中欧基金管理有限公司中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书

(2019年第2号)

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
二零一九年十二月

基金经2019年1月28日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]142文)准予募集注册。

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者保证。

投资有风险,投资人在认购(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,自主做出投资决策,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,降低投资单一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的产品。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款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、基金产品资料概要等基金法律文件,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。投资人在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,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、封闭期无法赎回和开放期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、场内基金折价交易风险、本基金特有的风险等。

基金资产投资于港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”),会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股,存在不对港股进行投资的可能。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金每2年开放一次,每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。每个开放期的首日为基金合同生效日的每2年年度对日。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,本基金的A类基金份额可在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下上市交易,本基金的C类基金份额不上市交易。开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准,且基金管理人最迟应于开放期开始前2日进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起,继续计算该开放期时间,直到满足开放期的时间要求。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

本基金本次更新招募说明书摘要仅根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订,更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

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:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层

3、办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层、上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7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:2.20亿元人民币

15、股权结构:

序号	股东名称	出资额(人民币万元)	出资比例
1	Unione di Banche Italiane S.p.A.	5,500	25.0000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	北京百骏投资有限公司	4,400	20.0000%
4	上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	窦玉明	1,100	5.00000%
6	万盛基业投资有限责任公司	726	3.3000%
7	周玉雄	328.35	1.4925%
8	卢纯青	163.8340	0.7447%
9	于洁	163.8340	0.7447%
10	赵国英	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞玺云	92.4660	0.4203%
14	魏博	87.7580	0.3989%
15	郑苏丹	87.7580	0.3989%
16	曲径	87.7580	0.3989%
17	黎忆海	64.3720	0.2926%
合计		22,000	100%

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,上海盛立基金会理事会理事,国寿投资控股有限公司独立董事,天合光能股份有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、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)米兰总部客户业务部客户关系管理、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)机构银行业务部总监,并曾在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。

朱鹏举先生,中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司,国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生,北京大学法学学士、法学硕士,美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士,中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学教师,中国证券监督管理委员会基金监管部副处长,上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson先生,英国籍。现任IFM(亚洲)有限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、副总监,赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭勇先生,中国籍。现任北京大学法学院教授、博士生导师,中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士、应用经济学博士后,德国洪堡学者,中国银行法学研究会副会长。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等,毕业于北京大学、美国南美以美大学、哈佛大学法学院。

戴国强先生,中国籍。上海财经大学金融专业硕士,复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事、贵阳银行股份有限公司独立董事、荣威国际集团股份有限公司独立董事、中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事、交银国际信托有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记,上海财经大学MBA学院院长兼书记,上海财经大学商学院书记兼副院长。

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,国都证券股份有限公司副总经理、总经理,中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生,监事,上海源泰律师事务所合伙人,中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问,广东钧天律师事务所合伙人,美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师,北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士,监事,现任中欧基金管理有限公司交易总监,中国籍,上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士,中欧基金管理有限公司监事,现任中欧基金管理有限公司理财规划总监,中国籍,同济大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员,大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3、基金管理人高级管理人员

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。

顾伟先生,中欧基金管理有限公司分管投资副总经理,中国籍。上海财经大学金融学硕士,17年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管,平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

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、策略组负责人,中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士,13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,中信基金管理有限责任公司研究员,银华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,17年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理,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。

卞玺云女士,中欧基金管理有限公司督察长,中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士,11年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理,银华基金管理有限公司投资管理部副总监,中欧基金管理有限公司风控总监。

4、本基金基金经理

姓名	周应波	性别	男	
国籍	中国	毕业院校及专业	北京大学控制理论与控制工程专业	
其他公司历任	平安证券有限责任公司研究员(2010.02-2011.08)、华夏基金管理有限公司研究员(2011.08-2014.10)			
本公司历任	研究员、投资经理助理、投资经理			
本公司现任	基金经理			
本基金经理所管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期	
1	中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金	2015年11月03日		
2	中欧明睿新常态混合型证券投资基金	2016年12月01日		
3	中欧时代智慧混合型证券投资基金	2018年01月25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最高投资决策机构,由总经理刘建平,副总经理兼策略组负责人顾伟,副总经理兼研究总监、策略组负责人卢纯青,策略组负责人周蔚文、陆文俊、周玉雄、刁羽、黄华、陈岚、赵国英、曲径、曹名长、王培、王健,信用评估部总监张明,风险管理部总监孙自刚,中央交易室总监陆正芳组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

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

(一)基金托管人基本情况

名称: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55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34,932,123.46万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2018年12月,中国工商银行资产托管部共有员工202人,平均年龄33岁,95%以上员工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

作为中国大陆托管服务的先行者,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、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、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。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、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绩效评估、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12月,中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的64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金融领域的持续认可和广泛好评。

(四)基金托管人的内部控制制度

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改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,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做。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报告。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认可,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审阅已经成为年度化、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规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证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、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、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。总行稽核监察部门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监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,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。内控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)完整性原则。托管业务的各项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,必须做到已建立相关的规章制度。

(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。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,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;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、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、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,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,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、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理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,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,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、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、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、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。

(4)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,一直将建立一个系统、高效的风险防范和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,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和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、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、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核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,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有重大违规行为,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、场内销售机构

具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)

二、场外销售机构

(一)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5层

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:窦玉明

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

(二)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 55 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人:易会满

