

中欧基金管理有限公司

中欧短债债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要 （2019 年第 1 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

二〇一九年六月

重要提示

中欧短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中欧强泽债券型证券投资基金转型而来。中欧强泽债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2018]1478 号文准予变更注册为中欧短债债券型证券投资基金。基金转型经 2018 年 10 月 23 日中欧强泽债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2018 年 10 月 25 日起，由《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。中欧强泽债券型证券投资基金经中国证监会变更注册为本基金，但并不表明中国证监会对本基金的投资价值和市场前景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变更注册，但中国证监会同意中欧强泽债券型证券投资基金变更注册为本基金，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。

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、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以及本基金特有风险等。

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，由投资人自行承担。

本更新招募说明书摘要所载内容截止日为 2019 年 4 月 24 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分	基金管理人.....	5
第二部分	基金托管人.....	9
第三部分	相关服务机构.....	14
第四部分	基金的名称.....	29
第五部分	基金的类型.....	29
第六部分	基金的投资目标.....	29
第七部分	基金的投资范围.....	29
第八部分	基金的投资策略.....	30
第九部分	基金的业绩比较基准.....	32
第十部分	基金的风险收益特征.....	32
第十一部分	基金的投资组合报告.....	32
第十二部分	基金的业绩.....	37
第十三部分	基金费用与税收.....	39
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明.....	41

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 号五层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 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：22000 万元人民币
- 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，曾在意大利信贷银行（Credito Italiano，现名：联合信贷银行 Unicredit）圣雷莫分行、米兰分行、伦敦分行、纽约分行、东京分行（财务部负责人）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、The Red Flag Group 非执行董事，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，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，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。

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，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，兼任中欧基金管理有限公司策略组负责人，中国籍。上海财经大学金融学硕士，18 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，14 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，18 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

(1) 现任基金经理

姓名	王慧杰	性别	女
国籍	中国	毕业院校及专业	美国普渡大学数理金融专业
其他公司历任	彭博咨询社（纽约）利率衍生品研发员，光大保德信基金管理有限公司研究员、基金经理		
本公司历任	基金经理助理		

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	中欧强泽债券型证 券投资基金	2018 年 08 月 13 日	
2	中欧滚钱宝发起式 货币市场基金	2018 年 08 月 13 日	

（2）历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
朱晨杰	2017 年 04 月 07 日	2018 年 08 月 21 日
刘德元	2017 年 02 月 24 日	2017 年 06 月 27 日
黄华	2017 年 10 月 10 日	2019 年 01 月 09 日
蒋雯文	2018 年 01 月 30 日	2019 年 02 月 19 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：陈四清

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存在重大违规行为，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、基金份额发售机构

1、直销机构（A 类）

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：竇玉明

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

2、其他销售机构（A 类）

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

3) 名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所:北京市西城区宣武门西大街 131 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

客服热线:95580

网址:www.psbc.com

4) 名称:广州农村商业银行股份有限公司

住所:广州市黄埔区映日路 9 号

办公地址:广州市黄埔区映日路 9 号

法定代表人:王继康

客服热线:95313

网址:www.grcbank.com

5) 名称:阳光人寿保险股份有限公司

住所:海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人:李科

客服热线:95510

网址:<http://fund.sinosig.com>

6) 名称：国都证券股份有限公司

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：王少华

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

7) 名称：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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

8) 名称：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：陈共炎

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

9) 名称：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：王连志

客服热线：4008-001-001

网址：www.essences.com.cn

10) 名称：上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济
发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

11) 名称：中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服热线：0371-95377

网址：<http://www.ccnew.com>

12) 名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

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

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

13) 名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

14) 名称：诺亚正行基金销售有限公司

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

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

15) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 楼 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

16) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层

法定代表人：其实

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

17) 名称：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：凌顺平

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

18) 名称：上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户热线：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

19) 名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

20) 名称：深圳前海微众银行股份有限公司

住所：深圳前海深港合作区前湾一路 A 栋 201

办公地址：深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法定代表人：顾敏

客服热线：400-999-8800

网址：www.webank.com

21) 名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

网址：https://danjuanapp.com

22) 名称：北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：江卉

客服热线：4000988511/ 4000888816

网址：http://fund.jd.com/

23) 名称：上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

24) 名称：嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客服热线：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

