

# 中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) 更新招募说明书

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

二〇二四年六月

## 重要提示

本基金经 2011 年 10 月 13 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧盛世成长分级股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1658 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2012 年 3 月 29 日正式生效。根据基金合同的有关规定，本基金的基金合同生效满三年后，无需召开基金份额持有人大会，盛世 A 份额与盛世 B 份额自动折算为中欧盛世份额的场内份额。其后，本基金将不再分级运作并更名为“中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）”。

本基金股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 60%~95%。根据原《证券投资基金运作管理办法》规定，本基金为股票型证券投资基金。根据 2014 年 8 月 8 日修订后施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例要求由原来的“百分之六十以上”调整为“百分之八十以上”。基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为混合型证券投资基金，原《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》及《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金托管协议》中的相关条款亦做相应修订。

根据相关法律法规的规定及本基金《基金合同》的约定，基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，决定自 2015 年 10 月 8 日起对本基金增加 E 类份额并相应修改基金合同。基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，决定自 2017 年 1 月 12 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“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，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金资产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。本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

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》、《基金合同》和基金产品资料概要。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新基金业绩表现的保证。

除非另有说明，本《招募说明书》本次更新内容及截止日期如下：

序号	更新内容	截至日期
1	基金管理人概况及主要人员信息	2024年5月15日
2	基金经理信息	本《招募说明书》披露日 前一工作日
3	财务数据（未经审计）和净值表现	参见相关章节
4	其他文字内容	2024年4月30日

## 目 录

第一部分	绪言	6
第二部分	释义	7
第三部分	基金管理人	14
第四部分	基金托管人	27
第五部分	相关服务机构	30
第六部分	基金份额的分级	33
第七部分	基金的募集	36
第八部分	基金合同的生效	37
第九部分	基金份额的上市交易	38
第十部分	基金份额的场外申购、转换与赎回	40
第十一部分	基金份额的场内申购与赎回	52
第十二部分	基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记	59
第十三部分	基金的投资	61
第十四部分	基金的业绩	75
第十五部分	基金的财产	77
第十六部分	基金资产的估值	78
第十七部分	基金的收益分配	84
第十八部分	基金的费用与税收	86
第十九部分	基金份额折算	88
第二十部分	基金的会计与审计	94
第二十一部分	基金的信息披露	95
第二十二部分	风险揭示	102
第二十三部分	基金合同的终止与基金财产的清算	107
第二十四部分	基金合同内容摘要	109
第二十五部分	基金托管协议内容摘要	110
第二十六部分	对基金份额持有人的服务	111
第二十七部分	其他应披露事项	112

第二十八部分 招募说明书的存放及查阅方式	113
第二十九部分 备查文件	114
附件一 基金合同内容摘要	115
附件二 基金托管协议内容摘要	133

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)等有关法律法规及《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了中欧盛世成长混合型(LOF)证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1. 基金或本基金:指中欧盛世成长分级股票型证券投资基金。分级运作期满后指中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)
2. 基金管理人:指中欧基金管理有限公司
3. 基金托管人:指广发银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同:指《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书:指《中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新
7. 基金份额发售公告:指《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、地方性法规、地方政府规章以及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及其不时修订
9. 《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
10. 《销售办法》:指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》:指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的,并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决

定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12. 《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

13. 《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

16. 基金份额分级：指本基金的基金份额包括中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之基础份额、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之A份额与中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之B份额。其中，中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之A份额与中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之B份额的基金份额数配比在其存续期内保持5：5的比率不变。本基金分级运作期到期转为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)

17. 中欧盛世份额：指中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之基础份额

18. 盛世A份额：指获取稳健收益的基金份额，即中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之A份额

19. 盛世B份额：指获取剩余收益的基金份额，即中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之B份额

20. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

21. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

22. 机构投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

23. 合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者



24. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

25. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

26. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

27. 场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理中欧盛世份额认购、申购和赎回及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购、赎回等业务的基金销售机构及其场所

28. 场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位并利用深圳证券交易所交易系统办理中欧盛世份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A类份额申购、赎回以及盛世 A 份额、盛世 B 份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A类份额上市交易等业务的场所

29. 直销机构：指中欧基金管理有限公司

30. 场外代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金场外销售业务的机构

31. 场内代销机构：代为办理场内基金销售业务，具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位

32. 代销机构：除特别说明外，指场外代销机构和场内代销机构的合称

33. 销售机构：指直销机构和代销机构

34. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

35. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金 A 类份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，本基金 E 类份额和 C 类份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司

36. 注册登记系统: 对本基金 A 类场外份额而言指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统, 对本基金 E 类份额和 C 类份额而言指中欧基金管理有限公司开放式基金登记结算系统

37. 证券登记结算系统: 指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

38. 基金账户: 指基金投资人通过场外销售机构在注册登记机构开立的开放式基金账户, 用于记录投资人持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。基金投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

39. 深圳证券账户: 指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

40. 基金交易账户: 指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

41. 基金合同生效日: 指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件, 基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕, 并获得中国证监会书面确认的日期

42. 基金合同终止日: 指基金合同规定的基金合同终止事由出现后, 基金财产清算完毕, 清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

43. 基金募集期: 指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间, 最长不得超过 3 个月

44. 存续期: 指基金合同生效至终止之间的不定期期限

45. 工作日: 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

46. T 日: 指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

47. T+n 日: 指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

48. 开放日: 指为投资人办理中欧盛世份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购、赎回或其他业务的工作日

49. 分级运作期:指中欧盛世份额、盛世A份额、盛世B份额的共同运作期。具体为自基金合同生效之日起至三年期末对应日(即到期折算日),如该对应日为非工作日,则顺延到下一个工作日。本基金分级运作期到期转为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF),并将继续在深圳证券交易所上市交易

50. 交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

51. 《业务规则》:指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《上市开放式基金业务指引》、《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》等相关业务规则及其不时修订,是规范基金管理人管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

52. 认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为

53. 申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买中欧盛世份额(分级运作期内)、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额(分级运作期满后)的行为

54. 赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将中欧盛世份额(分级运作期内)、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额(分级运作期满后)兑换为现金的行为

55. 销售服务费:指从基金资产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

56. 基金份额的分类:指本基金根据注册登记机构或申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

57. 份额配对转换:指根据基金合同的约定,在分级运作期内,本基金的中欧盛世份额的场内份额与盛世A份额、盛世B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面

58. 分拆:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每10份中欧盛世份额的场内份额申请转换成5份盛世A份额与5份盛世B份额的行为

59. 合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 5 份盛世 A 份额与 5 份盛世 B 份额进行配对申请转换成 10 份中欧盛世份额的场内份额的行为

60. 基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的约定，对本基金相关份额进行折算，并对有关份额的基金份额净值和份额数量进行调整的行为

61. 基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为。基金份额持有人持有的登记在证券登记结算系统的场内基金份额需经跨系统转托管至中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统后方可申请办理基金转换业务

62. 系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

63. 跨系统转登记：指基金份额持有人将持有的本基金 A 类基金份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为

64. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

65. 巨额赎回：指本基金（分级运作期内指中欧盛世份额，分级运作期满后指中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额）单个开放日，净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（分级运作期内包括中欧盛世份额、盛世 A 份额、盛世 B 份额）的 10%

66. 流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受

限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

67. 元：指人民币元

68. 基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

69. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

70. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

72. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

73. 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

74. 不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

75. 基金产品资料概要：指《中欧盛世成长混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

### 第三部分 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479号8层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8、10、16层
- 4、法定代表人：竇玉明
- 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、存续期限：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-68609601
- 12、联系人：马云歌
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：2.20亿元人民币
- 15、股权结构：

序号	股东名称	注册资本 (人民币/万元)	比例
1	WP Asia Pacific Asset Management LLC 华平亚太资产管理有限公司	5,126	23.3000%
2	竇玉明	4,400	20.0000%
3	国都证券股份有限公司	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	上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)	388	1.7636%
6	周蔚文	792.7580	3.6034%

7	卢纯青	611.7760	2.7808%
8	葛兰	330	1.5000%
9	王培	330	1.5000%
10	于洁	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞玺云	114.4660	0.5203%
14	曲径	100	0.4545%
15	刘伟伟	100	0.4545%
16	袁维德	100	0.4545%
17	郑苏丹	87.7580	0.3989%
18	蓝小康	80	0.3636%
19	许文星	66	0.3000%
20	李维	66	0.3000%
21	黎忆海	64.3720	0.2926%
22	殷姿	45	0.2045%
<b>共 计</b>		<b>22,000</b>	<b>100%</b>

注：因四舍五入，股权比例加总存在尾差。

## 二、主要人员情况

### 1. 基金管理人董事会成员

窦玉明先生，中国籍。清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学MBA。现任中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立公益基金会理事，国寿投资保险资产管理有限公司独立董事。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、董事。

周朗朗先生，中国香港籍。加拿大西安大略大学本科，清华大学高级管理人员工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司副董事长，美国华平投资集团中国区联席总裁、中国金融及企业服务行业和工业科技投资行业主管合伙人、董事总经理，河南中原消费金融股份有限公司董事。历任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）银行和花旗银行（香港）投资银行部分分析师。

张园园女士，中国籍。毕业于重庆大学本科、硕士。现任中欧基金管理有限公司董事，国都景瑞投资有限公司总经理、董事。历任重庆国际信托股份有限公司北京业务管理总部副总经理、金融市场业务部执行总裁。

刘建平先生，中国籍。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。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理兼首席信息官，中欧基金国际有限公司董事长，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。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。

樊扬先生，中国籍。澳大利亚麦考里大学经济学硕士，清华大学高级工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任 CPPIB PE Investment Asia Limited 董事总经理，Citron PE Investment (Hong Kong) 2016 Limited 董事总经理，中信产业基金管理公司投资总监，国际金融公司中国代表处投资官员、高级投资官员，北京鹏联投资顾问有限公司副总裁，德勤咨询（上海）有限公司北京分公司高级咨询顾问、经理，荷兰银行北京分行信贷经理，渣打银行天津分行信贷助理。

钟炜先生，中国籍。毕业于西北政法大学本科。现任中欧基金管理有限公司独立董事，北京市康达（广州）律师事务所律师。历任北京市康达（广州）律师事务所广州分所主任，北京市康达律师事务所律师、高级合伙人，陕西省洋县人民法院副院长。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学国际金融系世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事，上海财经大学金融学教授、上海财经大学青岛财富管理研究院名誉院长，中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事，上海裊之文学艺术创作有限公司执行董事，利群商业集团股份有限公司独立董事，江苏昆山农村商业银行股份有限公司独立董事。历任上海财经大学金融系副主任，上海财经大学财务金融学院副院长，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直属党支部书记兼副院长。

