

中欧弘涛债券型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2020年08月28日

送出日期：2020年08月31日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中欧弘涛债券	基金代码	004850
基金简称A	中欧弘涛债券A	基金代码A	004850
基金简称C	中欧弘涛债券C	基金代码C	008946
基金管理人	中欧基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2017年09月01日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
洪慧梅	2020-04-30	2007-02-01	
其他	基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

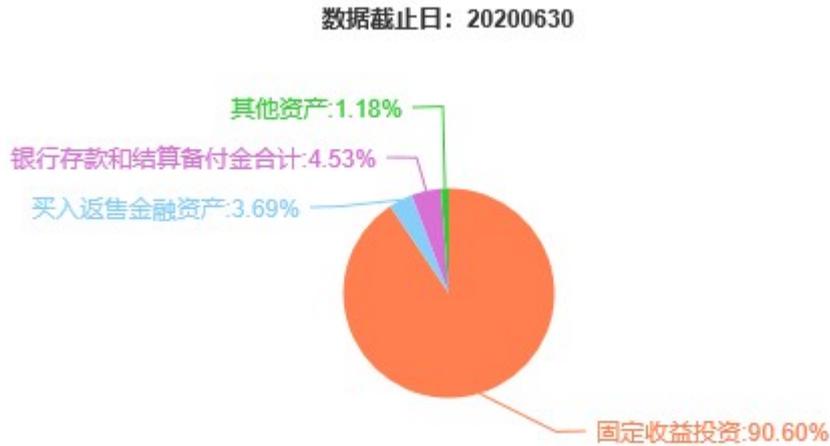
（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况

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。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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）、资产支持证券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货、信用衍生品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）。</p> <p>本基金不直接投资股票，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票等。因上述原因持有的股票等资产，本基金将在其可交易之日起10个交易日内卖出。</p> <p>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。</p>

	<p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（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不低于基金资产净值的5%。</p>
主要投资策略	<p>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。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。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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，属于较低预期风险/收益的产品。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据统计区间：2017年09月01日-2019年12月31日



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

中欧弘涛债券A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	$0 \leq M < 1000$ 万	0.60%	
	$1000 \text{ 万} \leq M$	1000.00 元/笔	
赎回费	$0 \text{ 天} \leq N < 7$ 天	1.50%	
	$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	0.10%	
	$30 \text{ 天} \leq N$	0.00%	

中欧弘涛债券C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	$0 \text{ 天} \leq N < 7$ 天	1.50%	
	$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	0.10%	
	$30 \text{ 天} \leq N$	0.00%	

申购费 C： 本基金 C 类份额不收取申购费。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.60%
托管费	0.10%
销售服务费C	0.40%

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、 风险揭示与重要提示

（一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：

-市场风险

1、政策风险，2、利率风险，3、信用风险，4、通货膨胀风险，5、再投资风险，6、法律风险

-管理风险；

-流动性风险；

-策略风险；

-其它风险；

-特有风险

本基金将国债期货纳入到投资范围中，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

本基金的投资范围包括资产支持证券。基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但仍或面临信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险，所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或由于资产支持证券信用质量降低、市场利率波动导致证券价格下降，造成基金财产损失。受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券存在一定的流动性风险。

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。流动性风险是指信用衍生品在交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营情况不佳，或创设机构的现金流与预期出现一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体，经营情况或利率环境出现变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。本基金连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会，因此，本基金面临自动终止的风险。

（二） 重要提示

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。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

各方当事人同意，因本基金基金合同而产生的或与本基金基金合同有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。本基金基金合同受中国法律管辖。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.zofund.com][客服电话：400-700-9700]

- 1、《中欧弘涛债券型证券投资基金基金合同》
《中欧弘涛债券型证券投资基金托管协议》
《中欧弘涛债券型证券投资基金招募说明书》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、 其他情况说明

无