

中欧基金管理有限公司中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2015年第1号)

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
二零一五年十一月
本基金经2015年03月18日中国证监会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]417号文)准予募集注册。本基金基金合同于2015年4月13日正式生效。

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,自主判断投资价值,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,既可能享有投资收益,也可能承担投资风险。在投资基金之前,投资者需要了解基金投资带来的风险。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易流动性不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险,以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险,可能影响基金资产变现能力,造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则,审慎参与中小企业私募债券的投资,严格控制中小企业私募债券的投资风险。

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、属于中等预期收益及预期风险水平的投资品种。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年10月12日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日(财务数据未经审计)。

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: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:上海市浦东新区陆家嘴环路333号东方汇经中心5层、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:袁祖明
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:袁祖明
13.注册资本:200000000元
14.注册币种:人民币
15.股权结构:
意大利联合银行股份有限公司(简称UBI)出资6,580万元人民币,占公司注册资本的36%;
国都证券股份有限公司出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;
上海浦东发展银行股份有限公司(简称浦发银行)出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;
上海银行股份有限公司(简称上海银行)出资3,760万元人民币,占公司注册资本的20%;
上述各股东共出资18,900万元人民币。

二、主要人员情况
1.基金管理人董事会成员
袁祖明先生,清华大学经济管理学院硕士、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,中欧基金管理有限公司董事。曾任招商银行基金业务负责人,大成基金管理有限公司,历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,美国基金管理公司总裁。
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,历任布西亚尔信托银行(CAB)国际业务总监,联合银行(Unicredit)米兰总部客户业务部客户经理,中欧基金管理有限公司信用状况管理负责人,联合银行意大利分行资金部经理,意大利联合银行股份有限公司(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。
朱卿坤先生,中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都证券有限责任公司投资银行总部业务董事,投资银行业务内小组副组长,兼任国都瑞鼎投资有限公司副总经理,曾任联想集团高级经理、副总经理,中国工商银行总行,大连柏松工程技术有限公司,国都证券有限责任公司总经理。
刘建平先生,北京大学法学学士,中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理,历任北京大学副教授、副校长,中国证监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)特許行政及英國特許會計、倫敦會計師總、副總裁,普華永道会计师事务所亚洲区域财务总监。
李蔚女士,美国加州大学圣地亚哥分校工商管理硕士(国际商务管理),美国加州大学圣地亚哥分校工商管理硕士(国际法与税法),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。
2.基金管理人董事会成员
唐步先生,中欧基金管理有限公司监事会主席,中欧成盛资产管理(上海)有限公司董事长,中国籍。历任上海证监局中央登记结算公司副总经理,上海证交所会员部总监、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,历任深圳市深华工贸总公司法律顾问,广东广州律师事务所合伙人,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,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,13年以上证券及基金从业经验。历任申银万国证券股份有限公司上海分公司业务助理经理。
李薇女士,中欧基金管理有限公司客户服务总监,中国籍,同济大学计算机应用专业学士,17年以上基金从业经验。历任大通证券上海南汇路营业部系统管理岗,大通证券上海南汇路营业部客户经理部主管。
3.公司高级管理人员
袁祖明先生,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。
卢艳青女士,中欧基金管理有限公司分管副总经理助理,兼任中欧基金管理有限公司研究总监、市场部主管、事业部主管,加拿大皇后大学金融学硕士,10年以上基金从业经验。历任北京马威华威会计师事务所审计、中欧基金管理有限公司研究部,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经理,中国籍。中国人民大学金融硕士,14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。
黄伟先生,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,26年以上证券及基金从业经验。历任上海建信信托公司场内交易员,上海万国证券公司副经理助理,申银万国证券股份有限公司研究发展部部门经理,光大证券股份有限公司助理总经理,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经理。
4.本基金基金经理
葛兰女士,中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍,美国西北大学生物医学工程专业博士,4年以上证券及基金从业经验。历任国金证券股份有限公司研究所研究员,国金(银华)基金有限公司研究员。2014年10月加入中欧基金管理有限公司,曾任研究员,现任中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年4月13日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年3月31日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年4月13日起至今)。
吴启林先生,中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍。天津大学管理科学专业博士,17年以上证券及基金从业经验。历任中国建设银行股份有限公司研究发展部高级副经理,2015年3月加入中欧基金管理有限公司,曾任基金经理助理兼研究员,现任中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年4月25日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年6月25日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年6月25日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年6月25日起至今)。
刘德元先生,中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理,中国籍。武汉轻工大学(原武汉工业学院)物流管理专业学士,10年以上证券及基金从业经验。历任大众国际资产管理有限公司总监,阳光资产管理股份有限公司高级研究员,2015年6月加入中欧基金管理有限公司,曾任信用研究员,现任中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年8月20日至至今),中欧兴利债券型证券投资基金基金经理(2015年9月25日起至今),中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年9月25日起至今)。
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投资决策机构,由总经理刘建平、分管投资部总经理卢艳青、事业部负责人周闻文、陆文俊、刁勇、曹刚、刘明月、周玉健、赵国英、曲征、风控部总监王玺云组成。其中总经理刘建平担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、基金管理人概况