## 2. 基金管理人监事会成员

顾飞先生，中国籍。中国社会科学院工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司监事会主席，国都创业投资有限责任公司副总经理。历任北京锦润投资管理



有限公司客户部总经理, 重庆国投财富投资管理有限公司大客户部副总经理, 重庆国际信托股份有限公司信托经理, 天风证券股份有限公司交易员, 银河德睿资本管理有限公司投资经理。

江知玥女士, 中国籍。剑桥大学地产金融专业硕士。现任中欧基金管理有限公司监事, 美国华平投资集团股权投资部投资经理。历任美国银行公司全球市场部经理, 上海维信荟智金融科技有限公司战略规划经理, 瑞士信贷(香港)有限责任公司投资银行部分析师。

李琛女士, 中国籍。同济大学计算机及应用专业学士。现任中欧基金管理有限公司监事、理财规划总监。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。

刘京鹏先生, 中国籍。复旦大学金融学硕士。现任中欧基金管理有限公司监事、战略规划及业务发展总监。历任华宸未来基金管理有限公司产品与金融工程部产品经理。

### 3. 基金管理人高级管理人员

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。

卢纯青女士, 中欧基金管理有限公司副总经理、权益投决会委员、投资总监、基金经理, 中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士。历任北京毕马威华振会计师事务所审计, 中信基金有限责任公司研究员, 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副总经理, 上海中欧财富基金销售有限公司执行董事, 中欧基金国际有限公司董事, 中国籍。中国人民大学金融学硕士, 中欧国际工商学院 EMBA。历任华安基金管理有限公司北京分公司投资顾问, 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, 中欧盛世资产管理(上海)有限公司董事, 兴盛天成投资管理(南平)有限公司董事, 中欧私募基金管理(上海)有限公司董事, 中国籍。清华大学五道口金融学院 EMBA。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。

于岚女士, 中欧基金管理有限公司财务负责人/人力资源总监, 上海中欧财富基金销售有限公司监事, 中欧盛世资产管理(上海)有限公司董事长, 中欧私

募基金管理(上海)有限公司董事,中国籍。上海财经大学金融学硕士、上海交通大学高级金融学院EMBA。历任上海证券信息有限公司总裁行政助理,中欧基金管理有限公司总经理助理、运营副总监、行政部总监。

4. 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

姓名	张跃鹏	性别	男
国籍	中国	最高学历、 学位	研究生、硕 士
其他公司历任	上海永邦投资有限公司投资经理,上海涌泉亿信投资发展中心(有限合伙)策略分析师		
本公司历任	交易员、投资运营部副总监、基础研究及投资支持部副总监		
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	中欧价值智选回报混合型证券投资 基金	2016年09 月01日	2017年09 月26日
2	中欧瑾泰灵活配置混合型证券投资 基金	2017年08 月09日	2018年08 月23日
3	中欧康裕混合型证券投资基金	2017年03 月15日	2018年06 月01日
4	中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资 基金	2016年08 月22日	2018年07 月25日
5	中欧双利债券型证券投资基金	2016年11 月23日	2018年06 月01日
6	中欧琪丰灵活配置混合型证券投资 基金	2015年11 月27日	2018年12 月04日
7	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资 基金	2015年11 月27日	2020年07 月09日
8	中欧瑾和灵活配置混合型证券投资 基金	2016年01	2017年01

	投资基金	月 12 日	月 25 日
9	中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金	2016 年 01 月 12 日	2019 年 01 月 16 日
10	中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金	2016 年 01 月 12 日	
11	中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金	2016 年 01 月 12 日	
12	中欧明睿新起点混合型证券投资基金	2017 年 06 月 23 日	2018 年 07 月 12 日
13	中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金	2018 年 07 月 12 日	2018 年 11 月 21 日
14	中欧瑾灵灵活配置混合型证券投资基金	2019 年 06 月 19 日	2023 年 10 月 27 日
15	中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	2019 年 06 月 28 日	2021 年 08 月 13 日
16	中欧优势成长三个月定期开放混合型发起式证券投资基金	2020 年 09 月 18 日	2023 年 05 月 12 日
17	中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金	2020 年 11 月 27 日	2021 年 12 月 08 日
18	中欧瑾尚混合型证券投资基金	2021 年 11 月 03 日	
19	中欧瑾添混合型证券投资基金	2021 年 11 月 09 日	2023 年 10 月 27 日
20	中欧永裕混合型证券投资基金	2022 年 12 月 16 日	
21	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)	2022 年 12 月 16 日	
22	中欧鼎利债券型证券投资基金	2024 年 01 月 16 日	

姓名	彭炜	性别	男
国籍	中国	最高学历、学位	研究生、硕士
其他公司历任	融通基金管理有限公司研究员、研究组组长、基金经理、研究部部门总经理		
本公司历任	无		
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	中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF)	2023 年 07 月 17 日	
2	中欧阿尔法混合型证券投资基金	2023 年 09 月 28 日	
3	中欧产业领航混合型证券投资基金	2024 年 03 月 19 日	

(2) 历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
魏博	2013 年 03 月 29 日	2022 年 12 月 16 日
周蔚文	2012 年 03 月 29 日	2014 年 01 月 10 日

5. 基金管理人投资决策委员会成员

卞玺云、葛兰、卢纯青、刘建平、蓝小康、王培、周蔚文担任权益投资决策委员会委员，负责权益投研领导工作。周蔚文为权益投资决策委员会主席。

卞玺云、陈凯杨、黄华、LI TONG、刘建平、桑磊、邵凯担任固定收益投资决策委员会委员，负责固收投研领导工作。邵凯为固收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。

三、基金管理人的职责

1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自基金合同生效之日起, 依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产;

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3) 发售基金份额;

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(5) 在符合有关法律法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则, 在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高赎回费率、托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

(6) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人, 对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(7) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的申购和赎回申请;

(8) 依据基金合同的约定, 转换本基金运作方式;

(9) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

(10) 自行担任或选择、更换注册登记机构, 获取基金份额持有人名册, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

(11) 选择、更换代销机构, 并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规, 对其行为进行必要的监督和检查;

(12) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(13) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

(14) 依法召集基金份额持有人大会;

(15) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金管理人的义务为:

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金净值信息、中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值、基金份额折算比例、盛世A份额与盛世B份额终止运作后的份额转换比例及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)的份额净值；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(18) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(19) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(27) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### 四、基金管理人承诺

1. 基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生。

2. 基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生。

4. 基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责。

5. 基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

## 五、基金经理承诺

1. 依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2. 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3. 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 六、基金管理人的内部控制制度

### 1. 内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 2. 内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:



(1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

(2) 监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

(3) 督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

(4) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

(5) 风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

(6) 监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

(7) 业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

### 3. 内部控制的措施

(1) 部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

(2) 严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

(3) 实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

(4) 建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

(5) 建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4. 基金管理人关于内部合规控制声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (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：北京市东城区东长安街甲2号广发银行大厦

法定代表人：王凯

成立时间：1988年7月8日

组织形式：股份有限公司

注册资本：217亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363号

联系人：倪彤欣

联系电话：(010) 65169618

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217亿元。三十余年来，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。

截至2023年12月31日，广发银行总资产3.51万亿元、总负债3.23万亿元、实现营业收入696.78亿元，净利润160.19亿元。

#### (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，内设客户营销处、保险与期货业务处、增值与外包业务处、业务运行处、内控与综合管理处，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。

部门负责人田卫来先生，经济学学士，经济师，具有二十余年银行从业经验，在综合金融、公司信贷等领域均有深入研究和丰富的实务经验。2013年4月加入

广发银行,先后担任支行行长、分行公司金融部总经理、总行公司金融部副总经理。2023年7月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部副总经理。

部门负责人胡杰先生,工商管理硕士,从事银行资管业务管理工作十八年,资管行业经验丰富。曾任头部大型基金管理有限公司理财中心总经理、机构理财部副总裁,私募股权公司高管,大型股份商业银行北京分行历任支行副行长、行长,二级分行副行长等职务。2019年加入广发银行,2021年1月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部副总经理。

### (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。截至2023年12月31日,托管资产规模37,887.87亿元,其中托管69只证券投资基金,规模4,322.48亿元。广发银行建立了一只优秀、专业的托管业务团队,保证了托管服务水准在行业的领先地位。目前,广发银行资产托管业务建立了完善的产品线,产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等,能为托管产品提供全面的托管服务。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### (二) 内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部,是全行资产托管业务的管理和运营部门,专设内控与综合管理处,配备了专职内部监察稽核人员,负责托管业务的内部控制和风险管理,具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### (三) 内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### 三、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的各项,对基金管理人进行业务监督、核查。

#### (一) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用资产托管业务基金监督系统,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### (二) 监督流程

1、每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、直销机构

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479号8层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层、10层、16层

法定代表人:竇玉明

联系人:马云歌

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

### 二、代销机构

各销售机构的具体名单见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。基金管理人可以根据情况针对某类基金份额变更、增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。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。各销售机构具体销售时间以及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、场内销售机构

A类份额场内销售机构:具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。

### 四、登记机构

本基金A类份额注册登记机构信息如下:

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：于文强

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

本基金 C 类、E 类份额注册登记机构信息如下：

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 479 号 8 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 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

联系人：杨毅

#### 五、出具法律意见书的律师事务所

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：安冬

#### 六、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 507 单元 01 室

执行事务合伙人：李丹

办公室地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：仲文渊

经办会计师：魏佳亮、仲文渊



## 第六部分 基金份额的分级

在分级运作期内，本基金的基金份额分级及其基本运作如下：

### 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括“中欧盛世份额”、“盛世 A 份额”与“盛世 B 份额”。其中，盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额配比在其存续期内始终保持 5:5 的比率不变。

### 二、基金的基本运作概要

1. 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金合同生效后，场外认购的全部份额将确认为中欧盛世份额；场内认购的全部份额将按 5:5 的比率确认为盛世 A 份额与盛世 B 份额。

2. 本基金合同生效后的分级运作期内，基金管理人可对中欧盛世份额开放申购、赎回，但不对盛世 A 份额与盛世 B 份额单独开放申购、赎回业务。

场内、场外申购赎回的具体事宜见本基金的基金合同和招募说明书。

3. 本基金合同生效后的分级运作期内，盛世 A 份额与盛世 B 份额只上市交易，不接受申购和赎回。

4. 本基金合同生效后的分级运作期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理中欧盛世份额与盛世 A 份额、盛世 B 份额之间的份额配对转换业务。

5. 本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对有关基金份额进行折算；折算所产生的中欧盛世份额不进行自动分拆。

