

■ 2020年1月3日 星期五

(上接B072版)

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.sjzq.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。

三、登记机构

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:010-50938782

传真:010-50938282

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:俞卫峰

经办律师:黎明、陆奇

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:陆奇

五、审计基金财产的会计师事务所

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

电话:021-22328189

联系人:俞伟峰

第四部分 基金的名称

中欧鼎利债券型证券投资基金

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

在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的长期回报。

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)

、国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、地方政府债券、中期票据、短期融资券、可转债、可分离交易债券、可交换债券、同业存单、债券回购、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(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得高于基金资产净值的3%;本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在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定影响证券市场前景的相关方面,包括宏观经济趋势、利率走势、证券市场价格、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个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、非常负面等并有量化评分相对应。

本基金将通过上述四个方面的量化评分即可得到资产配置总评分并据此调整大类资产的配置比例。

2. 债券投资策略

(1) 久期投资策略

久期反映了利率变化对债券价格的敏感程度,本基金将通过对宏观经济趋势和利率走势的预判确定组合整体久期,有效的控制组合的利率风险。预期利率上升时,本基金降低组合久期;预期利率下行时,拉长组

合久期。

(2) 利率期限结构配置策略

在确定投资组合久期后,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的分析,预测未来收益率曲线形态的可能变化。一般情况下,在债券收益率曲线上变时,采取哑铃型策略组合;在债券收益率曲线变平时,采取骑乘策略组合;在预期收益率曲线不变或平行移动时,则采取梯形策略。

(3) 骑乘策略

在预期未来收益率曲线变动较为平稳时,通过分析收益率曲线各期限的利差情况,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着债券剩余期限的缩短,到期收益率将下降,基本面从而可获得资本利得收入。

(4) 息差策略

当回购利率低于债券收益率时,本基金可先买入初始资金买入国债,并用所持有的国债进行回购,回购后的资金再买入收益率高于回购利率的其他国债或金融债、企业债,并在回购期末,出售全部现券,并偿还回购融入资金。

(5) 信用策略

本基金通过对行业及个券信用评级等方法有效的控制投资的信用风险,在承担适度信用风险的基础上,挖掘收益能有效覆盖风险的投资品种来获取较高的收益,力争做到投资组合安全与收益相结合。

(6) 可转债投资策略

本基金在充分研究的基础上,选择条款有利、行业前景看好、公司基本面良好的可转债进行一级市场申购,并根据二级市场转债价格的估值水平、股性特征和债性特征等进行二级市场投资。

(7) 流动性策略

本基金还将根据个券发行总量、流通量、上市时间、交易量等流动性指标,决定该个券投资总额的上限。

3. 资产支持证券投资策略

资产支持证券是指将缺乏流动性但可预测未来现金流的资产组成资产池并以其产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金充分分析基础资产质量及未来现金流,严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资。

4. 股票投资策略

本基金将把股票类资产投资作为整体投资组合管理的辅助工具,为投资人提供适度参与股票市场的机会。

本基金将审慎选股库由公司投研团队负责建立和维护。投研团队通过分析上市公司公告信息、上市公司处行业考察、上市公司实地调研等,预测上市公司未来盈利前景,并据此申请将股票纳入备选股票库。

在备选股票库的基础上,本基金量化考察上市公司净资产收益率等财务指标和市净率、市盈率等估值指标以及市盈率增长等指标,以兼顾和平衡公司增长能力和股票估值水平。同时,本基金根据公司投研团队的研究成果,对个股基本面进行定性分析,选择具有增长潜力且估值水平相对较好的个股进行投资。

5. 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,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。

第九部分 基金的业绩比较基准

业绩比较基准:中国债券总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

中国债券总指数是由中国国债登记结算有限责任公司编制并于2001年12月31日推出的中国全市场债券指数,该指数同时覆盖了交易所和银行间两个债券市场的主要固定收益证券并以债券托管量市值为样本权重,该指数能够反映债券市场总体走势,具有较强的代表性和权威性。沪深300指数同样覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示,报中国证监会备案。

第十部分 基金的风险特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

第十一部分 基金的组合投资

基金管理人的董事会或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。

基金经理根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理根据本投资组合报告所载数据拟取自本基金2019年第1季度报告,所载数

据截至2019年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	权证投资	1,678,500,000	37.2
2	基金投资	1,678,500,000	37.2
3	固定收益投资	36,658,580,000	81.25
4	货币市场基金	36,658,580,000	81.25
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他资产	1,425,421,169	4.05
8	合计	416,116,015	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产、供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	批发和零售业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,678,500,000	37.4
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		416,116,015	100.00

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

2.3 报告期末按行业分类的境内外股票投资组合

2.4 报告期末按行业分类的其他类型股票投资组合

2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

2.6 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债券投资组合

2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及金融衍生品投资组合

2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合

2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资组合

2.11 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基金投资组合

2.12 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型基金投资组合

2.13 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混合型基金投资组合

2.14 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债券型基金投资组合

2.15 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商品基金投资组合

2.16 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货币市场基金投资组合

2.17 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权证及金融衍生品投资组合

2.18 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其他投资组合

2.19 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组合

2.20 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贵金属投资组合

2.21 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其他投资组合

2.22 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其他投资组合

2.23 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权证及金融衍生品投资组合

2.24 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其他投资组合

2.25 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组合

2.26 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贵金属投资组合

2.27 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其他投资组合

2.28 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权证及金融衍生品投资组合

2.29 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其他投资组合

2.30 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组合

2.31 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贵金属投资组合

2.32 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其他投资组合

2.33 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权证及金融衍生品投资组合

2.34 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其他投资组合

2.35 报