

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二〇一七年九月

重要提示

本基金经 2013 年 1 月 6 日中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）下发的《关于核准中欧纯债分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]12 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2013 年 1 月 31 日正式生效，根据基金合同的有关规定，中欧纯债分级债券型证券投资基金（以下简称本基金）合同生效后 3 年基金分级运作期届满，无需召开基金份额持有人大会，即可按照基金合同的约定转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）。根据基金合同的约定，本基金的基金转换日为 2016 年 2 月 1 日，本基金已完成基金转换并已于 2016 年 2 月 3 日公告基金份额转换结果。

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 2016 年 4 月 6 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。投资者在投资本基金前，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。投资者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，由于基金投资者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。

本基金分级运作期届满，本基金的两级基金份额将按约定的收益的分配规则进行净值计算，并以各自的份额净值为基准转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）的份额，并办理基金的申购、赎回业务。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

投资有风险，投资者在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 7 月 30 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

第一部分基金管理人 2

第二部分基金托管人 7

第三部分相关服务机构	9
第四部分基金的名称	28
第五部分基金的类型	28
第六部分基金的投资目标	28
第七部分基金的投资范围	28
第八部分基金的投资策略	29
第九部分基金的业绩比较基准	32
第十部分基金的风险收益特征	32
第十一部分基金的投资组合报告	32
第十二部分基金的业绩	37
第十三部分基金费用与税收	40
第十四部分对招募说明书更新部分的说明	43

第一部分基金管理人

一、基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层
3. 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层、上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层
4. 法定代表人：竇玉明
5. 组织形式：有限责任公司
6. 成立日期：2006 年 7 月 19 日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：袁维
13. 客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.88 亿元人民币
15. 股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；

国都证券股份有限公司出资 3760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

北京百骏投资有限公司出资 3760 万元人民币，占公司注册资本的 20%

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%。

上述 5 个股东共出资 18,800 万元人民币。

（经中欧基金管理有限公司（以下简称公司）2017 年股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会批准（批准文号：证监许可[2017]1253 号），公司股东意大利意联银行股份合作公司

(UnionediBancheltalianeS.p.A.)将其持有的公司 10%股权转让给竇玉明、于洁、赵国英、卢纯青、方伊、关子阳、卞玺云、魏博、郑苏丹、曲径、黎忆海等 11 人，万盛基业投资有限责任公司将其持有的公司

1.7%股权转让给周玉雄、卢纯青等 2 人。此次股权转让完成之后，公司的注册资本保持不变，仍为人民币 188,000,000 元，公司的股权结构调整为：

序号	股东名称	出资额（万元）	出资比例
----	------	---------	------

1	意大利意联银行股份合作公司	4700	25%
---	---------------	------	-----

- 2 国都证券股份有限公司 3760 20%
- 3 北京百骏投资有限公司 3760 20%
- 4 万盛基业投资有限责任公司 620.4 3.30%
- 5 上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙） 3760 20%
- 6 窦玉明 940 5%
- 7 周玉雄 280.59 1.4925%
- 8 卢纯青 140 0.7447%
- 9 于洁 140 0.7447%
- 10 赵国英 140 0.7447%
- 11 方伊 100 0.5319%
- 12 关子阳 100 0.5319%
- 13 卞玺云 79.01 0.4203%
- 14 魏博 75 0.3989%
- 15 郑苏丹 75 0.3989%
- 16 曲径 75 0.3989%
- 17 黎忆海 55 0.2926%
- 合计 18,800 100%

上述事项的工商变更登记手续现已办理完毕，并已于 2017 年 8 月 8 日公告。）

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

窦玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事，天合光能有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco DEste 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 CreditItaliano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

2. 基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历

任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 SchulteRothZabellLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士，监事，现任中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，监事，现任中欧基金管理有限公司客户服务总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3. 基金管理人高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，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分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，16年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，9年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

4. 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

姓名 朱晨杰 性别 男

国籍 中国 毕业院校及专业 法国北方高等商业学校金融市场专业

其他公司历任 法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券融资部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员

本公司历任 中欧基金管理有限公司投资经理

本公司现任 基金经理

本基金经理所管理基金具体情况 产品名称 起任日期 离任日期

- 1 中欧稳健收益债券型证券投资基金 2017-04-07
- 2 中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF） 2017-04-07
- 3 中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF） 2017-04-07
- 4 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF） 2017-04-07
- 5 中欧兴利债券型证券投资基金 2017-04-07
- 6 中欧骏盈货币市场基金 2017-05-03
- 7 中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金 2017-04-07
- 8 中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2017-04-07
- 9 中欧强盈定期开放债券型证券投资基金 2017-04-07
- 10 中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金 2017-04-07