本基金合同生效后三年的对应日（该对应日为非工作日，则顺延到下一个工作日），为盛世 A 份额与盛世 B 份额的运作到期折算日，届时盛世 A 份额与盛世 B 份额将按照基金合同的约定折算为中欧盛世份额的场内份额，本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）。

根据基金合同，本基金转换日为 2015 年 3 月 30 日，在转换日日终，盛世 A 份额、盛世 B 份额以各自的基金份额为基准转换为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）的基金份额。转型前场内的盛世 A 和盛世 B 将转为中欧盛世成长股票型证券投资基金（LOF）的场内基金份额，仍登记在证券登记结算系统下。

2015年7月17日,基金管理人经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,根据2014年8月8日修订后施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)第三十条第一项的规定,将本基金变更为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)。

### 三、盛世A份额与盛世B份额概要

#### 1. 存续期限

本基金在基金合同生效后三年的分级运作期内,中欧盛世份额开放申购、赎回,盛世A份额和盛世B份额分别在深圳证券交易所上市交易。本基金合同生效后满三年的对应日(该对应日为非工作日,则顺延到下一个工作日),为盛世A份额与盛世B份额的运作到期折算日,届时盛世A份额与盛世B份额将按照基金合同的约定折算为中欧盛世份额的场内份额,本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。本基金已于2015年3月30日分级运作期届满转换。

#### 2. 基金份额配比

盛世A份额与盛世B份额的基金份额数配比始终保持5:5的比率不变。

#### 3. 盛世A份额与盛世B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过,盛世A份额与盛世B份额可在分级运作期内即终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额表决权的2/3以上(含2/3)通过方为有效。

### 四、基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值。

#### 1. 中欧盛世份额的基金份额净值计算

中欧盛世份额的基金份额净值计算公式为:

$$T \text{ 日中欧盛世份额的基金份额净值} = T \text{ 日闭市后的基金资产净值} / T \text{ 日本基金的基金份额 (包括所有处于存续期的基金份额) 余额总数}$$

例：假设 T 日闭市后，本基金的基金资产净值为 55 亿元，中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额余额分别为 12 亿份、20 亿份与 20 亿份，则中欧盛世份额的基金份额净值计算如下：

$$T \text{ 日中欧盛世份额的基金份额净值} = 55 / (12 + 20 + 20) = 1.058 \text{ 元}$$

## 2. 盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额净值计算

(1) 本基金 5 份盛世 A 份额与 5 份盛世 B 份额构成一对份额组合，一对盛世 A 份额与盛世 B 份额的份额组合的净值之和将等于 10 份中欧盛世份额的净值。

(2) 盛世 A 份额的约定收益率为 6.50%；盛世 A 份额的约定收益率除以 365 为盛世 A 份额的约定日简单收益率。盛世 A 份额的日基准收益以初始面值 1.000 元为基准采用盛世 A 份额的约定日简单收益率单利进行计算。

(3) 盛世 B 份额的份额净值根据中欧盛世份额的份额净值、盛世 A 份额的份额净值以及中欧盛世份额、盛世 A 份额、盛世 B 份额的份额净值关系计算。

(4) 如果根据上述计算规则计算出来的盛世 B 份额的份额净值小于或等于盛世 A 份额净值的 0.25 倍，或者计算出来的盛世 B 份额的份额净值大于或等于盛世 A 份额净值的 2.00 倍，则基金管理人将根据基金合同约定，对本基金相关份额进行折算，并调整基金份额净值。

(5) 折算后盛世 A 份额与盛世 B 份额的份额净值计算方法保持不变。

(6) 盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额净值计算公式

基金份额净值初始为 1.000 元。本基金基金合同生效后第  $t$  个自然日，中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额净值分别为  $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ 。则第  $t$  个自然日，盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额净值计算如下：

$$\text{当 } t=1 \text{ 时, } NAV(A)_1 = 1.000 + (6.5\%/365)$$

$$\text{当 } t \geq 2 \text{ 时, } NAV(A)_t = NAV(A)_{t-1} + (6.5\%/365)$$

其中  $NAV(A)_{t-1}$  为盛世 A 份额在  $t-1$  个自然日的基金份额净值

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.5 \times NAV(A)_t) / 0.5$$

## 第七部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2011年10月13日证监许可[2011]1658号文核准募集发售。募集期为2012年2月15日至2012年3月23日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期共募集520,524,217.77份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为6,322户。

## 第八部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金基金合同于2012年3月29日正式生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内,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,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

### 三、基金份额类别

本基金分级运作期满后根据注册登记机构或申购费、销售服务费收取方式的不同,将中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额分为不同的类别。A类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司;C类和E类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司。

本基金A类基金份额、C类和E类基金份额分别设置代码,A类基金份额通过场外和场内两种方式销售,并在交易所上市交易(场内份额上市交易,场外份额不上市交易,下同),A类基金份额持有人可进行跨系统转登记;C类和E类基金份额通过场外方式销售,不在交易所上市交易,C类和E类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定,并在《招募说明书》中公告。

根据基金运作情况,基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下,经与基金托管人协商一致后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者增加新的基金份额类别等,调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

## 第九部分 基金份额的上市交易

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的盛世A份额、盛世B份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额上市交易。基金份额上市后,投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖盛世A份额、盛世B与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)的A类基金份额。

### 一、上市交易的地点

深圳证券交易所

### 二、上市交易的时间

盛世A份额与盛世B份额已于2012年4月27日开始在深圳证券交易所上市交易,并于2015年3月30日终止上市。本基金完成基金转型后,中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的A类基金份额已于4月21日开始在深圳交易所上市交易。

### 三、上市交易的规则

1. 盛世A份额、盛世B份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额分别采用不同的交易代码上市交易;

2. 盛世A份额、盛世B份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一工作日的基金份额净值;

3. 盛世A份额、盛世B份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

### 四、上市交易的费用

盛世A份额、盛世B份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

### 五、上市交易的行情揭示

盛世A份额、盛世B份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

## 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

盛世 A 份额、盛世 B 份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

七、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于中欧盛世份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额(包括A类份额、E类份额及C类份额,下同)的场外申购和赎回业务。

### 一、场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务:

1. 本基金管理人的直销机构。
2. 不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售机构由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等相关公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类份额变更或增减基金代销机构,并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人或代销机构另行公告。

### 二、场外申购与赎回的开放日及办理时间

1. 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理中欧盛世份额的申购,具体业务办理时间在基金管理人届时发布的公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理中欧盛世份额的赎回,具体业务办理时间在基金管理人届时发布的公告中规定。

本基金不接受盛世A份额与盛世B份额的申购或赎回申请。投资人可在申购中欧盛世份额后按基金合同约定申请分拆为盛世A份额与盛世B份额,或可将其持有的盛世A份额与盛世B份额申请合并为中欧盛世份额后申请赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

2. 申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日(基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外)。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的申购、赎回或者转换。投资人



在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回、转换的价格。

3. 若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4. 本基金A类份额自2015年4月1日起开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务,本基金E类份额自2015年10月8日起开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务,本基金C类份额自2017年1月12日起开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。。

### 三、场外申购与赎回的原则

1. “未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额净值为基准进行计算;

2. “金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3. 场外赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人持有的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额在注册登记系统确认时间的先后次序进行顺序赎回;

4. 当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 四、场外申购与赎回的程序

#### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),正常情况下,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)到销售机构或以销售机构规定的其他方式及时查询申购与赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人,该退回款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后,基金管理人在T+7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时,款项的支付办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

## 五、场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请受理后,注册登记机构在T+1日为投资人办理增加权益的登记手续,投资人自T+2日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后,注册登记机构在T+1日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资人的合法权益,并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 六、场外申购与赎回的限制

### 1. 申购金额的限制

场外申购时,其他销售机构的销售网点每个账户首次单笔申购本基金A类份额的最低金额为1元人民币,追加申购单笔最低金额为0.01元。其他销售机构的销售网点每个账户首次单笔申购本基金E类和C类份额的最低金额为1元,追加申购单笔最低金额为0.01元。。在不违反前述规定的前提下,各销售机构对本

基金单笔最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

直销机构每个账户首次申购的最低金额为10,000元人民币,追加申购单笔最低金额为10,000元人民币。

## 2. 赎回份额的限制

场外赎回时,本基金A类份额赎回的最低份额为0.01份基金份额,本基金E类和C类份额赎回申请不得低于0.01份基金份额。本基金A类、E类和C类份额的最低保留份额为0.01份。若某笔份额减少类业务导致单个基金交易账户的该类份额的基金份额余额不足0.01份,登记机构有权对该基金份额持有人在基金交易账户持有的该类基金份额做全部赎回处理(份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户等业务,具体种类以相关业务规则为准)。

3. 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告并报中国证监会备案。

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

## 七、场外申购费用和赎回费用

### 1. 申购费用

本基金A类、E类基金份额在投资人申购时收取申购费,C类基金份额不收取申购费。申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户实施优惠的申购费率。

养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:

- (1) 全国社会保障基金;
- (2) 可以投资基金的地方社会保障基金;
- (3) 企业年金单一计划以及集合计划;

- (4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
- (5) 企业年金养老金产品;
- (6) 职业年金计划;
- (7) 养老目标基金;
- (8) 个人税收递延型商业养老保险等产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围, 并按规定向中国证监会备案。其他客户指除通过基金管理人直销中心申购的养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类份额和 E 类份额的养老金客户的优惠申购费率见下表:

	申购金额 (M)	费率
申购费率	M < 50 万元	0.15%
	50 万元 ≤ M < 100 万元	0.10%
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.05%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

其他客户申购本基金的申购费率见下表:

中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) A 类份额和 E 类份额场外申购费率如下表:

单笔金额 (M)	收费标准
M < 50 万元	1.5%
50 万元 ≤ M < 100 万元	1.0%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

## 2. 赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担, 中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金 (LOF) A 类份额和 E 类份额不低于赎回费总额的 25% 归基金财产, 其余部分作为注册登记等其他必要的手续费; 对持续持有中欧盛世成长混合型证券投

资基金(LOF)C类份额少于30日的赎回费全额计入基金财产。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

(1) 中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额和E类份额场外赎回费率如下表:

持有基金份额期限(N)	收费标准
$N < 7$ 天	1.50%
$7 \text{ 天} \leq N < 365$ 天	0.50%
$365 \text{ 天} \leq N < 730$ 天	0.25%
$N \geq 730$ 天	0

(2) 中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)C类份额场外赎回费率如下表:

持有基金份额期限(N)	收费标准
$N < 7$ 天	1.50%
$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	1.00%
$N \geq 30$ 天	0

在场外认购、场外申购的投资者其份额持有期限以份额实际持有期限为准;