根据《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资策略、基金投资比例、基金投资禁止行为、基金资产配置限制、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金投资流通受限证券、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资产估值、基金费用开支及收入确认、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的合法性、合规性进行监督和复核。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人有违反法律法规的行为,应及时通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人对上述事项的监督和复核中如发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述基金合同约定的其他有关法律法规的规定,以及以时书形式通知基金管理人,并视情况,采取必要措施以符合法律法规的要求和基金合同约定的。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,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。基金管理人向基金托管人通知的违规事项不得在限期内改正的,基金托管人应向中国证监会报告。

1) 基本面
主营业务竞争力强,包括技术、品牌、政策或者规模等方面
盈利能力强,不仅有短期的业绩与盈利支撑,盈利的稳定性、持续性好,具有长期的投资空间
良好的治理结构
管理层能力强
商业模式优越

2) 估值水平
本基金除了关注个股的基本面之外,还要考察个股业绩的增长性和估值的匹配程度,如果估值比较合理或者低估会优先选择买入并坚持持有,相反如果估值已透支了未来几年的增长,则业绩增长的速度和股价与市盈率不匹配,那么就会相应减持这种股票。

3) 债券投资策略
本基金采取久期策略、期限结构配置、展期配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。

4) 1) 期限配置
本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政支出、市场结构变化等方面的定性和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期策略、期限结构配置,根据对利率水平的预期调整组合久期。

2) 期限结构配置
本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

3) 类别配置
本基金通过资产配置组合中各债券类别的配置,包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债等债券品种的配置,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

4) 个券选择
个券选择是通过比较各个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限的债券品种的过程。

5) 股指期货投资策略
本基金投资股指期货将严格遵循风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争通过股指期货套期保值,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

6) 中小企业私募债券投资策略
本基金通过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、预估提前还款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。

7) 权益类投资
本基金通过研究分析,对中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险收益匹配的债券品种进行投资。具体由深入研究债券发行人(或公司)背景、产业状况、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息,分析企业的长期运作风险、运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、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、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;4) 考察债券发行人的增信措施,包括担保、质押、银行授信、偿债基金、资产支持证券等;5) 综合上述分析结果,确定信用风险的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值品种进行投资。

8) 权证投资策略
本基金权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个股方面,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预测,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
本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年定期存款基准利率(税后)。

金融机构人民币三年定期存款基准利率由中国人民银行公布;该利率作为业绩比较基准直观明了,为广大投资人所熟悉;数据容易获得,适合作为业绩比较基准。本基金积极投资于股票及债券等资产,在长期内会有收益,但也会面临市场利率变动的风险。本基金力争在长期内实现超越业绩比较基准的投资目标,并力争实现超越业绩比较基准的长期收益。

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,属于中等预期收益及预期风险水平的投资品种。

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,属于中等预期收益及预期风险水平的投资品种。

第十一部分 基金的投资组合报告
一、报告期末基金资产组合情况

1. 报告期末基金资产组合情况

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

4. 报告期末按品种分类的债券投资组合

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债券投资明细

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

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

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

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

12. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

13. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

14. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

15. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

16. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

17. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

18. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

19. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

20. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

21. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

22. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

23. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

24. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

25. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

26. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

27. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

28. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

29. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

30. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

31. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

32. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

中欧瑾和灵活配置混合A
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(2015年4月13日至2015年9月30日)

中欧瑾和灵活配置混合C
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图
(201