中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

（2015年第1号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：广发银行股份有限公司
二〇一五年一月

重要提示

本基金经2010年10月8日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准中欧增强回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1316号文）核准，进行募集。本基金基金合同于2010年12月2日正式生效。

基金管理人保证本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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。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。

投资有风险，投资人在认（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》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。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。

本摘要根据《中欧增强回报债券型证券投资基金基金合同》和《中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日2014年12月1日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日（财务数据未经审计）。

一、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：上海市浦东新区花园石桥路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. 存续期间：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%；

国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的20%；

北京百骏投资有限公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的20%；

万盛基业投资有限责任公司出资940万元人民币，占公司注册资本的5%；

窦玉明出资921.2万元人民币，占公司注册资本的4.9%；

刘建平出资921.2万元人民币，占公司注册资本的4.9%；

周蔚文出资770.8 万元人民币，占公司注册资本的4.1%；

许欣出资770.8万元人民币，占公司注册资本的4.1%；

陆文俊出资376万元人民币，占公司注册资本的2%。

上述九个股东共出资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，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，之后担任意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监。

卢树奇先生，中国社会科学院货币银行学专业研究生，中国籍。现任国都景瑞投资有限公司业务总监、中欧基金管理有限公司董事。曾任职于中国民族国际信托投资公司，中煤信托投资有限责任公司。历任国都证券有限责任公司投资部项目经理、天津营业部总经理、经纪业务总部总经理助理、证券投资部总经理助理及副总经理。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司总经理、董事。历任北京大学助教、副科长，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。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理、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。

周皓先生，美国杜克大学经济学博士，北京大学管理学硕士学位和经济学学士，美国籍。现任清华大学五道口金融学院教授、中欧基金管理有限公司独立董事。历任美国联邦储备委员会风险分析部高级经济学家，麻省理工学院斯隆管理学院和北京大学中国经济研究中心访问教授。

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经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，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。

黎忆海女士，中欧基金管理有限公司职工监事，监察稽核部总监，中国籍。南开大学会计学专业硕士。历任湖南省计算机高等专科学校教师，深圳世纪星源股份有限公司财务分析员，华富基金管理有限公司监察稽核员。

黄峰先生，中欧基金管理有限公司职工监事，总经理助理，信息技术部总监，中国籍。北京大学信息科学中心信号与信息处理专业硕士。历任中再资产管理有限公司信息技术部主管，海通证券股份有限公司项目经理，微软全球技术中心工程师。

3. 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。

周蔚文先生，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投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2011年5月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自2011年8月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，15年以上证券及基金从业经验。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自2006年11月起至2011年1月），中欧基金管理有限公司研究部总监、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自2012年3月起至2014年1月）。

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，12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。

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，23年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，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运营副总经理。

4. 本基金基金经理

（1）现任基金经理

袁争光先生，中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中国籍。上海财经大学金融学专业硕士，8年以上证券从业经验。历任上海金信证券研究所有限责任公司研究员，中原证券股份有限公司证券研究所研究员，光大保德信基金管理有限公司研究员，中欧基金管理有限公司研究员、高级研究员、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧货币市场基金基金经理助理。现任中欧基金管理有限公司中欧纯债分级债券型证券投资基金的基金经理（2013年1月31日起至今）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理（2013年4月11日起至今）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）（2014年5月7日起至今）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金（2014年5月7日起至今）。

（2）历任基金经理

赖海英女士，于2011年7月28日至2012年6月13日期间担任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理。

聂曙光先生，于2010年12月2日至2014年5月7日期间担任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理。

5. 公司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、分管投资副总经理周蔚文、事业部负责人周蔚文、荀开红、陆文俊、刁羽、曹剑飞，研究部总监卢纯青组成。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。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
办公地址：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
注册日期：1988 年7月8日
注册资本：154 亿元人民币
托管部门联系人：李春磊
电话：010－65169830
传真：010－65169555