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式,最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### 八、场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

##### 1. 申购份额与赎回金额的处理方式:

(1) 申购份额、余额的处理方式: 场外申购时, 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后, 以有效申请当日中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额净值为基准计算, 四舍五入保留到小数点后两位, 由此产生的收益或损失由基金财产承担;

(2) 赎回金额的处理方式: 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额净值

并扣除相应的费用,四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2. 申购份额的计算:

1) 若投资者选择申购 A 类(或 E 类)基金份额,则申购份额的计算公式为:

当申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时,申购份数的计算方法如下:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日该类基金份额净值}$$

例:某投资人(其他客户)投资 40,000 元申购中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额(或 E 类份额),申购费率为 1.5%,假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元,则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购金额} = 40,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 40,000 / (1 + 1.5\%) = 39,408.87 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 40,000 - 39,408.87 = 591.13 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (40,000 - 591.13) / 1.0400 = 37,893.14 \text{ 份}$$

即:某投资人(其他客户)投资 40,000 元申购中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额(或 E 类份额),假设申购当日对应的份额净值为 1.0400 元,则可得到 37,893.14 份中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额(或 E 类份额)。

2) 若投资者选择申购 C 类基金份额,则申购份额的计算公式为:

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额的基金份额净值}$$

例:某投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额,假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元,则可得到的申购份额为:

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.0000 = 100,000.00 \text{ 份}$$

即：投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 C 类基金份额 100,000.00 份。

### 3. 场外赎回支付金额的计算：

赎回总额 = T 日申请份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

例：某投资人赎回 10,000 份中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日对应基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 = 10,000 × 1.0160 = 10,160 元

赎回费用 = 10,160 × 0.50% = 50.80 元

赎回金额 = 10,160 - 50.80 = 10,109.20 元

即：投资人赎回中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额 10,000 份基金份额，假设赎回当日对应的中欧盛世份额基金份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

## 九、拒绝或暂停场外申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) 份额场外申购申请。此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运转。
2. 证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、注册登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允

价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

5. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6. 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

7. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%,或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形时。

8. 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、4、6、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被部分或全部拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十、暂停场外赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的场外赎回申请或延缓支付赎回款项。此时,本基金的转出申请将按同样方式处理:

1. 因不可抗力导致基金无法正常工作。

2. 证券交易所交易时间临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。



发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付,但最长不超过 20 个工作日,并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

若本基金(分级运作期内指中欧盛世份额,分级运作期满后指中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额)单个开放日,净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额(分级运作期内包括中欧盛世份额、盛世 A 份额、盛世 B 份额)的 10%,即认为是发生了巨额赎回。

### 2. 巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定场外赎回申请全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止(但若本基金分级运作期满,则中欧盛世份额仅延期至分级运作期到期日,截至该日未办理的赎回申请将被撤销);选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净

值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的,基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理,对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。

(4) 暂停赎回:中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2. 本基金发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的该类基金份额的基金份额净值。

## 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额与基金管理人管理、且由同一注册登记机构办理注册登记的的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布

公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十五、基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 第十一部分 基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于中欧盛世份额及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A类基金份额通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

### 一、投资人范围

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

### 二、使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A类基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户(账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告)。

### 三、场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单(有可能进行调整或变更)可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。

### 四、申购与赎回的办理时间

1. 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理中欧盛世份额的申购,具体业务办理时间在基金管理人届时发布的公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理中欧盛世份额的赎回,具体业务办理时间在基金管理人届时发布的公告中规定。

本基金不接受盛世A份额与盛世B份额的申购或赎回申请。投资人可在申购中欧盛世份额后按基金合同约定申请分拆为盛世A份额与盛世B份额,或可将其持有的盛世A份额与盛世B份额申请合并为中欧盛世份额后申请赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

2. 申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日(基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外)。开放日业务办理具体时间为交易所的交易时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且注册登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

3. 若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4. 中欧盛世份额自2012年4月27日起开始办理场内申购、赎回业务。2015年3月30日为中欧盛世成长分级股票型证券投资基金的份额转换日,当天开始暂停办理中欧盛世份额的场内申购、赎回业务。自2015年4月1日起,恢复办理中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)份额的场内申购、赎回业务。2015年7月17日,中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)更名为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)。2015年10月8日,原中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额更名为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额。

#### 五、场内申购和赎回的原则

1. “未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额净值为基准进行计算;

2. “金额申购,份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3. “全额缴款”原则,投资人申购中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额时,必须全额缴付申购款项,只有在投资人全额交付申购款项后,申购申请方为有效;

4. 当日的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额场内申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销;

5. 基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时,需遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规

则,若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行。

基金管理人可根据基金运作的实际情况调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 六、场内申购和赎回的程序

### 1. 申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金,否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时,应确保账户内有足够中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额余额,否则赎回申请无效。

### 2. 申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下,T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,申购款项将退回投资人账户,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人赎回申请成功后,基金托管人按有关规定将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

关于“巨额赎回的认定”和“巨额赎回的公告”参照第十章相关内容规定。

## 七、场内申购和赎回的数额限制

1. 单笔场内申购的最低金额为1元,同时申购金额必须是整数金额。
2. 基金管理人可根据市场情况,在不违反相关法律法规规定的前提下,调整上述限制。如调整上述限制的,基金管理人必须在调整3个工作日前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。
3. 申购份额、余额的处理方式:中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日该类的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位,计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。
4. 赎回金额的处理方式:中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的该类基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元,赎回金额保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 八、申购费用和赎回费用

1. 本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额场内申购费率如下表:

单笔金额(M)	收费标准
M<50万元	1.5%
50万元≤M<100万元	1.0%
100万元≤M<500万元	0.5%
M≥500万元	每笔1000元

2. 投资人可将其持有的全部或部分中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额赎回。持续持有期低于7天的赎回费全额计入基金财产,持续持有期在7天以上(含)的赎回费25%计入基金财产,其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内份额的赎回费率见下表:

持有基金份额期限(N)	收费标准
N<7天	1.50%

7天≤N	0.50%
------	-------

3. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### 九、场内申购份额和赎回金额的计算方式

1. 中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额申购份额的计算

当申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时,申购份数的计算方法如下:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日该类基金份额净值}$$

场内申购份额保留到整数位,计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例:某投资人投资40,000元申购中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额,申购费率为1.5%,假设申购当日基金份额净值为1.0400元,则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购金额} = 40,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 40,000 / (1 + 1.5\%) = 39,408.87 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 40,000 - 39,408.87 = 591.13 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (40,000 - 591.13) / 1.0400 = 37,893.14 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份,故投资人申购所得中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类基金份额为37,893份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为:

$$\text{实际净申购金额} = 37,893 \times 1.0400 = 39,408.72 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 40,000 - 39,408.72 - 591.13 = 0.15 \text{ 元}$$



即：投资人投资 40,000 元从场内申购本基金，假设申购当日对应基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到基金份额 37,893 份，退款 0.15 元。

## 2. 场内赎回金额的计算

赎回总金额 = T 日赎回份额 × T 日该类基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回 10,000 份中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日对应的基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 = 10,000 × 1.0160 = 10,160 元

赎回费用 = 10,160 × 0.50% = 50.80 元

赎回金额 = 10,160 - 50.80 = 10,109.20 元

即：投资人赎回中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类基金份额 10,000 份，假设赎回当日对应基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

3. T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在次日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

## 十、场内申购与赎回的登记结算

中欧盛世或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类基金份额场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

十一、办理中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

十二、有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第十章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所所有关规定，并据此执行。

## 第十二部分 基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### 一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### 二、基金份额的登记

1. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的中欧盛世份额或场外申购的中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下;场内认购或申购、配对转换的中欧盛世份额、场内申购的中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额或上市交易买入、配对转换的盛世A份额与盛世B份额或上市交易买入的中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额登记在证券登记结算系统持有人深圳证券账户下。

2. 登记在证券登记结算系统中的中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额可直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额如需办理场外赎回,应当办理跨系统转登记后方可实施。

3. 登记在注册登记系统中的中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类份额可直接申请场外赎回。登记在注册登记系统中的中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)A类份额如需办理场内赎回或

分拆成盛世 A 份额、盛世 B 份额进行上市交易,应当办理跨系统转登记后方可实施。

### 三、系统内转托管

1. 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的某类基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

2. 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额场外赎回业务的销售机构(网点)时,应依照销售机构(网点)规定办理中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额系统内转托管。

3. 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理盛世 A 份额、盛世 B 或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额上市交易或中欧盛世份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额场内赎回的会员单位(席位)时,应办理已持有基金份额的系统内转托管。

### 四、跨系统转登记

1. 跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的中欧盛世份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) A 类份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2. 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)的场外 A 类基金份额的基金份额持有人可通过跨系统转登记业务将场外 A 类基金份额转登记到场内后进行上市交易, E 类和 C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。

## 第十三部分 基金的投资

### 一、投资目标

把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金投资于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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的3%；债券等固定收益类资产以及现金占基金资产的5%~40%，其中现金（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金融工具，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资策略

本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。

#### 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证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、上市公司盈利能力、股票市场估值水平、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。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。本基金据此调整股票资产配置策略。

#### 2. 行业配置策略

### (1) 经济周期与行业分析

各行业变动时，往往呈现出较为明显的、可预测的增长或衰退的格局。这些变动与国民经济总体的周期变动是有关系的，但关系密切的程度又不一样。据此，可以将行业分为三类。

#### 1 增长型行业

增长型行业的运行状态与经济活动总水平的周期及其振幅并不紧密相关。这些行业收入增长的速率并不总是随着经济周期的变动而出现同步变动，因为它们主要依靠技术的进步、新产品推出及更优质的服务，从而使其经常呈现出增长形态。

本基金将重点投资于增长型行业，因为这些高增长的行业受到国民经济的周期波动的影响较小。在经济高涨时，高增长行业的发展速度通常高于平均水平；在经济衰退时期，其所受影响较小甚至仍能保持一定的增长。

#### 2 周期型行业

周期型行业的运行状态与经济周期紧密相关。当经济处于上升时期，这些行业会紧随其扩张；当经济衰退时，这些行业也相应衰落，且该类型行业收益的变化幅度往往会在一定程度上夸大经济的周期性。该类型行业的产品需求收入弹性一般较高。

本基金将根据对宏观经济景气周期和金融货币政策变化的研判，运用“投资时钟理论”，适度投资于不同经济周期阶段处于景气复苏以及景气上升阶段的行业。在经济复苏时，适度增加周期型的成长投资；在经济过热期，适度增加周期型的价值投资。