25) 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层

法定代表人：刘明军

客服热线：95017 转 1 再转 8

网址：<http://www.tenganxinxi.com>

26) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

27) 名称：大连银行股份有限公司

住所：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

办公地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

客服热线：4006640099

网址：www.bankofdl.com

28) 名称：江苏银行股份有限公司

住所：江苏省秦淮区中华路 26 号

办公地址：江苏省秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服热线：95319

网址：www.jsbchina.com

29) 名称：南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

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:王锋

客服热线: 95177

网址:www.snjijin.com

30) 名称: 北京百度百盈基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址: 北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人: 张旭阳

客服热线: 95055-9

网址: www.baiyingfund.com

31) 名称: 上海银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路 168 号

办公地址: 上海市银城中路 168 号

法定代表人: 金煜

客服热线: 95594

公司网站: www.bosc.cn

3、直销机构（C 类）

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

4、其他销售机构（C 类）

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

3) 名称: 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区宣武门西大街 131 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

客服热线: 95580

网址: www.psbc.com

4) 名称: 阳光人寿保险股份有限公司

住所: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人: 李科

客服热线: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com>

5) 名称: 国都证券股份有限公司

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: 王少华

客服热线: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

6) 名称: 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

7) 名称：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：陈共炎

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

8) 名称：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：王连志

客服热线：4008-001-001

网址：www.essences.com.cn

9) 名称：上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济
发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

10) 名称：中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服热线：0371-95377

网址：<http://www.ccnew.com>

11) 名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

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

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

12) 名称：上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

13) 名称：诺亚正行基金销售有限公司

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

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

14) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 楼 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

15) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层

法定代表人：其美

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

16) 名称：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：凌顺平

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

17) 名称：上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户热线：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

18) 名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

19) 名称：深圳前海微众银行股份有限公司

住所：深圳前海深港合作区前湾一路 A 栋 201

办公地址：深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法定代表人：顾敏

客服热线：400-999-8800

网址：www.webank.com

20) 名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

客服热线：4000-618-518

网址：[https:// danjuanapp.com](https://danjuanapp.com)

21) 名称：北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：江卉

客服热线：4000988511/ 4000888816

网址：[http://fund. jd. com/](http://fund.jd.com/)

22) 名称：上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03

室

法定代表人：冷飞

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

23) 名称：嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客服热线：400-021-8850

网址：[https://www.harvestwm. cn/](https://www.harvestwm.cn/)

24) 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层

法定代表人：刘明军

客服热线：95017 转 1 再转 8

网址：<http://www.tenganxinxi.com>

25) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

26) 名称：大连银行股份有限公司

住所：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

办公地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

客服热线：4006640099

网址：www.bankofdl.com

27) 名称：江苏银行股份有限公司

住所：江苏省秦淮区中华路 26 号

办公地址：江苏省秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服热线：95319

网址：www.jsbchina.com

28) 名称：南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

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：王锋

客服热线：95177

网址：www.snjijin.com

29) 名称：北京百度百盈基金销售有限公司

住所：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

客服热线：95055-9

网址：www.baiyingfund.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。

二、登记机构

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：竇玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

三、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、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

四、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

中欧短债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

在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、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（含超短期融资券）、次级债、分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等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）。

本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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：

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于短债的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，本基金持有现金（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不低于基金资产净值的 5%。本基金所投资的短债是指剩余期限不超过 397 天的债券资产，主要包括国债、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（含超短期融资券）、次级债、分离交易转债的纯债部分等金融工具。

第八部分 基金的投资策略

本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资。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。

1、利率预期策略

（1）久期策略

久期策略是指，根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估，并考虑在运作周期中所处阶段，确定债券组合的久期配置。本基金将在预期市场利率下行时，适当拉长债券组合的久期水平，在预期市场利率上行时，适当缩短债券组合的久期水平，以此提高债券组合的收益水平。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是指，首先评估均衡收益率水平，以及均衡收益率曲线合理形态，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，评估不同剩余期限下的价值偏离程度，在满足既定的组合久期要求下，根据风险调整后的预期收益率

大小进行配置，由此形成子弹型、哑铃型或者阶梯型的期限配置策略。

2、信用策略

（1）类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

（2）个券选择策略

基金管理人自建债券研究资料库，并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析，比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素等，进行个券选择。

