%,同期业绩比较基准收益率为0.57%;C类份额净值增长率为-0.97%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 113,715,892.57 | 95.13 |
| | 其中:债券 | 113,715,892.57 | 95.13 |
| | 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 | 2,647,851.71 | 2.22 |
| 8 | 其他资产 | 3,177,213.66 | 2.66 |
| 9 | 合计 | 119,540,957.94 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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股票。

5.3 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。

5.4 报告期末按债券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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,025,500.00 | 7.61 |
| | 其中:政策性金融债 | 5,025,500.00 | 7.61 |
| 4 | 企业债券 | 106,423,641.47 | 161.13 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 2,266,751.10 | 3.43 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 113,715,892.57 | 172.17 |

5.5 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 | 112358 | 16BOE01 | 60,000 | 5,980,800.00 | 9.06 |
| 2 | 122276 | 13魏桥01 | 55,000 | 5,506,050.00 | 8.34 |
| 3 | 018006 | 国开1702 | 50,000 | 5,025,500.00 | 7.61 |
| 4 | 112653 | 18恒逸R1 | 50,000 | 5,025,000.00 | 7.61 |
| 5 | 122370 | 14华远债 | 50,000 | 4,999,500.00 | 7.57 |

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,052.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,042,440.08 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,131,720.81 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,177,213.66 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 2,167,200.00 | 3.28 |
| 2 | 128017 | 金禾转债 | 99,551.10 | 0.15 |

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 中欧天添债券A | 中欧天添债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 27,991,537.22 | 36,585,504.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 27,991,537.22 | 36,585,504.18 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额、总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2018年10月24日

# 中欧天启18个月定期开放债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 中欧天启债券 | |
| 基金主代码 | 004159 | |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年01月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 8,869,601.22份 | |
| 投资目标 | 本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超额收益。 | |
| 投资策略 | 封闭期内,本基金管理人将根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态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形态的调整。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类属配置,"自下而上"进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中,灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。<br>开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种减小基金净值的波动。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。 | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧天启债券A | 中欧天启债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004159 | 004160 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,564,558.93份 | 305,042.29份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日) | |
|---|---|---|
| | 中欧天启债券A | 中欧天启债券C |
| 1.本期已实现收益 | -52,573.96 | 4,071.64 |
| 2.本期利润 | 324,225.11 | 3,546.08 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0044 | 0.0096 |
| 4.期末基金资产净值 | 9,045,861.78 | 319,962.58 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0562 | 1.0489 |

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

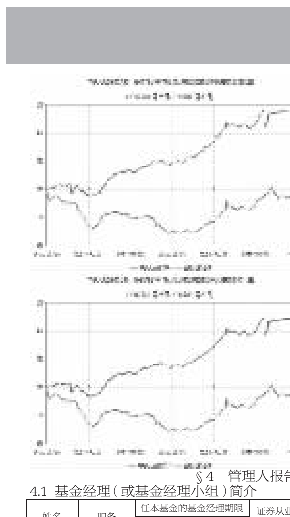
中欧天启债券A净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.87% | 0.17% | 0.57% | 0.07% | 0.30% | 0.10% |

中欧天启债券C净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.82% | 0.17% | 0.57% | 0.07% | 0.25% | 0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王家柱 | 基金经理 | 2017-05-04 | - | 5年 | 历任工银瑞信基金管理有限公司信用评级研究员。2016-12-05加入中欧基金管理有限公司,历任基金经理助理 |

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

流动性货币政策方面,7月份中美贸易摩擦升级,叠加上半年社融数据超预期加速下滑,经济可能面临失速压力。国常会提出的维持流动性合理宽裕的政策在三季度得以落地:央行货币政策进一步宽松,实施了MLF的超额投放并实施了降准;理财新规等表外业务也比征求意见稿有所宽松。三季度基本确定了货币和信用双宽松的格局,新增社融数据和人民币贷款数据有所回升。但是从货币政策向信用的传导需要时滞,社融和贷款数据结构依然较差,流动性紧张导致的实体经济尤其是民营实体经济流动性紧张依然挥之不去。

宏观经济方面,2018年以来中国经济受累于内忧外患的双重冲击,三季度尤其面临一定压力。7月份中美贸易摩擦升级,出口作为2017年拉动经济改善的重要边际因素遭遇较大不确定性。投资和消费增速均出现下行:其中基建投资延续之前受制于资金来源和项目政策收紧保持低位的状态;地产投资作为2017年拉动经济的重要因素在三季度也面临拐点压力;制造业投资保持低位且分化进一步加剧,下游企业和民营企业的利润不及预期为后续制造业投资带来不确定性。通胀担忧在三季度有所抬头,猪肉价格经历了2年的下行周期后低位回升。