#### 3 防守型行业

防守型行业的经营状况在经济周期的上升和下降阶段都很稳定。该类型行业的产品需求相对稳定，需求弹性小；经济周期处于衰退阶段对这种行业的影响也比较小；甚至有些防守型行业在经济衰退时期还会有一定的实际增长。

本基金将结合对经济周期的研判和投资组合在稳健收益和资本利得两类资本增值方式之间中长期的合理配比而适度投资于防守型行业。在经济衰退期，适度增加防守型的成长投资；在经济滞胀期，适度增加防守型的价值投资。

#### 4 行业类型的识别

本基金分析某行业是否属于增长型行业或者是否属于周期型行业,主要利用该行业的历年统计资料与国民经济综合指标进行对比,具体而言是将某行业历年的营业收入等经营指标与同期国内生产总值等指标进行比较:如果大多数年份行业增长率都高于国民经济综合指标的增长率,说明这一行业是增长型行业;如果行业的营业收入与国民经济综合指标同向变化,说明这一行业很可能是周期型行业;如果行业的营业收入在国民经济综合指标呈现不同方向和不同幅度变化时都保持相对稳定,说明该行业是防守型行业。

## (2) 增长型行业的具体识别

### 1 行业生命周期

通常,每个行业都要经历一个由成长到衰退的发展演变过程。这个过程便称为行业的生命周期。一般来说,行业的生命周期可分为幼稚期、成长期、成熟期和衰退期。

处于幼稚期行业的上市公司因其较高的产品成本和价格和较小的市场需求之间的矛盾,往往面临较大的市场风险,而且还可能因为财务困难而引发破产风险。因此本基金原则上不投资于幼稚期行业。

处于成长期的行业的上市公司增长非常迅猛,部分优势企业能够脱颖而出,企业的投资者往往也能获得极高的投资回报。本基金将积极挖掘处于成长期的优质上市公司进行投资。

处于成熟期行业的上市公司,行业增长速度降到一个适度水平,行业的发展可能难以与国民生产总值同步增长。但由于技术创新、产业政策、经济全球化等各种原因,某些行业可能会在进入成熟期之后迎来新的增长。本基金将根据投资组合在稳健收益和资本利得两类资本增值方式之间中长期的合理配比适度投资于成熟期行业的上市公司。

处于衰退期行业的上市公司面临市场需求减少,收入利润增长停滞甚至不断下降的局面。因此本基金原则上不投资于衰退期行业。

### 2 行业成长能力的考察

本基金主要从以下六个方面考察行业的成长能力:

A. 需求弹性。一般而言,需求弹性较高的行业成长能力也较强。

B. 生产技术。技术进步快的行业，创新能力强，生产率上升快，容易保持优势地位，其成长能力也强。

C. 产业关联度。产业关联度是指产业与产业之间通过产品供需而形成的互相关联、互为存在前提条件的内在联系。产业关联度强的行业，成长能力也强。

D. 市场容量与潜力。市场容量与市场潜力大的行业，其成长空间也大。

E. 行业在空间的转移活动。行业在空间转移活动停止，一般可以说明行业成长达到市场需求边界，成长期也就进入尾声。

F. 产业组织变化活动。在行业成长过程中，一般伴随着行业中企业组织不断向集团化、大型化方向发展。

### 3 影响行业兴衰的主要因素

一个行业的兴衰会受到技术进步、产业政策、产业组织创新、社会习惯改变和经济全球化等因素的影响而发生变化，这些因素都会对行业在其生命周期上的发展轨迹构成影响。基金管理人将密切关注可能影响各行业兴衰发展变化的因素，及时发现并积极投资于处于高速增长期的行业。

#### 3. 个股投资策略

个股投资策略是对于行业配置策略的具体落实。本基金将在行业配置策略的框架下，精选优质股票构建投资组合，在获取股票行业配置收益的同时，最大化个股投资收益。

##### (1) 备选股票库

备选股票库由公司投资研究团队负责建立和维护。投资研究团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等，预测上市公司未来盈利成长前景，并据此申请将股票纳入备选股票库，履行股票入库审批程序；同时，根据行业和上市公司基本面的变化对备选股票库进行动态维护和更新。

##### (2) 个股的选择

在完成行业配置的基础上，本基金将以“优中选优”的思路选择优质行业中的优质公司进行投资。以上市公司的历史成长性和未来两年的预期成长性为核心，通过对上市公司所在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行分解评估，选择那



些短期内利润增长速度高于同行业平均水平,并有可能在中长期保持较高增长势头的企业进行投资。

在个股选择过程中,本基金将挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票。本基金将根据各个行业的不同行业特征,选择合适的股票估值方法,包括PE、PB、PEG、EV/EBITDA等,与国内外同行业类似公司进行比较,排除股价被大幅高估的股票,主要投资估值处于合理水平或被低估的公司。

4. 对于存托凭证的投资,本基金将依照境内上市交易的股票,通过定性分析和定量分析相结合的方式,精选优质上市公司;并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。

#### 5. 固定收益类证券投资策略

本基金根据对利率走势的预判,对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。当预期利率下降时,增加组合久期,以获得债券价格上升带来的收益;当预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下跌的风险。

本基金在确定固定收益类资产组合久期后,针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构,包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整。

#### 6. 权证及其他品种投资策略

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,谨慎进行投资。

### 四、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、投资策略组负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受风险管理部、监察稽核部的监督和信息技术部、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。

投资策略组负责人负责本策略组内投资策略和内外部沟通工作，并监控、审查基金资产的投资业绩和策略风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神，结合证券池及有关研究报告，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理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

#### 5、风险分析与绩效评估

研究部负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

#### 6、组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化,结合基金当期的申购和赎回现金流量情况,以及组合风险与绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整。

## 五、业绩比较基准

业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 75%+中证全债指数收益率 $\times$ 25%

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。它的推出,丰富了市场现有的指数体系,增加了一项用于观察市场走势的指标,有利于投资者全面把握市场运行状况。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

沪深 300 指数和中证全债指数具有广泛的市场代表性和较高的透明度,选用该业绩标准能够较为忠实反映本基金的风险收益特征,同时也能比较贴切地体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

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。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

## 七、投资限制

### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;
- (2) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的 10%;
- (4) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
- (6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
- (7) 股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%~95%,其中权证资产比例不超过基金资产净值的 3%;债券等固定收益类资产以及现金占基金资产的 5%~40%;
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(15) 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%;

(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;

(19) 法律法规或中国证监会规定的其他限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

除上述第(12)、(15)、(16)、(17)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，或中国证监会规定禁止的其他活动；

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 八、基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十、基金投资组合报告

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。

本投资组合报告所载数据取自本基金2024年第1季度报告,所载数据截至2024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	467,483,422.16	94.17
	其中:股票	467,483,422.16	94.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	26,695,204.53	5.38
8	其他资产	2,237,058.61	0.45
9	合计	496,415,685.30	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	31,352,686.50	6.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	408,086,069.04	82.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,150.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,580,404.82	4.16
J	金融业	7,425,432.00	1.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,097.60	0.00

M	科学研究和技术服务业	15,750.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,831.99	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	467,483,422.16	94.53

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港股通投资股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	278,800	43,648,928.00	8.83
2	300274	阳光电源	404,300	41,966,340.00	8.49
3	002992	宝明科技	603,000	27,526,950.00	5.57
4	601689	拓普集团	356,100	22,501,959.00	4.55
5	002840	华统股份	1,033,500	21,899,865.00	4.43
6	002475	立讯精密	720,300	21,184,023.00	4.28
7	300502	新易盛	296,504	19,865,768.00	4.02
8	600809	山西汾酒	80,700	19,777,956.00	4.00
9	603606	东方电缆	390,442	17,288,771.76	3.50
10	600276	恒瑞医药	335,600	15,427,532.00	3.12

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 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

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	392,326.50
2	应收证券清算款	1,674,489.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	170,243.11
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,237,058.61

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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。

## 第十四部分 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2012年3月29日,本次更新基金业绩截止日2024年3月31日。

### 中欧盛世成长混合(LOF)A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差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
2019.01.01-2019.12.31	46.00%	1.28%	27.99%	0.93%	18.01%	0.35%
2020.01.01-2020.12.31	92.57%	1.73%	21.29%	1.07%	71.28%	0.66%
2021.01.01-2021.12.31	-6.32%	1.84%	-2.29%	0.88%	-4.03%	0.96%
2022.01.01-2022.12.31	-25.35%	2.10%	-15.67%	0.96%	-9.68%	1.14%
2023.01.01-2023.12.31	-13.25%	1.26%	-7.33%	0.63%	-5.92%	0.63%
2012.03.29-2024.03.31	302.93%	1.63%	57.99%	1.02%	244.94%	0.61%

### 中欧盛世成长混合(LOF)C

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差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
----	------------	-----------	------------	---------------	-----	-----

2019.01.01-2019.12.31	45.22%	1.28%	27.99%	0.93%	17.23%	0.35%
2020.01.01-2020.12.31	91.10%	1.73%	21.29%	1.07%	69.81%	0.66%
2021.01.01-2021.12.31	-7.07%	1.84%	-2.29%	0.88%	-4.78%	0.96%
2022.01.01-2022.12.31	-25.95%	2.10%	-15.67%	0.96%	-10.28%	1.14%
2023.01.01-2023.12.31	-13.94%	1.26%	-7.33%	0.63%	-6.61%	0.63%
2017.01.13-2024.03.31	29.08%	1.57%	16.38%	0.87%	12.70%	0.70%

中欧盛世成长混合 (LOF) E

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差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
2019.01.01-2019.12.31	46.07%	1.28%	27.99%	0.93%	18.08%	0.35%
2020.01.01-2020.12.31	92.59%	1.73%	21.29%	1.07%	71.30%	0.66%
2021.01.01-2021.12.31	-6.33%	1.84%	-2.29%	0.88%	-4.04%	0.96%
2022.01.01-2022.12.31	-25.35%	2.10%	-15.67%	0.96%	-9.68%	1.14%
2023.01.01-2023.12.31	-13.25%	1.26%	-7.33%	0.63%	-5.92%	0.63%
2015.10.13-2024.03.31	49.76%	1.58%	15.04%	0.90%	34.72%	0.68%

本产品于 2020/10 修改投资范围，增加存托凭证为投资标的。

## 第十五部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以本基金的名义开设基金银行账户(即基金托管专户)和证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

## 第十六部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 二、估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

#### 2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值;

(3) 发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值。

4. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

5. 本基金投资存托凭证的估值核算, 依照境内上市交易的股票执行。

6. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

7. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 因此, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人根据基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 四、估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后, 基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算, 精确到 0.001 元, 小数点后第四位四舍五入。国家另有规定