3、时机策略

（1）骑乘策略

当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

（2）息差策略

利用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以获取超额收益。

（3）利差策略

对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

4、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。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1 年以下)指数收益率。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取中债综合财富(1 年以下)指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据取自本基金 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,683,235,441.60	93.16
	其中：债券	7,683,235,441.60	93.16
	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	397,967,596.95	4.83
	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	5,515,175.30	0.07
8	其他资产	160,476,115.60	1.95
9	合计	8,247,194,329.45	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

本基金本报告期末未持有股票。

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。

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。

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	426,739,600.00	6.57
	其中：政策性金融债	426,739,600.00	6.57
4	企业债券	491,971,741.60	7.58
5	企业短期融资券	4,141,511,000.00	63.78
6	中期票据	2,613,005,100.00	40.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	10,008,000.00	0.15
10	合计	7,683,235,441.60	118.33

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	011802358	18 首钢 SCP012	1,800,000	180,882,000.00	2.79
2	180209	18 国开 09	1,800,000	180,486,000.00	2.78
3	101658067	16 中药控股 MTN001	1,600,000	160,592,000.00	2.47
4	101459044	14 龙高速 MTN001	1,500,000	152,625,000.00	2.35
5	011802393	18 宁河西 SCP003	1,400,000	140,714,000.00	2.17

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

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。

11、投资组合报告附注

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。

11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	56,678.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	136,104,390.31
5	应收申购款	24,315,046.67
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	160,476,115.60

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。

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。

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。

第十二部分 基金的业绩

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。

本基金合同生效日 2017 年 2 月 24 日，基金业绩截止日 2019 年 3 月 31 日。

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

A 份额

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 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
2017. 2. 24-2017. 12. 31	3. 00%	0. 04%	-2. 60%	0. 06%	5. 60%	-0. 02%
2018. 1. 1-2018. 12. 31	5. 87%	0. 05%	3. 90%	0. 06%	1. 97%	-0. 01%
2019. 1. 1-2019. 3. 31	1. 12%	0. 02%	0. 91%	0. 02%	0. 21%	0. 00%
2017. 2. 24-2019. 3. 31	10. 27%	0. 05%	2. 12%	0. 06%	8. 15%	-0. 01%

C 份额

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 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
2018. 10. 25-2018. 12. 31	0. 64%	0. 02%	0. 67%	0. 02%	-0. 03%	0. 00%
2019. 1. 1-2019. 3. 31	1. 00%	0. 02%	0. 91%	0. 02%	0. 09%	0. 00%
2018. 10. 25-2019. 3. 31	1. 65%	0. 02%	1. 58%	0. 02%	0. 07%	0. 00%

数据来源：中欧基金

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自 2018 年 10 月 25 日起，变更业绩比较基准至中债综合财富（1 年以下）指数收益率。



注：自 2018 年 10 月 25 日起，变更业绩比较基准至中债综合财富（1 年以下）指数收益率。自 2018 年 10 月 26 日起，本基金增加 C 类份额，图示日期为 2018 年 10 月 26 日至 2019 年 03 月 31 日。

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2018 年 12 月刊登的《中欧短债债券型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

（一） 更新了 “重要提示” 部分 中的相关内容。

更新了“本更新招募说明书所载内容截止日为 2019 年 4 月 24 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。”。

（二） 更新了 “第三部分 基金管理人” 部分 中的相关内容。

1、更新了基金管理人的住所、注册资本和股权结构。

2、更新了董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理、投资决策委员会成员的信息。

（三） 更新了 “第四部分 基金托管人” 部分 中的相关内容。

更新了基金托管人的信息。

（四） 更新了 “第五部分 相关服务机构” 部分 中的相关内容。

1、更新了直销机构的住所。

2、更新了代销机构的信息。

3、更新了登记机构的住所。

（五） 更新了 “第八部分 基金份额的申购与赎回 ” 部分 中的相关内容
更新了“申购和赎回的数量限制”。

（六） 更新了 “第九部分 基金的投资” 部分 中的相关内容。

更新了“基金投资组合报告”，所载数据取自本基金 2019 年第 1 季度报告，所载数据截至 2019 年 3 月 31 日。

（七）更新了“第十部分 基金的业绩”部分 中的相关内容。

更新了基金业绩，截止日 2019 年 3 月 31 日。

（八）更新了“第二十一部分 其他应披露事项”部分 中的相关内容。

更新了自 2018 年 10 月 25 日至 2019 年 4 月 24 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