- 11 中欧强泽债券型证券投资基金 2017-04-07
- 12 中欧强裕债券型证券投资基金 2017-04-07
- 13 中欧强利债券型证券投资基金 2017-04-07
- 14 中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金 2017-04-07

(2) 历任基金经理

基金经理 起任日期 离任日期

袁争光 2013-01-31 2015-05-25

尹诚庸 2015-05-25 2016-06-17

刘德元 2016-02-16 2017-06-27

5. 基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、副总经理顾伟、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲径、赵国英、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分基金托管人

1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：686.04亿元

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务三农、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。

现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3、托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2017年6月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共76只。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达42128.79亿元。

第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）本基金C类份额场外发售机构

1. 直销机构（C类）

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层

法定代表人：竇玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

2. 代销机构（C类）

3、名称：招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

公司网站：www.cmbchina.com

4、名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66215533

传真：010-66218888

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

5、名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

6、名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：王瑛

电话：010-68858126

客服热线：95580

网址：www.psbc.com

7、名称：杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：陈振峰

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客服热线：400-888-8508

网址：www.hzbank.com.cn

8、名称：国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

9、名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

10、名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

11、名称：光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

12、名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 66 号

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

电话：021-20315255

传真：021-20315137

客服热线：95538

网址：http://www.zts.com.cn

13、名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

14、名称：华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

15、名称：德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：姚文平
联系人：朱磊

电话：021-68761616-8259
传真：021-68761616
客服热线：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn

16、名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383
传真：010-60836031；0755-23835525
客服热线：95558
网址：www.citics.com

17、名称：中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超

电话：0532-85022313
传真：0532-85022301
客服热线：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

18、名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人：张皓
联系人：洪城

电话：0755-23953913
客户热线：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

19、名称：金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼
办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清

电话：0755-83025500
传真：0755-83025625
客服热线：4008-888-228
网址：www.jyzq.cn

20、名称：西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：023-63786141
传真：023-63786212
客服热线：400-809-6096
网址：www.swsc.com.cn

21、名称：华龙证券股份有限公司
住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼
办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富大厦 21 楼
法定代表人：李晓安
联系人：邓鹏怡
电话：0931-8888088
传真：0931-4890515
客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618
网址：www.hlzqgs.com

22、名称：华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街 8 号
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：010-85556100
传真：010-85556153
客服热线：400-898-9999
网址：www.hrsec.com.cn

23、名称：民族证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼
法人代表人：赵大建
联系人：李微
电话：400-889-5618
传真：010-66553216
客服热线：400-889-5618
网址：www.e5618.com

24、名称：东吴证券股份有限公司
住所：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号
办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街 5 号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：0512-62601555
传真：0512-62938812
客服热线：400-860-1555
网址：www.dwzq.com.cn

25、名称：中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇
电话：010-65051166
传真：010-85679535
客服热线：4009101166
公司网站：www.cicc.com.cn

26、名称：方正证券股份有限公司
住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：高利
联系人：高洋
电话：010-59355546
传真：010-56437013
客服热线：95571
公司网站：<http://www.foundersc.com/>

27、名称：天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：尹伶
电话：010-66045152
传真：010-66045518
客服热线：010-66045678
网址：www.txsec.com、www.jjm.com.cn

28、名称：深圳众禄金融控股股份有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227953
传真：0755-82080798
客服热线：4006-788-887
众禄基金销售网：www.zlfund.cn
基金买卖网：www.jjmmw.com

29、名称：上海好买基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
客服热线：400-700-9665