的,从其规定。分级运行结束后本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值,并按规定公告。

2. 基金管理人应当每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值(含各类基金份额的基金份额净值,下同)小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

##### 1. 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担



赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金注册登记机构交易数据的, 由基金注册登记机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 通报基金托管人, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时, 基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时, 基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额净值计算错误, 给基金或基金份额持有人造成损失的, 应当按照法律法规的规定向基金或基金份额持有人进行赔偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差, 以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障投资人的利益, 已决定延迟估值;

4. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 基金管理人经与基金托管人协商一致的;

5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托

管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额将分别计算基金份额净值。

#### 八、特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十七部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金的收益分配比例以期末（收益分配基准日）可供分配利润为基准计算。基金期末可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、收益分配原则

基金收益分配应遵循下列原则：

1. 分级运作期内，本基金不进行收益分配。
2. 本基金分级运作期满并转换为中欧盛世成长混合型证券投资基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）本基金的同一类别每份基金份额享有同等分配权；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

（4）场外中欧盛世成长混合型证券投资基金（LOF）份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日该类别的基金份额净值自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资人不选择，默认的收益分配方式是现金分红；场内中欧盛世成长混合型证券投资基金（LOF）A类份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金份额持有人可对A类基金份额、E类基金份额和C类基金份额分别选择不同的分红方式。

（5）在符合有关法律法规规定和基金合同约定的基金分红条件的前提下，收益每年最多分配12次；

(6) 每次分配比例不低于期末可供分配利润的 10%，且基金红利发放日距离收益分配基准日（期末可供分配利润计算截止日）的时间不超过 15 个工作日；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

## 第十八部分 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/期货交易费用;
8. 基金的银行汇划费用;
9. 基金上市年费;
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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

#### E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

#### 3、基金的销售服务费

本基金A类、E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0.80%,销售服务费按照前一日C类基金份额的基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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3个工作日内从基金财产中支付到指定账户。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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

4. 除管理费、托管费外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

#### 三、不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

四、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

#### 五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务,基金托管人不承担代扣代缴义务。

## 第十九部分 基金份额折算

根据基金份额折算日的触发条件不同,基金份额折算日分为基金份额到期折算日和基金份额到点折算日,基金份额折算也相应地分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

### 一、基金份额折算日

本基金合同生效后满三年的对应日(该对应日为非工作日,则顺延到下一个工作日),为盛世A份额与盛世B份额的运作到期折算日,届时盛世A份额与盛世B份额将按照基金合同的约定折算为中欧盛世份额的场内份额,本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。

除以上到期折算外,在盛世A份额与盛世B份额的存续期内,本基金还将在以下两种情况进行份额折算,即:当盛世B份额的基金份额净值大于或等于盛世A份额的基金份额净值的2.00倍时;当盛世B份额的基金份额净值小于或等于盛世A份额的基金份额净值的0.25倍时。

具体的基金份额折算日见基金管理人届时发布的公告。

### 二、基金份额到期折算

#### 1. 基金份额到期折算

在本基金合同生效日满三年的对应日(该对应日为非工作日,则顺延到下一个工作日),无需召开基金份额持有人大会,盛世A份额与盛世B份额自动折算为中欧盛世份额的场内份额。届时,按照基金合同的相关约定分别对盛世A份额和盛世B份额计算基金份额净值,并按照各自的份额净值自动折算为中欧盛世份额的场内份额。其后,本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。

#### 2. 到期折算日确定

盛世A份额和盛世B份额的基金份额到期折算日为基金合同生效日满三年的对应日。如该对应日为非工作日,则到期折算日顺延到下一个工作日。折算日的确定日期,见基金管理人届时发布的公告。

#### 3. 到期折算方式及份额计算



盛世 A 份额和盛世 B 份额的基金份额到期折算日日终,基金管理人将根据盛世 A 和盛世 B 基金份额折算比例将基金份额持有人到期折算日登记在册的两类基金份额折算为场内中欧盛世份额并不再分拆。折算后,场内、场外中欧盛世份额的份额净值均调整为 1.000 元,基金份额数相应增加或减少,其后本基金将更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。具体折算公式为:

盛世 A 份额折算成的净值为 1.000 元的场内中欧盛世份额的份额数 = 折算前盛世 A 份额基金份额数 × 折算日盛世 A 份额基金份额净值 / 1

盛世 B 份额折算成的净值为 1.000 元的场内中欧盛世份额的份额数 = 折算前盛世 B 份额基金份额数 × 折算日盛世 B 份额基金份额净值 / 1

中欧盛世份额折算后净值为 1.000 元基金份额数 = 折算前中欧盛世份额基金份额数 × 折算日中欧盛世份额基金份额净值 / 1

投资者在折算完成后持有的净值为 1.000 元中欧盛世份额总数即为上述三项计算结果之和。

其中,折算后基金份额数,场外保留到小数点后 2 位,场内保留到整数位。

#### 4. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停盛世 A 份额与盛世 B 份额的上市交易和中欧盛世份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 5. 分级运作期满的公告

(1) 分级运作期到期前,基金管理人将在临时公告中提示公告相关规则。

(2) 基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒介和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

#### 6. 分级运作期到期后基金的投资管理

(1) 分级运作期到期转为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)后,本基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变;

(2) 分级运作期到期转为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)后,本基金的有关投资限制继续符合基金合同的约定。

### 三、基金份额到点折算

除以上到期折算外,在盛世 A 份额与盛世 B 份额的存续期内,本基金还将在以下两种情况进行份额折算,即:当盛世 B 份额的基金份额净值大于或等于盛世 A 份额的基金份额净值的 2.00 倍时;当盛世 B 份额的基金份额净值小于或等于盛世 A 份额的基金份额净值的 0.25 倍时。

但如在到期折算日前的一周内触发上述到点折算条件,则基金管理人将根据市场情况酌情决定是否进行到点折算。

1. 盛世 B 份额的基金份额净值大于或等于盛世 A 份额的基金份额净值的 2.00 倍时,本基金将按照以下规则进行份额折算。

(1) 基金份额折算基准日

盛世 B 份额的基金份额净值大于或等于盛世 A 份额的基金份额净值的 2.00 倍时,基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的盛世 B 份额和中欧盛世份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当盛世 B 份额的基金份额净值大于等于盛世 A 份额的基金份额净值的 2.00 倍后,本基金将分别对盛世 B 份额和中欧盛世份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保盛世 A 份额和盛世 B 份额的比例为 5:5,份额折算后盛世 B 份额和中欧盛世份额的基金份额净值均调整为与折算前盛世 A 份额基金份额净值相等,其收益超出部分折算为中欧盛世份额;盛世 A 份额的基金份额净值和份额数保持不变。具体的折算公式为:

1 盛世 A 份额

$$NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{折}} = NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}}$$

$$NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折}} = NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}}$$

其中：

$NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}}$ ：折算前盛世 A 份额的基金份额数；

$NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{折}}$ ：折算后盛世 A 份额的基金份额数，与折算前保持不变；

$NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}}$ ：折算前盛世 A 份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折}}$ ：折算后盛世 A 份额的基金份额净值，与折算前保持不变。

### ②①① 盛世 B 份额

盛世 B 份额的份额数在折算前后保持不变；盛世 B 份额持有人折算后获得新增的份额数，即盛世 B 份额基金份额净值超出盛世 A 份额基金份额净值以上的部分全部折算为中欧盛世份额的场内份额。

$$NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{折}} = NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{折前}}$$

$$NAV_{\text{盛世 B}}^{\text{折}} = NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}}$$

盛世 B 份额持有人折算后新增的场内中欧盛世份额数

$$= \frac{NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{折前}} \times (NAV_{\text{盛世 B}}^{\text{折前}} - NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折前}})}{NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}}$$

其中：

$NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{折前}}$ ：折算前盛世 B 份额的基金份额数；

$NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{折}}$ ：折算后盛世 B 份额的基金份额数，与折算前保持不变；

$NAV_{\text{盛世 B}}^{\text{折前}}$ ：折算前盛世 B 份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}$ ：折算后中欧盛世份额的基金份额净值。

### ③中欧①① 盛世份额

场外中欧盛世份额持有人份额折算后获得新增场外中欧盛世份额，场内中欧盛世份额持有人份额折算后获得新增场内中欧盛世份额。

$$NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}} = NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{折}}$$

中欧盛世份额持有人折算后所持有的中欧盛世份额数。

$$= \frac{NUM_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}} \times NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}}{NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}}$$

其中：

$NUM_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}$ ：折算前中欧盛世份额的基金份额数。

$NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{折}}$ ：折算前中欧盛世份额的基金份额净值。

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停盛世 A 份额与盛世 B 份额的上市交易和中欧盛世份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒介和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

截至 2014 年 8 月 22 日，本基金盛世 B 的基金份额净值为 2.352 元，盛世 A 的基金份额净值为 1.156 元，盛世 B 份额净值大于盛世 A 份额净值的 2.00 倍，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2014 年 8 月 25 日为基准日办理不定期份额折算业务。

2. 盛世 B 份额的基金份额净值小于或等于盛世 A 份额净值的 0.25 倍时，本基金将按照以下规则进行份额折算。

##### (1) 基金份额折算基准日

盛世 B 份额的基金份额净值小于或等于盛世 A 份额净值的 0.25 倍时，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

##### (2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的盛世 A 份额、盛世 B 份额和中欧盛世份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当盛世 B 份额的基金份额净值小于或等于盛世 A 份额净值的 0.25 倍后, 本基金将分别对盛世 A 份额、盛世 B 份额和中欧盛世份额进行份额折算, 份额折算后本基金将确保盛世 A 份额和盛世 B 份额的比例为 5:5, 份额折算后中欧盛世份额、盛世 A 份额和盛世 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

份额折算前盛世 B 份额的资产净值与份额折算后盛世 B 份额的资产净值相等。盛世 B 份额的份额数缩减, 盛世 A 份额的份额数与盛世 B 份额同比例缩减, 超出部分折算为中欧盛世份额。具体折算公式为:

①盛世 B 份额

$$NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{盛世 B}}^{\text{前}}}{1.000}$$

②盛世 A 份额

$$NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{后}} = NUM_{\text{盛世 B}}^{\text{后}}$$

盛世 A 份额持有人折算后新增的场内中欧盛世份额数

$$= \frac{NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{盛世 A}}^{\text{前}} - NUM_{\text{盛世 A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

③中欧盛世份额

$$NUM_{\text{中欧盛世}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{中欧盛世}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{中欧盛世}}^{\text{前}}}{1.000}$$

(5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停盛世 A 份额与盛世 B 份额的上市交易和中欧盛世份额的申购或赎回等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒介和基金管理人网站公告, 并报中国证监会备案。