广发银行股份有限公司成立于1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本154 亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2006年，广发银行成功重组，引入了花旗集团、中国人寿、国家电网、中信信托等世界一流的知名企业作为战略投资者。重组后，广发银行紧紧围绕“建设一流商业银行”的战略目标，注重战略规划的执行，坚持“调结构、打基础、抓创新、促发展”，强化风险控制，坚持又好又快可持续发展，取得了良好的经营业绩。

截至2013年12月31日，广发银行资本净额732.91亿元，资产总额14698.50亿元，本外币各项存款余额9949.27亿元，各项贷款余额7147.11亿元。根据英国《银行家》杂志对全球1000家大银行排定的位次，广发银行已连续多年入选全球银行500强。

（二）主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行处、监控管理处、产品营销处和期货业务处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理寻卫国先生，管理学博士研究生学历，中国注册会计师、高级会计师，从事托管工作十三年，具有丰富的托管业务经验，是我国第一批从事QFII资产托管业务的人员之一。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、交易监督处处长等职务。2014年4月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部总经理职务。

（三）基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号。

三、相关服务机构

（一）场内发售机构

具有基金代销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）场外发售机构

1. 直销机构：

（1）中欧基金管理有限公司上海直销中心
办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
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.lcfunds.com

（2）中欧基金管理有限公司网上交易系统
网址：www.lcfunds.com

2. 代销机构

（1）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：傅育宁
联系人：邓炯鹏
电话：0755-83198888
传真：0755-83195109
客服热线：95555
公司网站：www.cmbchina.com

（2）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：王洪章
联系人：张静
电话：010-66215533
传真：010-66275154
客服热线：95533

（3）中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
传真：010-68858057
联系人：文彦娜
客服热线：95580
网址：www.psbc.com

（4）兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路154号
办公地址：福州市湖东路154号
法定代表人：高建平
联系人：陈敏
电话：0591-87824863
传真：0591-87842633
客服热线：95561
网址：www.cib.com.cn

（5）中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市中关村南大街1号友谊宾馆嘉宾楼
法定代表人：董文标
联系人：杨成茜
电话：010-68946790
传真：010-68466796
客户热线：95568
网站：www.cmbc.com.cn

（6）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：常振明
联系人：赵树林
电话：010-65558000
传真：010-65550809
客服热线：95558
网址：bank.ecitic.com

（7）中国光大银行股份有限公司
住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：唐双宁
联系人：朱红
电话：010-63636388
传真：010-63636713
客服热线：95595
网址：www.cebbank.com

（8）广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
办公地址：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
联系人：李静筠
电话：020-38322888
传真：020-87310779
客服热线：400-830-8003
网址：www.gdb.com.cn

（9）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82960223
传真：0755-82960141
客服热线：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

（10）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：孔晓君
电话：0755-82943666
传真：025-84579938、025-84579778
客服热线：95597
网址：www.htsc.com.cn

（11）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755-82130578
传真：0755-82130573
客服热线：4001099918
网址：www.cfsc.com.cn

（12）广发证券股份有限公司
住所：广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址：广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：020-87550265
传真：020-87553600
网址：www.gf.com.cn

（13）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：010-85130588
传真：010-65182261
客服热线：4008888108
网址：www.csc108.com

（14）国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层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：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183202
传真：010-64482090
客服热线：400-818-8118
网址：www.guodu.com

（15）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：福建省福州市湖东路268号；上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20-22层
法定代表人：兰荣
联系人：夏中苏
电话：0591-38507869
传真：0591-38507538
客服热线：95562
网址：www.xyzq.com.cn

（16）天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：尹伶
电话：010-66045152
传真：010-66045518
客服热线：010-66045678
网址：www.txsec.com 、www.jjm.com.cn

（17）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客服热线：95525、4008888788、10108998
网址：www.ebscn.com

（18）华福证券有限责任公司
住所：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-96326
传真：010-88085195、010-88085265-8191
客服热线：0591-96326
网址：www.hfzq.com.cn