网址: www.howbuy.com

30、名称: 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 刘潇

电话: 021-58788678

传真: 021-58787698

客服热线: 400-089-1289

网址: www.erichfund.com

31、名称: 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人: 王莉

联系人: 吴卫东

电话: 021-68419822

传真: 021-68419822-8566

客服热线: 400-920-0022

网址: licaike.hexun.com

32、名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人: 汪静波

联系人: 张姚杰

电话: 021-38602377

传真: 021-38509777

客服热线: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

33、名称: 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 徐映绯

电话: 0571-28829790

传真: 0571-26698533

客服热线: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

34、名称: 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座(北楼) 25 层

法定代表人: 其实

联系人: 李广宇

电话: 021-54509977-8400

传真: 021-54509953

客服热线: 400-1818-188

网址: www.1234567.com.cn

35、名称: 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人: 李晓涛

联系人: 汪林林

电话: 0571-88920810

传真: 0571-86800423

客服热线: 400-877-3772

网址: www.5ifund.com

36、名称: 北京展恒基金销售股份有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人: 闫振杰

联系人: 马林

电话: 010-59601366

传真: 010-62020355

客服热线: 400-818-8000

网址: www.myfp.cn

37、名称: 上海陆金所资产管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

电话: 021-20665952

传真: 021-22066653

客户热线: 400-821-9031

网址: www.lufunds.com

38、名称: 上海汇付金融服务有限公司

住所: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址: 上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人: 冯修敏

联系人: 陈云卉

电话: 021-33323999

传真: 021-33323837

客户热线: 400-821-3999

网址: <https://tty.chinapnr.com>

39、名称: 珠海盈米财富管理有限公司

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

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

法定代表人: 肖雯

联系人: 黄敏嫦

电话: 020-89629099

传真：020-89629011

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

40、名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

（二）本基金E类份额场外发售机构

1. 直销机构（E类）

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层

法定代表人：竇玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

2. 代销机构（E类）

(1)名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：刘信义

联系人：唐苑

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客服热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

(2)名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路86号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路66号

法定代表人：李玮

联系人：马晓男

电话：021-20315255

传真：021-20315137

客服热线：95538

网址：<http://www.zts.com.cn>

(3)名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-3863746

传真：0755-82435367

客服热线：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

(4)名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(5)名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

(6)名称：上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼法定

代表人：李兴春联系人：徐鹏电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服热线：400-921-7755 网址：

www.leadfund.com.cn

(7)名称：上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

(8)名称：北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：吴季林

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com>

(9)名称：天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室

办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287984

传真：010-59287825

客服热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

(10)名称：北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层

法定代表人：齐剑辉

联系人：王英俊

电话：13911468997

传真：010-92055860

客服热线：400-623-6060

网址：www.niuiufund.com

(11)名称：上海万得投资顾问有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服热线：400-821-0203

网址：暂无

(12)名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

电话：010-62676405

传真：010-62676582

客服热线：010-62675369

网址：www.xincai.com

(13)名称：上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

电话：021-20538888

传真：021-20539999

客服热线：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

(14)名称：上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-88066552

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（三）本基金 C 类份额场内发售机构

具有基金销售资格的、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

二、注册登记机构

本基金 C 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：周明

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938828

本基金 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 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：竇玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫峰

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

四、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6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

第四部分基金的名称

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

第五部分基金的类型

契约型开放式

第六部分基金的投资目标

在严格控制风险和合理保持流动性的基础上，力争为投资者谋求稳健的投资收益。

第七部分基金的投资范围

本基金投资于国内依法发行或上市的债券、货币市场工具，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）。

本基金主要投资于通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等固定收益类资产。

本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转换债券等，也不参与一级市场的新股、可转换债券申购或增发新股。

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

第八部分基金的投资策略

本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等，在严格的风险控制基础上，力求实现基金资产的稳定增值。

1.信用策略

个券信用风险管理的主要依据为该证券的外、内部评级结果。信用评级包括主体信用评级、债项信用评级和评级展望，评级对象包括除国债、央行票据和政策性金融债之外的其他各类固定收益证券。

在内部评级过程中需要进行包括行业分析、企业分析、财务分析和增信措施在内的综合分析，并运用信用评级方法，结合国内主要信用评级机构的评级结果，给出内部信用评估结果和建议，并经讨论后形成信用风险评级报告并审定，经内部审定后最终确定固定收益证券的内部信用评级。同时还将进行信用评级跟踪，及时、准确的修正评级结果；若发现重大信用风险，及时应对。

本基金在信用风险内部评估时，遵循以下原则：审慎评级原则，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，应遵循审慎的原则评估其经营状况和财务风险；定性分析与定量分析相结合的原则，经营风险评估和财务风险评估是信用分析的两大主要内容，前者采用以定性为主、定量为辅的分析方法，后者采取以定量为主、定性为辅的分析方法，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，需综合考虑两方面的因素，综合评定；

