

上海中欧财富基金销售有限公司

关于中欧金选全明星基金投资组合策略调整的公告

自中欧金选全明星投顾策略上线以来，本公司始终持续、审慎、负责地开展投顾策略的投资运作和客户服务。为了更好地服务投资者，经公司投资决策委员会审慎决策，调整本策略的策略名称、策略目标及策略结构，同时调整本策略的基金备选池。

一、策略说明书中调整后的相关内容如下：

1、策略名称：中欧臻选全明星

2、策略目标：本组合通过定量与定性相结合的方式，在全市场中优选基金，并结合大类资产配置模型适时进行风格与行业机会挖掘，在承担市场波动的前提下，力争获取超越业绩基准的投资回报。

3、策略结构：中欧财富通过定量与定性相结合的分析方法，在全市场基金产品中精选出具有竞争优势的基金，由中欧财富投资决策委员会决议通过后形成本组合策略的备选池，并根据市场行情因素从备选池中优中选优。若备选池基金发生重大变更或法律法规发生变化导致中欧财富认为不宜继续作为本组合策略的投资范围，以及中欧财富认为如有更加适合的其他可选投资基金，本组合的备选池将按照法律法规规定或协议约定的程序进行相应调整。

上述调整不影响风险收益特征和适合投资者范围，投顾策略的风险等级及适合的投资者类型均维持不变。

二、具体实施安排

为了保障投资者的合法利益，即日起，本公司将通过短信、公司官网等方式告知投资者相关调整安排。本投顾策略调整自 2022 年 3 月 31 日起正式生效，本公司将按照调整后的投顾策略继续为投资者进行提供投顾服务。投资者可以自行选择继续持有投顾策略或进行退出安排，请投资者根据投资需求审慎选择。

三、其他实施事项

投资者可通过以下途径了解或咨询详情：

中欧财富官方网站：www.zocaifu.com

手机移动客户端：“中欧财富”APP

本公司客服电话：4007009700-中欧财富专线。

风险提示：

1、本公司承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理投顾账户的资产，但不保证投顾账户一定盈利，也不保证最低收益。投资者进行投资存在本金亏损的风险。投顾业务的过往业绩并不预示其未来业绩表现。基金投资组合策略的风险特征与单只基金产品的风险特征存在差异。本公司提醒投资者投顾业务及基金投资遵循“买者自负”原则，在决定参与投顾业务并选择投资组合策略后，投顾账户相关损益由投资者自行承担。

2、投资者申请参与投顾业务前，应认真阅读有关投顾业务的相关协议、投资组合策略说明书、风险揭示书等内容，了解投顾业务的业务规则和相关风险，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好电

子交易信息，特别是账号和密码。

特此公告。

上海中欧财富基金销售有限公司

2022年3月22日

附件：基金投资组合策略说明书（中欧臻选全明星）

基金投资组合策略说明书

本说明书对“中欧臻选全明星”基金投资组合策略的结构、备选基金产品评估情况、风险特征、适合投资者范围等做了全面说明。在购买之前，请您认真阅读并充分理解本说明书，选择符合您投资目标和风险要求的基金投资组合策略。

一、基金投资组合策略说明

（一）策略目标

本组合通过定量与定性相结合的方式，在全市场中优选基金，并结合大类资产配置模型适时进行风格与行业机会挖掘，在承担市场波动的前提下，力争获取超越业绩基准的投资回报。

（二）策略结构

本组合策略主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金。

中欧财富通过定量与定性相结合的分析方法，在全市场基金产品中精选出具有竞争优势的基金，由中欧财富投资决策委员会决议通过后形成本组合策略的备选池，并根据市场行情因素从备选池中优中选优。若备选池基金发生重大变更或法律法规发生变化导致中欧财富认为不宜继续作为本组合策略的投资范围，以及中欧财富认为如有更加适合的其他可选投资基金，本组合的备选池将按照法律法规规定或协议约定的程序进行相应调整。

本组合策略权益类资产包含股票型基金（含股票指数基金）、混合型基金、债券型基金中连续四个季度披露的基金定期报告中显示“股票资产占基金资产比例+50%×可转债资产占基金资产比例”的均值大于基金资产 20%的基金等。