客服热线:95588

网址:www.icbc.com.cn

2)名称:招商银行股份有限公司

住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号

办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人:李建红

客服热线:95555

公司网站:www.cmbchina.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构,并在基金管理人网站公示。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、登记机构

1、本基金A类基金份额的登记机构信息如下:

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:赵亦清

电话:010-50938782

传真:010-50938828

2、本基金C类基金份额的登记机构信息如下:

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5层

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:窦玉明

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

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、陈颖华

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:陈颖华

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:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人:毛鞍宁

电话:010-58153000

传真:010-85188298

联系人:徐艳

经办会计师:徐艳、印艳萍

第四部分 基金的名称

中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金

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

本基金在力求控制组合风险的前提下,力争为基金份额持有人创造超额收益。二、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上市的股票)、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、权证、国债期货、股指期货、股票期权等金融资产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)。

本基金可以参与融资交易。

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。

基金的投资组合比例为:

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的35%-80%(其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%)。开放期每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(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政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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)。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。

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上市的股票)、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、权证、国债期货、股指期货、股票期权等金融资产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)。

本基金可以参与融资交易。

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。

基金的投资组合比例为:

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的35%-80%(其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%)。开放期每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(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政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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)。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。

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、大类资产配置策略

根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围,采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况,以调整投资组合中的大类资产配置,从变化的市场条件中获利,并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进行前瞻性的决策。

2、股票投资策略

(1)A股投资策略

1)行业配置策略

本基金依托专业的研究力量,综合采用各类定量分析、定性分析、深度调研等方法,从宏观经济、产业周期、行业成长性、行业竞争力和估值水平等多重维度分析,包括但不限于综合考虑宏观经济环境、国家产业发展政策、行业周期、行业格局、上下游供需情况、海内外状况与趋势、技术发展趋势、社会需求、社会发展趋势等因素,力图把握较长周期内的行业轮动节奏与未来趋势,甄选那些可受益于宏观经济和行业发展方向且具有持续增长潜力的行业,并根据经济发展变化趋势,动态调整行业配置策略。

整体来看,这些行业景气度持续向上,具有综合性的比较优势和较高的投资价值,本基金重点关注这些符合宏观经济发展、社会发展需求的行业,力图为投资者获取超越各行业平均收益率的投资收益。

2)公司分析

本基金在行业分析的基础上,采用自下而上的方法精选个股,主要通过对上市公司基本面的深入研究,在注重安全边际的基础上挑选具有良好长期竞争力和增长潜力的优质公司。

具体而言,本基金将会重点关注个股的以下几个方面:

a.上市公司品质

公司管理层是公司战略的执行者,优秀的管理团队是实现企业快速而持续发展的重要保障,本基金对团队的管理能力重点考察公司治理结构、企业管理层在战略规划、内部团队管理方面的能力等方面。

成长性方面,本基金采取定性和定量的指标项结合综合判断。在定量的分析方法上,我们主要参考主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率(ROE)、毛利率等成长性指标。在对上市公司成长性的定性分析上,本基金强调企业成长能力的可持续性,重点从行业成长前景、所处产业链地位、政策扶持程度、用户消费习惯、行业竞争状况、盈利能力、财务结构等方面进行分析。

在核心竞争力方面,自主研发能力和技术创新能力是本基金重点考察的方向,具体包括:产品技术含量、技术发展前景、技术成熟程度、研究经费投入规模、配套政策支持、研究成果转化的经济效果等。同时,本基金还会关注该技术是否具有一定的竞争壁垒,是否符合未来科技创新和经济发展方向,公司在所属细分行业占有的市场份额以及未来产品线的布局规划。

b.估值水平

本基金将在组合构建时注重个股估值水平,以确定该股是否具有足够的安全边际,尽可能寻找估值合理或者低估且在各自行业中具有领先地位的优质上市公司股票作为投资标的。指标方面,将持续跟踪个股的P/E、P/S、P/CF、PEG等进行定量筛选和配置比例参考。

c.预期差

本基金将通过严密的实地调研及论证,及时把握市场上出现的有效预期差,发现被低估的股票。预期差表现在多个方面,包括公司盈利是否具备持续超预期潜力,公司团队水平、资产质量、发展规划是否被市场显著低估等。

(2)港股通标的股票投资策略

本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票,本基金主要采用“自下而上”个股研究方式,精选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度主要包括但不限于:治理结构与管理层(例如:良好的公司治理结构,优秀、诚信的公司管理层等)、行业集中度及行业地位(例如:具体备独特的核心竞争优势,如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等)、公司业绩表现(例如:业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等)。

3、债券投资策略

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。当市场收益率上行时,基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值,以回避一定的市场风险。

4、股指期货投资策略

本基金将以套期保值为目的,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,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,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,参与国债期货的投资。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。基金管理人将按照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。构建量化分析体系,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,在最大限度保证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。

6、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。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期权定价模型,选择估值合理的期权合约。

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的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

7、资产支持证券投资策略

本基金通过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、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。

8、权证投资策略

本基金的权证投资以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,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。

9、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资交易。本基金 将基于对市场行情和组合风险收益的的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的35%-80%(其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%);

(2)开放期每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金(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政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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);

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算)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(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%;

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)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%;

(13)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;

(14)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;

(15)本