利率方面,三季度出现了一个小幅调整。主要原因是:1,受累于宏观调控政策转向,宽信用预期增强,对利率偏空。2,地方政府专项债供给持续放量,供给压力凸显;3,通胀上行担忧。期限利差上出现较为明显陡峭化,三季度以来,短端收益率大幅下行,但是长债收益率有所上行,陡峭化特征明显。

信用债方面,六月底的国常会精神落地后,信用市场出现了年内最为显著的一波牛市。但是三季度违约事件密集爆发,市场的偏好集中于短久期高等级的信用债上。三季度信用风险形势依然不容乐观,新增违约主体9家,其中民营企业7家。受累于融资渠道不畅,民营企业在之前去杠杆的环境下出现再融资困难的情况。尤其是前些年进行了高杠杆对外投资或者建设产能的企业面临较大的还款压力。非民企的两家分别是农六师和美兰机场打破了市场的"信仰",影响深远。

由于产品进入清盘期,三季度本基金积极清仓债券以应对清盘,无其他操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值增长率为0.87%,同期业绩比较基准收益率为0.57%;C类份额净值增长率为0.82%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 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 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 9,363,951.56 | 99.98 |
| 8 | 其他资产 | 1,872.80 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 9,365,824.36 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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股票。

5.3 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。

5.4 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。

5.5 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券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,872.80 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,872.80 |

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 中欧天启债券A | 中欧天启债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 221,051,546.32 | 472,206.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,753,937.71 | 1,922.34 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 217,240,925.10 | 169,086.47 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 8,564,558.93 | 305,042.29 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额、总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | 中欧天启债券A | 中欧天启债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 4,753,937.71 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,753,937.71 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 55.51 | - |

注:买入/申购总份额含红利再投、转换入份额,卖出/赎回总份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申赎 | 2018-08-02 | 4,753,937.71 | 5,009,224.17 | - |
| 合计 | | | 4,753,937.71 | 5,009,224.17 | |

注:本基金管理人运用固有资金申赎(包含转换)本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定,上表所列交易的适用费率为固定费用1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018年8月2日至2018年9月30日 | - | 4,753,937.71 | - | 4,753,937.71 | 53.60% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,并在基金运作中对流动性进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。 | | | | | | | |

注:申购份额含红利再投份额、转换入份额,赎回份额含转换出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》和本基金《基金合同》的有关规定,在任一开放期的最后一日日终,如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会,本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止:(1)基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额 扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元。(2)基金份额持有人人数少于200人。 法律法规或监督部门另有规定时,从其规定。鉴于本基金触发了基金合同终止事由,本基金最后运作日定为2018年8月7日,并于2018年8月8日进入清算程序,停止办理申购、赎回等业务,并且之后不再恢复。本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费。投资者可以登陆中欧基金管理有限公司网站(www.zofund.com)或拨打中欧基金管理有限公司全国统一客户服务号码4007009700咨询相关情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧天启18个月定期开放债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧天启18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧天启18个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧天启18个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2018年10月24日

# 中欧天尚18个月定期开放债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 中欧天尚债券 | |
| 基金主代码 | 004295 | |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年03月08日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 7,491,533.87份 | |
| 投资目标 | 本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超额收益。 | |
| 投资策略 | 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内,本基金管理人将根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态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形态的调整。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类属配置,"自下而上"进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中,灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。 | |
| 基金管理人 | 中欧基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中欧天尚债券A | 中欧天尚债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004295 | 004296 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,975,758.34份 | 2,515,775.53份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日) | |
|---|---|---|
| | 中欧天尚债券A | 中欧天尚债券C |
| 1.本期已实现收益 | -3,291,456.47 | -1,855,983.72 |
| 2.本期利润 | -1,787,021.64 | -1,010,793.06 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0156 | -0.0142 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,552,905.30 | 1,783,655.72 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7140 | 0.7090 |

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

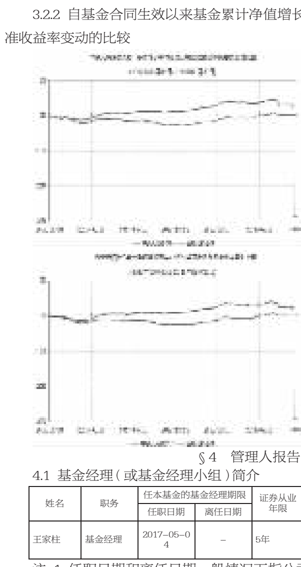
中欧天尚债券A净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -31.00% | 3.73% | 0.57% | 0.07% | -31.57% | 3.66% |