本组合策略的权益类资产占比为 90%-100%

（三）业绩比较基准

沪深 300 (000300.SH) 指数*95%+中证全债(H11001.CSI) 指数 *5%

（四）风险特征

本组合策略风险等级为中风险

（五）适合投资者范围

本组合策略适合 C3、C4、C5 客户

（六）投资顾问服务费率

投资组合策略自买入确认之日起，按照授权账户持有投资组合策略的资产期限进行计算。持有期限不满 365 个自然日，则投资顾问服务费率为 0.5%/年；持有期限满 365 个自然日且不满 730 个自然日，则投资顾问服务费率为 0.4%/年；持有期限满 730 个自然日及以上，则投资顾问服务费率为 0.3%/年。

持有期限 (N)	费率
$N < 365$ 个自然日	0.5%/年
$365 \text{ 个自然日} \leq N < 730 \text{ 个自然日}$	0.4%/年
$N \geq 730$ 个自然日	0.3%/年

注：投资组合策略持有时间的计算，以该投资组合策略买入确认日开始计算。如若投资者的授权账户内投资组合策略资产已全部赎回后再买入该投资组合策略的情况下，持有期限按照规则重新计算。

二、 备选基金产品的评估情况

本基金投资组合策略配置的产品类型包括主动管理的非货币基金以及货币型基金。

针对主动管理的非货币基金，评估成分基金投资风格与收益的稳定性和持续性，从基金公司、基金经理、基金产品三个层面，从投资能力和非投资能力两个维度，定量分析与定性分析相结合，分析研究基金或管理人的投资风格与收益的稳定性和持续性。选择中长期收益优秀、风格清晰稳定、业绩波动性较低、风控与合规管理有效的基金，排除风格频繁漂移的基金。

针对货币型基金，主要从基金规模、流动性、风险、收益率等层

面进行评估，以满足流动性管理要求为主。

三、 风险控制措施

根据基金投资顾问业务的特点，公司建立了风险防控体系，维护业务稳定运行。具体风险控制措施如下：

1、 执行分散投资要求

(1) 基金投资顾问服务的单个投资者持有单只基金的市值，不得高于投资者账户资产净值的 20%，货币市场基金、指数基金不受此限。

(2) 单一基金投资组合策略下所有投资者持有单只基金的份额综合不得超过该基金总份额的 20%，持有指数基金的份额总和不得超过该基金总份额的 30%。

(3) 单一基金投资组合策略的年度最高基金周转率原则上不超过 150%。

(4) 不得向投资者建议结构复杂的基金，包括分级基金场内份额和监管部门认定的其他基金。

因证券市场波动、基金规模变动等基金投资组合策略之外的因素导致不符合上述要求，应当在 3 个月内调整，经监管部门认可的情形除外。

法律法规或监管部门取消上述投资限制指标或最高周转率要求的，基金投资组合策略可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述投资限制指标或最高周转率要求进行变更的，基金投资组合策略以变

更后的规定为准。

2、监控市场风险

公司每日对各投资策略组合的盈亏情况、波动率、回撤、成分基金的相关性、成分基金盈亏情况、成分基金的风险占比进行监控。定期对组合和市场情况进行回顾和调整，必要时进行调仓。

3、控制模型风险和配置策略的有效性

科学设计算法模型，并采用人工干预措施进行算法维护。确保该算法应用的合理性和可行性，并定期对算法模型进行评估更新，对算法的有效性进行回顾与检测，以适应外部因素的变化情况。此外，配备其他投顾业务人员复核算法所生成的投资建议，并不完全依赖于算法程序，确保模型风险可控。

对每种策略设置设立业绩基准和偏离度的阈值，当出现超过阈值的情况下，及时评估配置策略的有效性及其标的选择的合理性。

4、管理流动性风险

持续监控各组合及对应成分基金的申购、赎回情况，包括组合调仓期间对成分基金规模变化的影响，及时评估和监测各成分基金的流动性风险。

5、应急预案

为规避异常情况导致的业务风险，针对成分基金暂停赎回、申购失败、资金交收失败、投顾业务系统故障、算法模型偏离等等情形，公司制定有相应的应急处理预案。

四、风险提示

公司本着勤勉尽责、诚实守信的原则开展基金投顾业务，但并不保证各投顾组合一定盈利，也不保证最低收益。投资者参与基金投顾业务，存在本金亏损的风险。基金投顾业务项下各投资组合策略的业绩仅代表过往业绩，不预示其未来的业绩表现，为其他投资者创造的收益也不构成业务表现的保证。

本策略说明书中策略目标所表述内容，不构成公司对投资者获取投资收益或免受投资损失的承诺、保证或预期。基金投资组合策略的过往业绩不代表其未来表现，为其他投资者创造的收益并不构成业绩表现的保证。