（19）宏源证券股份有限公司
住所：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦；北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：0991-2301870
传真：0991-2301779
客服热线：400-800-0562
网址：www.hysec.com

（20）中国银河证券股份有限公司
住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层
法定代表人：陈有安
联系人：田薇
电话：010-66568062
传真：010-66568704、010-66568532、010-66568640
客服热线：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（21）齐鲁证券有限公司
住所：济南市经七路86号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：王霖
电话：0531-68889118
传真：0531-68889093
客服热线：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（22）申银万国证券股份有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45楼
办公地址：上海市徐汇区常熟路171号
法定代表人：储晓明
联系人：高夫
电话：021-33389888
传真：021-54035333
客服热线：95523、4008895523
网址：www.swyg.com

（23）海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号海通证券大厦
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
联系人：王立群
电话：021-23219000
传真：021-63410707、021-63410627
客服热线：95553
网址：www.htsec.com

（24）国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券
法人代表：蔡咏
联系人：李飞
电话：0551-62207323
传真：021-38670767
客服热线：95578、4008888777
网址：www.gyzq.com.cn

（25）平安证券有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：0755-22622268
传真：0755-82400862
客服热线：95511-8
网址：www.stock.pingan.com

（26）国泰君安证券股份有限公司
住所：上海浦东新区商城路618号
办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676798
传真：021-38670798
客服热线：4008888666
网址：www.gtja.com

（27）安信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦
法定代表人：牛冠兴
联系人：张晨
电话：021-66581727
传真：010-66581721
客服热线：4008-001-001
网址：www.essences.com.cn

（28）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
电话：010-63080985
传真：010-63081173
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

（29）德邦证券有限责任公司
住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：姚文平
联系人：刘然
电话：021-68761616-8259
传真：021-68761616
客服热线：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn

（30）英大证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十、三十一层
法定代表人：吴骏
联系人：李欣
电话：0755-26982993
传真：0755-26998301
客服热线：4008-698-698
网址：www.ydsc.com.cn

（31）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：张于爱
电话：010-60836030
传真：0755-83025625
客服热线：95558
网址：www.citics.com

（32）爱建证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：郭林
联系人：戴莉丽
电话：021-32229888
传真：010-60836221
客服热线：021-63340678
网址：www.ajzq.com

（33）金元证券股份有限公司
住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025500
传真：0755-83025625
客服热线：4008-888-228
网址：www.jyzq.cn

（34）中信证券（山东）有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022313
传真：0532-85022301
客服热线：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

（35）西南证券股份有限公司
住所：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：023-63786433
传真：023-63786477
网址：www.swsc.com.cn

（36）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
办公地址：中国浙江省杭州市江南大道 588号 恒鑫大厦19、20楼
法定代表人：沈强
联系人：李珊
电话：0571-96598
客服热线：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

（37）联讯证券有限责任公司
住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人：徐刚
联系人：宋航
电话：0752-2119391
传真：0931-4890628
网址：www.lxzq.com.cn

（38）华龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富大厦21楼
办公地址：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富大厦21楼
法定代表人：李晓安
联系人：邓鹏怡
电话：0931-8888088
传真：0931-4890515
客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618
网址：www.hlzqgs.com

（39）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号 A座3层
法定代表人：祝献忠
联系人：黄恒
电话：010-58568235
传真：010-58568140
客服热线：010-58568118
网址：www.hrsec.com.cn

（40）民族证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法人代表人：赵大建
联系人：李微
电话：400-889-5618
传真：010-66553216
客服热线：400-889-5618
网址：www.e5618.com

（41）东吴证券股份有限公司
住所：江苏省苏州工业园区星阳街5号
办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：0512-62601555
传真：0512-62938812
客服热线：400-860-1555
网址：www.dwzq.com.cn

（42）深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
电话：0755-33227953
传真：0755-82080798
客服热线：4006-788-887
众禄基金销售网：www.zlfund.cn
基金买卖网：www.jjmmw.com