## 第二十部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方;
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日;
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;
4. 会计制度执行国家有关的会计制度;
5. 本基金独立建账、独立核算;
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,经书面通知基金托管人,后可以更换。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 第二十一部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
2. 对证券投资业绩进行预测;
3. 违规承诺收益或者承担损失;
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
5. 登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括:

### 一、招募说明书、基金产品资料概要

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制基金招募说明书,并在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。

《基金合同》生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后,基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金产品资料概要,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 二、基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前,将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## 三、基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定,就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## 四、基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## 五、基金份额上市交易公告书

盛世A份额、盛世B份额和中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在盛世A份额、盛世B份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额上市交易的3个工作日前,将相关基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## 六、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告



1. 本基金的基金合同生效后,基金上市交易前,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值;本基金转为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人将至少每周在指定网站披露一次中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值;

2. 本基金分级运作期内,在盛世A份额与盛世B份额上市交易后,基金管理人将在每个交易日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露交易日的中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额基金份额净值和基金份额累计净值;

3. 本基金分级运作期内,在开始办理中欧盛世份额申购或者赎回后,基金管理人将在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的中欧盛世份额基金份额净值和基金份额累计净值;本基金转为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)后,在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人将在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值;

4. 本基金分级运作期内,基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日,将基金资产净值和中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。本基金转为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)后,基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

## 七、申购、赎回价格公告

1、基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明中欧盛世份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

2、本基金转为中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)后,基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)各类基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 八、基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1.基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2.基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3.基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上;

4.基金合同生效不足2个月的,本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

5.本基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

6.报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 九、临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案:

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、《基金合同》终止、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;
- 8、基金募集期延长或提前结束募集;
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 10、基金管理人的董事在最近12个月变更超过百分之五十,基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十;
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,但中国证监会另有规定的除外;
- 14、基金收益分配事项;

15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额开始办理申购、赎回；

18、中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

19、本基金发生巨额赎回并延期支付；

20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21、本基金暂停接受中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、本基金盛世A份额、盛世B份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

23、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；

24、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

25、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；

26、本基金实施基金份额折算；

27、调整本基金份额类别设置；

28、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会、深圳证券交易所或本基金合同规定的其他事项。

#### 十、澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### 十一、基金份额持有人大会决议

#### 十二、清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

### 十三、中国证监会规定的其他信息

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外,也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度,在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下,自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用,该费用不得从基金财产中列支。

依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所和基金上市交易的证券交易所,供社会公众查阅、复制。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行,信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第二十二部分 风险揭示

### 一、市场风险与对策

由于经济和政治环境、产业和行业状况、上市公司基本面等方面的变化,可能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动,进而影响基金份额净值。市场风险主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、公司经营风险、通货膨胀风险和财务风险等。其中,政策风险是指有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的法规、举措出台,引起证券市场的波动,从而给投资人带来风险;经济周期风险是指证券市场行情周期性变动而引起的风险,这种行情变动不是指证券价格的日常波动和中级波动,而是指证券行情长期趋势的改变;利率风险是指市场利率变动引起证券投资收益变动的可能性,市场利率的变化会引起证券价格变动,并进一步影响证券收益的确定性;公司经营风险是指公司的决策人员与管理人员在经营管理过程中出现失误而导致公司盈利水平变化,从而使投资人预期收益下降的可能;通货膨胀风险是指由于通货膨胀、货币贬值给投资人带来实际收益水平下降的风险;财务风险是指公司财务结构不合理、融资不当而导致投资人预期收益下降的风险。

为控制此类风险,本基金管理人将努力加强对宏观经济与国家政策的分析,研究并预测经济周期、利率走势和行业发展趋势,以此作为资产配置和证券选择的依据;本基金管理人的风险控制系统实施对从个股/个券到全部组合等风险源的全面风险管理,从而得以实时监控组合风险敞口,及时识别风险源并调整投资组合;本基金将通过构建多样化组合并限制单只证券过高持仓以避免个股/个券过度风险;岗位风险管理职能方面:本基金管理人的业绩和风险评价小组自行开发风险管理系统并将定期出具业绩和风险评价报告,重点股票的波动性、贝塔系数、风险值和债券的剩余期限、久期、凸性等指标;基金经理和投资总监将负责时时监控组合风险头寸并决定是否调整投资组合。

### 二、流动性风险与对策

在基金转为开放式基金后的所有开放日,基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金,或者变现为现金时使资金净值产生不利的影晌,都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时,如

果基金资产变现能力差,可能会产生基金仓位调整的困难,导致流动性风险,进而影响基金份额净值。

为控制此类风险,本基金管理人的投资组合管理和交易系统设置了预警和自动控制功能,以便对基金交易中可能存在的流动性风险发出警报;基金运营部将与代销机构、托管行保持高效沟通以及时预测资金流动;基金经理将每日依据基金运营部提供的信息监控基金的净现金头寸和资金流入/流出情况;业绩和风险评价小组定期计算流动性及可能存在的风险,并出具报告提交基金经理、投资总监和风险控制委员会。

另外,投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面重大变化而导致流动性降低,基金管理人难以在合理的时间内以公允价格将其变现而引起资产的损失或交易成本的不确定性,从而产生流动性风险。本基金将根据个别债券发行总量、流通量、上市时间等流动性指标,决定投资总量。

### 三、管理风险与对策

在基金管理运作过程中,基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断,从而影响基金收益水平。因此,基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

为控制此类风险,本基金管理人将充分发挥中外合资基金管理公司在国际化和本土化方面的双重优势,吸取国内外同行业在投资管理方面的经验教训,引进外资股东的先进管理经验和专业技术,建立优秀的管理团队和专业团队;同时,本基金管理人实施积极的人才战略,通过外部引进、内部培训、科学考核、有效激励等多种方式不断提高团队的经营管理水平和投资研究能力,并根据实际情况引进新的管理技术和方法,努力为基金份额持有人带来更好的投资回报;投资总监、投资决策委员会对基金经理助理、基金经理和投资总监等各级岗位的基金投资分别实施不同的投资交易限制以及重要交易的逐级授权制度,从而确保实现对于管理风险的有效监督和管理。

### 四、信用风险与对策

基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,都可能导致基金资产损失和收益变化,从而产生风险。

为控制此类风险,本基金管理人将选择资信状况良好的机构作为本基金交易对手,投资于具备较高信用评级的债券并尽可能通过多样化持债回避信用风险。

## 五、其它风险

### 1. 操作风险与对策

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

为控制此类风险,本基金管理人将在充分考虑内外部环境的基础上,建立科学、严密、高效的内部控制体系;投资组合管理和交易系统中设置了交易前的自动限制和控制功能,以防止主观和客观的错误交易和违规交易。中央交易室每日提交交易报告以便投资总监及时发现操作中存在的问题并予以修正。同时,本基金管理人注重提高员工专业水平,并加强员工职业道德教育,以促进合规文化的形成。

### 2. 技术风险与对策

在基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

### 3. 其它风险与对策

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争及代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

为控制这类风险,本基金管理人建立了突发紧急事件处理制度以及完备的灾难恢复计划,以防范和控制不可抗力因素造成的风险。

### 4. 基金运作的特有风险

盛世 A 份额与盛世 B 份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金,投资人投资于本基金还将面临以下特有风险。

#### (1) 基金份额的风险收益特征



本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。

盛世 A 份额表现出低风险、收益稳定特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额,类似于债券型基金份额。虽然盛世 A 份额具有相对稳定收益的安排,但是约定收益的获得及其分配也具有不确定性,在本基金资产出现极端损失情况下,盛世 A 份额仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

盛世 B 份额表现出较高风险、收益相对较高的特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额,类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。为避免盛世 B 份额的份额净值跌到零,本基金采取了基金份额到点折算机制,但是如果市场出现极端下跌,盛世 B 的份额净值依旧存在跌到零的风险。

## (2) 基金的收益分配

分级运作期内,本基金不进行收益分配。

根据基金合同的约定,在基金份额折算日,基金管理人会对盛世 A 份额和盛世 B 份额实施基金份额折算。盛世 A 份额(或盛世 B 份额)的投资人可通过赎回折算后新增的场内中欧盛世份额的方式获取投资回报,但是,该获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配,投资人不仅须承担相应的交易成本,还可能面临基金份额赎回的价格波动风险。

## (3) 份额配对转换业务中存在的风险

本基金《基金合同》生效后,基金管理人将根据《基金合同》的约定办理中欧盛世份额与盛世 A 份额、盛世 B 份额之间的份额配对转换业务。一方面,这一业务的办理可能改变盛世 A 份额与盛世 B 份额的市场供求关系,从而可能影响基金份额的交易价格;另一方面,这一业务可能出现暂停办理的情形,投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

## (4) 流动性风险

本基金的盛世 A 份额与盛世 B 份额在基金合同生效且符合上市交易条件后,在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资人在停牌期间不能买卖基金,存在一定的风险;同时,可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导

致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

#### (5) 份额折算的风险

由于本基金各级基金份额的风险收益特征不同,当盛世 A 份额和盛世 B 份额在到点折算时获得新增的中欧盛世份额的场内份额,或当盛世 A 份额和盛世 B 份额到期折算成中欧盛世份额的场内份额后,基金份额持有人所持有基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

#### (6) 基金份额的折/溢价交易风险

盛世 A 份额与盛世 B 份额上市交易后,基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。对于盛世 A 份额、盛世 B 份额,尽管在基金份额配对转换机制下,5 份盛世 A 份额与 5 份盛世 B 份额的市价总和将与 10 份中欧盛世份额的净值之间具有逼近的趋势,但是,盛世 A 份额或盛世 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外,由于基金份额配对转换套利机制的影响,盛世 A 份额与盛世 B 份额的交易价格可能会相互影响,尤其是在临近份额配对转换业务的办理时点的时候。

### 5. 存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证,存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行,代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当,但不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制,应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

## 第二十三部分 基金合同的终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 中国证监会规定的其他情况。

### 二、基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

(1) 自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算组，基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

(8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;

(9) 公布基金财产清算结果;

(10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿:

(1) 支付清算费用;

(2) 交纳所欠税款;

(3) 清偿基金债务;

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本基金分级运作期内基金合同终止发生清算的,根据基金合同终止日中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自净值分别计算中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额三类基金份额各自的应计分配比例,在此基础上,在中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) — (3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十四部分 基金合同内容摘要

基金合同内容摘要见附件一。

## 第二十五部分 基金托管协议内容摘要

基金托管协议内容摘要见附件二。

## 第二十六部分 对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，注册登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

### 二、在线服务

基金份额持有人可以通过本基金公司的网站 [www.zofund.com](http://www.zofund.com) 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### 三、查询与咨询服务