中欧天尚债券C净值表现

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -31.08% | 3.73% | 0.57% | 0.07% | -31.65% | 3.66% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王家柱 | 基金经理 | 2017-05-04 | - | 5年 | 历任工银瑞信基金管理有限公司信用评级研究员。2016-12-05加入中欧基金管理有限公司,历任基金经理助理 |

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

流动性货币政策方面,7月份中美贸易摩擦升级,叠加上半年社融数据超预期加速下滑,经济可能面临失速压力。国常会提出的维持流动性合理宽裕的政策在三季度得以落地:央行货币政策进一步宽松,实施了MLF的超额投放并实施了降准;理财新规等表外业务也比征求意见稿有所宽松。三季度基本确定了货币和信用双宽松的格局,新增社融数据和人民币贷款数据有所回升。但是从货币政策向信用的传导需要时滞,社融和贷款数据结构依然较差,流动性紧张导致的实体经济尤其是民营实体经济流动性紧张依然挥之不去。

宏观经济方面,2018年以来中国经济受累于内忧外患的双重冲击,三季度尤其面临一定压力。7月份中美贸易摩擦升级,出口作为2017年拉动经济改善的重要边际因素遭遇较大不确定性。投资和消费增速均出现下行:其中基建投资延续之前受制于资金来源和项目政策收紧保持低位的状态;地产投资作为2017年拉动经济的重要因素在三季度也面临拐点压力;制造业投资保持低位且分化进一步加剧,下游企业和民营企业的利润不及预期为后续制造业投资带来不确定性。通胀担忧在三季度有所抬头,猪肉价格经历了2年的下行周期后低位回升。

利率方面,三季度出现了一个小幅调整。主要原因是:1,受累于宏观调控政策转向,宽信用预期增强,对利率偏空。2,地方政府专项债供给持续放量,供给压力凸显;3,通胀上行担忧。期限利差上出现较为明显陡峭化,三季度以来,短端收益率大幅下行,但是长债收益率有所上行,陡峭化特征明显。

信用债方面,六月底的国常会精神落地后,信用市场出现了年内最为显著的一波牛市。但是三季度违约事件密集爆发,市场的偏好集中于短久期高等级的信用债上。三季度信用风险形势依然不容乐观,新增违约主体9家,其中民营企业7家。受累于融资渠道不畅,民营企业在之前去杠杆的环境下出现再融资困难的情况。尤其是前些年进行了高杠杆对外投资或者建设产能的企业面临较大的还款压力。非民企的两家分别是农六师和美兰机场打破了市场的"信仰",影响深远。

由于产品进入清盘期,三季度本基金积极清仓债券以应对清盘,无其他操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级份额净值增长率为-31.00%,同期业绩比较基准收益率为0.57%;C类份额净值增长率为-31.08%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 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 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 5,583,908.46 | 99.63 |
| 8 | 其他资产 | 20,721.19 | 0.37 |
| 9 | 合计 | 5,604,629.65 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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股票。

5.3 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。

5.4 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。

5.5 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券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 18,707.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,013.36 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 20,721.19 |

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 中欧天尚债券A | 中欧天尚债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 138,986,533.04 | 86,080,018.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,835,090.43 | 2,044,989.78 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 138,845,865.13 | 85,609,232.82 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 4,975,758.34 | 2,515,775.53 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | 中欧天尚债券A | 中欧天尚债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 4,835,090.43 | 2,044,989.78 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,835,090.43 | 2,044,989.78 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 97.17 | 81.29 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申赎 | 2018-09-11 | 4,835,090.43 | 5,000,000.00 | 0.0150 |
| 2 | 申赎 | 2018-09-11 | 2,044,989.78 | 2,100,000.00 | - |
| 合计 | | | 6,880,080.21 | 7,100,000.00 | |

注:本基金管理人本报告期内于本报告期内通过中欧基金管理有限公司直销机构申购本基金,适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018年09月17日-2018年9月30日 | - | 6,880,080.21 | 0.00 | 6,880,080.21 | 91.84% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,并在基金运作中对流动性进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》和本基金《基金合同》的有关规定,在任一开放期的最后一日日终,如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会,本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止:(1)基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元。(2)基金份额持有人人数少于 200 人。法律法规或监督部门另有规定时,从其规定。鉴于本基金触发了基金合同终止事由,本基金的最后运作日为2018年9月18日,并于2018年9月19日进入清算程序。停止办理申购、赎回等业务,并且之后不再恢复。本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费。投资者可以登陆中欧基金管理有限公司网站(www.zofund.com)或拨打中欧基金管理有限公司全国统一客户服务号码4007009700咨询相关情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧天尚18个月定期开放债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧天尚18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧天尚18个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧天尚18个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2018年10月24日