（九）更新了“附件二 基金托管协议内容摘要”部分 中的相关内容。

更新了管理人的信息。

以下为本基金管理人自 2018 年 10 月 25 日至 2019 年 4 月 24 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下基金 2019 年第一季度报告	2019-04-18
2	中欧基金管理有限公司关于新增广州农商银行为部分基金代销机构同步开通转换和定投业务的公告	2019-04-10
3	中欧基金管理有限公司关于新增安信证券为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	2019-04-08
4	中欧基金管理有限公司关于新增百度百盈为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	2019-04-01
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的电子银行及 AI 投申购费率优惠活动的公告	2019-04-01
6	中欧基金管理有限公司旗下基金 2018 年基金年报摘要	2019-03-28
7	中欧基金管理有限公司旗下基金 2018 年基金年报	2019-03-28
8	中欧基金管理有限公司关于新增上海银行为部分基金代销机构同步开通转换定投业务的公告	2019-03-28
9	中欧基金管理有限公司关于新增中信建投为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	2019-03-13

10	中欧基金管理有限公司关于新增基煜基金为部分基金代销机构同步开通转换业务并享受费率优惠的公告	2019-03-13
11	中欧基金管理有限公司关于调整中欧短债债券型证券投资基金在公司直销渠道开展赎回费率优惠安排的公告	2019-03-07
12	中欧短债债券型证券投资基金基金经理变更公告	2019-02-20
13	中欧基金管理有限公司关于新增中原证券为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并享受费率优惠的公告	2019-02-18
14	中欧基金管理有限公司旗下基金 2018 年第四季度报告	2019-01-22
15	中欧基金管理有限公司中欧基金管理有限公司住所变更公告	2019-01-18
16	中欧基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	2019-01-18
17	中欧基金管理有限公司关于新增招商银行为中欧短债债券型证券投资基金代销机构并开通转换和定投业务的公告	2019-01-15
18	中欧短债债券型证券投资基金基金经理变更公告	2019-01-10
19	中欧基金管理有限公司关于调整旗下中欧短债债券型证券投资基金单笔最低交易限额的公告	2019-01-05
20	中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2019-01-01
21	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与邮储银行申购费率优惠活动的公告	2018-12-28
22	中欧基金管理有限公司_关于旗下部分基金参与工商银行开展的定期定额投资申购费率优惠活动的公告	2018-12-28
23	中欧基金管理有限公司关于新增腾安基金为中欧短债债券型证券投资基金代销机构同步开通转换、定投业务并参与费率优惠的公告	2018-12-19
24	中欧基金管理有限公司关于中欧短债债券型证券投资基金在部分销售机构恢复申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	2018-12-17
25	中欧基金管理有限公司关于新增阳光保险为部分基金代销机构同步开通转换、定投业务并享受费率优惠的公告	2018-12-11

26	中欧基金管理有限公司关于中欧短债债券型证券投资基金在部分销售机构暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	2018-12-03
27	中欧基金管理有限公司关于新增江苏银行为中欧短债债券型证券投资基金代销机构同步开通转换、定投业务并参与费率优惠的公告	2018-11-30
28	中欧基金管理有限公司关于新增嘉实财富为部分基金代销机构同步开通转换业务并享受费率优惠的公告	2018-11-27
29	中欧基金管理有限公司关于新增邮储银行为中欧短债债券型证券投资基金代销机构并开通定投转换业务的公告	2018-11-22
30	中欧基金管理有限公司关于新增工商银行为中欧短债债券型证券投资基金代销机构同步开通定投转换业务并享受费率优惠的公告	2018-11-19
31	中欧基金管理有限公司关于新增苏宁基金为部分基金代销机构同步开通转换定投业务并参与费率优惠的公告	2018-11-16
32	中欧基金管理有限公司关于调整旗下中欧短债 A 在中欧钱滚滚电子交易平台单笔最低申购、定投金额的公告	2018-10-26
33	中欧基金管理有限公司关于旗下中欧短债 A 在中欧钱滚滚电子交易平台开展费率优惠活动的公告	2018-10-26
34	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为中欧短债债券型证券投资基金代销机构同步开通定投转换业务并享受费率优惠的公告	2018-10-26
35	中欧短债债券型证券投资基金分红公告	2018-10-26
36	中欧基金管理有限公司关于中欧短债债券型证券投资基金之 A 类份额在公司直销渠道开展赎回费率优惠方案的公告	2018-10-25

中欧基金管理有限公司

2019 年 6 月 6 日