中欧基金公司客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客服电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录公司网站 [www.zofund.com](http://www.zofund.com) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一至周五，9：00—17：00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

### 四、投诉受理

基金份额持有人可拨打客服中心电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和代销机构的人员及其服务。

## 第二十七部分 其他应披露事项

以下为本基金管理人自2023年10月1日至2024年4月30日刊登于中国证监会指定媒介的公告

序号	公告事项	披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第三季度报告的提示性公告	2023-10-25
2	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)2023年第3季度报告	2023-10-25
3	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2023年12月)	2023-12-20
4	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)2023年第4季度报告	2024-01-22
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年第四季度报告的提示性公告	2024-01-22
6	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)2023年年度报告	2024-03-29
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告的提示性公告	2024-03-29
8	中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)2024年第1季度报告	2024-04-20
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2024年第一季度报告的提示性公告	2024-04-20



## 第二十八部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金销售机构等办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十九部分 备查文件

### 一、备查文件包括：

1. 中国证监会批准中欧盛世成长分级股票型证券投资基金募集的文件
2. 《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》
4. 《中欧盛世成长分级混合型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照
8. 中国证监会规定的其他文件

### 二、备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2024年6月15日

## 附件一 基金合同内容摘要

(一) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利义务

### 一、基金管理人

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 479 号 8 层

邮政编码：200120

法定代表人：竇玉明

成立时间：2006 年 7 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监基金字[2006]102 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.20 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、基金托管人

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：北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦

法定代表人：王凯

成立时间：1988 年 7 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：217 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券等 有价证券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；从事银行卡服务；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存、贷款；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

### 三、基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

#### 四、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:

1. 自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3. 发售基金份额;
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
5. 在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高赎回费率、托管费率和费率之外的相关费率结构和收费方式;
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
7. 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的申购和赎回申请;
8. 依据本基金合同的约定,转换本基金运作方式;
9. 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
10. 自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
11. 选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

12. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

13. 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

14. 依法召集基金份额持有人大会;

15. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 五、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

1. 依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2. 办理基金备案手续;

3. 自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7. 依法接受基金托管人的监督;

8. 计算并公告基金净值信息、中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额净值、基金份额折算比例、盛世A份额与盛世B份额终止运作后的份额转换比例及中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额净值;

9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10. 按规定受理中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12. 编制季度报告、中期报告和年度报告;

13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

14. 保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

16. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18. 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19. 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议;

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 六、基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作;
3. 自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;
4. 在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
6. 依法召集基金份额持有人大会;
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料;
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 七、基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:

1. 安全保管基金财产;
2. 设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
7. 保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

10. 按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、中欧盛世份额、盛世A份额、盛世B份额与中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额的基金份额净值、基金份额折算比例、盛世A份额与盛世B份额终止运作后的份额折算比例;

13. 按照规定监督基金管理人的投资运作;

14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

17. 因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

19. 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;

21. 执行生效的基金份额持有人大会决议;

22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

23. 建立并保存基金份额持有人名册;

24. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### 八、基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:

1. 分享基金财产收益;

2. 参与分配清算后的剩余基金财产;



3. 依法转让其持有的盛世 A 份额与盛世 B 份额, 依法申请赎回其持有的中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF) 份额, 在分级运作期内申请进行基金份额的配对转换;

4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7. 监督基金管理人的投资运作;

8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 九、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金份额持有人的义务为:

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;

3. 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

5. 执行生效的基金份额持有人大会决议;

6. 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;

7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### 十、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据

#### (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

一、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。在分级运作期内, 基金份额持有人大会的审议事项应分别由中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

本基金分级运作期到期,本基金无需召开基金份额持有人大会,盛世A份额与盛世B份额将按照本基金合同的约定转换为场内的中欧盛世份额,转换完成后,本基金将不再分级运作并更名为中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)。此后,基金份额持有人大会的审议事项应由中欧盛世成长股票型证券投资基金(LOF)的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

## 二、召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:
  - (1) 终止基金合同;
  - (2) 转换基金运作方式;
  - (3) 变更基金类别;
  - (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
  - (5) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (6) 更换基金管理人、基金托管人;
  - (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费,但法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费的除外;
  - (8) 本基金与其他基金的合并;
  - (9) 分级运作期内终止盛世A份额与盛世B份额的运作;
  - (10) 终止盛世A份额、盛世B份额或中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额上市交易,但因份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
  - (11) 基金管理人、基金托管人或者单独或合计持有基金份额10%以上(含10%,下同)基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额10%以上的基金份额持有人)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - (12) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
  - (13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同, 不需召开基金份额持有人大会:

(1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用;

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更中欧盛世份额、中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份各类别的申购费率、调低赎回费率、变更或新增收费方式, 或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的基金份额类别的设置;

(3) 因相应的法律法规、证券交易所或注册登记机构规则发生变动必须对基金合同进行修改;

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化;

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 三、召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集。

3. 单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(分级运作期内, 指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人)认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 单独或

合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人)仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4. 单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人)就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人)有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

#### 四、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式;
- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 会议形式;
- (4) 议事程序;
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- (7) 表决方式;
- (8) 会务常设联系人姓名、电话;

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 五、基金份额持有人出席会议的方式

### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式;

(2) 会议的召开方式由会议召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开;

(3) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力;

(4) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决;

(5) 在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

### 2. 召开基金份额持有人大会的条件

#### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的50%(含50%,下同)(分级运作期内,指不少于权益登记日中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额的50%);

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

## (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行:

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

④ 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的50%(分级运作期内,指不少于权益登记日中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额的50%)

⑤ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

## 六、议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世A份额与盛

世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人) 可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案, 大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系, 并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的, 应提交大会审议; 对于不符合上述要求的, 不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决, 应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决, 需征得原提案人同意; 原提案人不同意变更的, 大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定, 并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合计代表权益登记日基金份额 10%以上的基金份额持有人 (分级运作期内, 指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世 A 份额与盛世 B 份额各自总份额 10%以上的基金份额持有人) 提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 未获基金份额持有人大会审议通过, 就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议, 其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当在基金份额持有人大会召开 30 日前公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权

代表均未能主持大会,则由出席大会的单独或合计代表出席会议基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上(分级运作期内,指出席会议的中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额的50%以上)多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 七、决议形成的条件、表决方式、程序

1. 分级运作期内,中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。分级运作期满后,每一中欧盛世成长混合型证券投资基金(LOF)份额持有人享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额50%以上)通过方为有效;除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(分级运作期内,指单独或合并持有中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自总份额三分之二以上)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基



金托管人、转换基金运作方式、分级运作期内终止盛世 A 份额与盛世 B 份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 八、计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人或基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

九、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

十、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

### (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

#### 一、本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同将终止:

1. 基金份额持有人大会决定终止的;
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
4. 中国证监会规定的其他情况。

#### 二、基金财产的清算

##### 1. 基金财产清算组

(1) 自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算组,基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

- (1) 基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
- (2) 基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;
- (3) 对基金财产进行清理和确认;
- (4) 对基金财产进行估价和变现;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9) 公布基金财产清算结果;
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4. 基金财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付清算费用;
- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本基金分级运作期内基金合同终止发生清算的,根据基金合同终止日中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自净值分别计算中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额三类基金

份额各自的应计分配比例,在此基础上,在中欧盛世份额、盛世A份额与盛世B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### (四) 争议的解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,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。

本基金合同受中国法律管辖。

### (五) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

## 附件二 基金托管协议内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 一、基金管理人

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 479 号 8 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 层

邮政编码：200120

法定代表人：竇玉明

成立日期：2006 年 7 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监基金字[2006]102 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.20 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和经中国证监会许可的其他业务。

#### 二、基金托管人

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：北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦

法定代表人：王凯

成立时间：1988 年 7 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：217 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券等 有价证券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；从

事银行卡服务；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存、贷款；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

一、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的3%；债券等固定收益类资产以及现金占基金资产的5%~40%，其中现金（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%。

债券等固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（包括分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购、银行存款等固定收益证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

二、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (7) 股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%~95%，债券等固定收益类资产以及现金占基金资产的 5%~40%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(15) 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%;

(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;

(19) 法律法规或中国证监会规定的其他限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

除上述第(12)、(15)、(16)、(17)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

三、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。

基金托管人应对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有



关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。

四、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并承担交易对手不履行合同造成的损失，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

五、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1. 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证

券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3. 在首次投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例,并在相关制度中明确具体比例,避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后,基金管理人应至少于首次投资流通受限证券之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

4. 在投资流通受限证券之前,基金管理人应按约定时间向基金托管人提供符合法律法规要求的有关流通受限证券的信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):拟发行证券主体的中国证监会批准文件、拟发行数量、定价依据、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占基金资产净值的比例、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金投资流通受限证券,基金管理人应根据本协议的规定与基金托管银行签订风险控制补充协议。协议应包括基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督等内容。

6. 基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

7. 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备

查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

因基金份额净值计算错误造成基金份额持有人损失的,基金份额持有人有权要求基金管理人、基金托管人予以赔偿。

六、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金份额折算比例计算、盛世A份额与盛世B份额终止运作后的份额折算比例计算、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。

七、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

八、基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。

对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

九、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人。

十、基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### (三) 基金管理人有关基金托管人的业务核查

一、基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、基金份额折算比例计算、盛世 A 份额与盛世 B 份额终止运作后的份额折算比例计算、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

二、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

三、基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### (四) 基金财产的保管

#### 一、基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；
2. 基金托管人应安全保管基金财产；
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决；
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任；
7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 二、基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于中国证券登记结算有限责任公司的开放式基金认购专户，该账户由基金管理人委托的注册登记机构开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管专户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。
3. 若基金募集期届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## 三、基金托管专户的开立和管理

1. 基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过基金托管专户进行。

2. 基金托管专户的开立和使用, 限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户; 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金托管专户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

#### 四、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用, 仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户, 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户, 并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作, 基金管理人应予以积极协助。结算备付金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 若无相关规定, 则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 五、银行间债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后, 基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格, 并代表基金进行交易; 基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议, 基金托管人保管协议正本, 基金管理人保存协议副本。

#### 六、其他账户的开立和管理

在本托管协议签订日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和基金合同约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 七、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 八、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人,并在30个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### (五) 基金资产净值计算与复核

#### 一、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,经基金托管人复核,按规定公告。

#### 二、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

三、根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见的,按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### (六) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式,保存期不少于15年。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

基金托管人因编制基金定期报告等合理原因要求基金管理人提供相关资料时,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

#### (七) 争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,仲裁地点为上海市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### (八) 托管协议的变更和终止

##### 一、托管协议的变更程序



本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

## 二、基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。