（43）杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系电话：0571-28829790
传真：0571-26698533
客服热线：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（44）上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
电话：021-58788678
传真：021-58787698
客服热线：400-089-1289
网址：www.erichfund.com

（45）上海天天基金销售有限公司
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人：其实
电话：021-54509998-7019
传真：021-64385308
客服热线：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

（46）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人：杨文斌
电话：021-58870011
传真：021-68596916
客服热线：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（47）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人：汪静波
电话：021-38602377
传真：021-38509777
客服热线：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（48）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区
法定代表人：王莉
电话：021-68419822
传真：021-68419822-8566
客服热线：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

（49）北京展恒基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
电话：010--62020088
传真：010--62020088 8802
客服热线：400-888-6661
网址：www.myfp.cn

（50）浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人：李晓涛
电话：0571-88920810
传真：0571-86800423
客服热线：400-877-3772
网址：www.5ifund.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，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）基金注册登记机构

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
法人代表：周明
联系人：朱立元
电话：010-59378839
传真：010-59378907

（四）律师事务所与经办律师

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：吕红 安冬
电话：021－31358666
传真：021－31358600
联系人：吕红

（五）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
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：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

四、基金的名称

中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）。

五、基金的类型

契约型。

六、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当期收益和长期回报。

七、基金的投资方向

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、债券、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。

本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产，但可以参与新股申购、股票增发，并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。

本基金投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产比例合计不低于40%。本基金所指信用债券是指金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债券、可转债、可分离交易可转债、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

在封闭期结束后，本基金保留的现金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，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）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设定影响债券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、利率走势、债券市场收益率、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。

本基金加总上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分并据此调整固定收益类资产投资比例。

2. 固定收益类资产投资策略

（1）利率策略

① 久期管理策略

由于久期反映了利率变化对债券价格的影响程度，因此本基金将根据对宏观经济趋势和利率走势的预判，对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

② 收益率曲线策略

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状的可能变化，并相应选择子弹型、哑铃型或梯形策略，以获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

③ 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获得价差收益。

④ 息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于中长期债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

（2）信用策略

本基金力争通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在信用债券的选择时特别重视信用风险的评估和防范。本基金通过分析宏观经济趋势和信用风险历史情况，判断当前信用债券市场整体的信用风险水平，从而确定信用债券整体投资比例。本基金根据信用债券发行人的行业前景、行业地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价信用债券发行人的信用风险，同时根据信用债券的特别条款，评估信用债券的信用风险。

（3）可转债投资策略

本基金将结合可转债发行公司的基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、基本面良好、定价偏低的公司的可转债进行投资。本基金还基于对利率走势、到期收益率、可转债特别条款、发行公司信用风险、个券流动性等因素，分析可转债的债券投资价值。同时，采用期权定价模型，估算可转债的转换期权价值。综合以上因素，对可转债进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

（4）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资产池所产生的现金流作为偿付基础的证券品种。本基金通过对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。

（5）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，决定该个券投资总量的上限。

3. 非固定收益类资产投资策略

（1）新股申购策略

本基金的新股申购策略包括新股发行和股票增发的申购策略。在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定差价，从而使新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金同时也认为，该差价是暂时现象，新股申购策略是一种阶段性投资策略。

本基金将结合公司基本面研究和定价分析，选择行业前景看好、公司基本面良好、定价偏低的个股进行申购，规避质量较差的公司。

本基金还综合考虑新股中签率、上市首日涨幅、锁定期限内股价表现和市场资金供求关系等因素，选择网上申购或网下申购及申购数量。所中签的新股在上市交易后择机卖出。

（2）权证投资策略

本基金不主动投资权证但可持有因持有股票或可分离债而获得的权证。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，谨慎进行持有并择机卖出。

（二）投资决策

1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资事业部负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和基金运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，对基金投资的重大问题进行决策，并在必要时做出修改。

投资事业部负责人负责本事业部内投资管理和内外部沟通工作，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神，结合股票池及有关研究报告，负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

4、投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经