历史考察和未来预测相统一的原则：债券评级的目的是预测发行主体未来的偿债能力和违约风险，在评级过程中，需要根据其历史经营业绩、竞争优势和劣势、发展规划以及管理层的经营能力，着重考察其未来经营和现金流状况，预测和评价发行主体的营运周期、未来资本运作以及其对未来财务状况的影响。

2.久期策略

本基金根据中期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

3.收益率曲线策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化。并针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中（子弹）策略、两端（哑铃）策略和梯形（阶梯）策略等，在短期债券间进行动态调整，从债券的相对价格变化中获利。

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获得价差收益。

4.息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

5.资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

6.流动性策略

本基金还将从市场环境，债券发行人特征和债券特征等方面充分考察固定收益类资产的流动性风险，具体包括个券的发行方式、发行规模、交易规模、交易方式、交易场所、交易成本、交易即时性、信用评级、剩余期限、债券票息、债券复杂性等方面，充分考察固定收益类资产的流动性风险，并确定该个券投资总量的上限。

7.中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：

（1）研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；

（2）运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；

（3）利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；

（4）考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；

（5）综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

第九部分基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债综合（全价）指数收益率

中债综合（全价）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，是以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中债综合（全价）指数的样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金的业绩比较基准。

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，而无需基金份额持有人大会审议。

第十部分基金的风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，基金分级运作期内，纯债 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；纯债 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

第十一部分基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，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 2017 年第 2 季度报告，所载数据截至 2017 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 — —

其中：股票 — —

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 1,030,573,369.86 91.78

其中：债券 930,506,000.00 82.86

资产支持证券 100,067,369.86 8.91

4 贵金属投资 — —

5 金融衍生品投资 — —

6 买入返售金融资产 70,000,345.00 6.23

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 10,710,105.28 0.95

8 其他资产 11,646,465.53 1.04

9 合计 1,122,930,285.67 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 508,206,000.00 45.29

其中：政策性金融债 508,206,000.00 45.29

4 企业债券 14,190,000.00 1.26

5 企业短期融资券 210,347,000.00 18.74

6 中期票据 70,586,000.00 6.29

7 可转债(可交换债) --

8 同业存单 127,177,000.00 11.33

9 其他 --

10 合计 930,506,000.00 82.92

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 170401 17 农发 01 3,900,000 388,518,000.00 34.62

2 011760081 17 中铝国工 SCP002 1,000,000 100,170,000.00 8.93

3 111715197 17 民生银行 CD197 1,000,000 97,840,000.00 8.72

4 170204 17 国开 04 900,000 89,613,000.00 7.99

5 101462037 14 川华西 MTN002 500,000 50,370,000.00 4.49

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

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 146139 17 京保 2A 500,000 50,039,890.41 4.46

2 146152 17 京保 3A 500,000 50,027,479.45 4.46

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 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	63,131.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	11,566,834.53
5	应收申购款	16,500.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,646,465.53

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第十二部分基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日 2013 年 1 月 31 日，基金业绩截止日 2017 年 6 月 30 日。

1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型前:

中欧纯债分级债券型证券投资基金成立以来的业绩如下:

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	--
----	-------	----------	-----------	--------------	----

2013.01.31(中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同生效日)-2013.12.31	1.81%	0.10%	-4.16%	0.09%	5.97%
---	-------	-------	--------	-------	-------

0.01%

2014.01.01-2014.12.31	14.54%	0.18%	6.54%	0.11%	8.00%
-----------------------	--------	-------	-------	-------	-------

2015.01.01-2015.12.31	10.63%	0.10%	4.19%	0.08%	6.44%
-----------------------	--------	-------	-------	-------	-------

2016.01.01-2016.02.01	0.18%	0.07%	0.02%	0.10%	0.16%
-----------------------	-------	-------	-------	-------	-------

2013.01.31-2016.02.01	29.24%	0.14%	6.41%	0.10%	22.83%
-----------------------	--------	-------	-------	-------	--------

数据来源：中欧基金，wind

转型后:

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）的业绩如下:

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）C 类基金份额

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	--
----	-------	----------	-----------	--------------	----

2016.2.2（转型为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF））-2016.12.31	-0.62%	0.11%	-1.56%	0.09%	0.94%
--	--------	-------	--------	-------	-------

0.02%

2017.1.1-2017.6.30	0.16%	0.07%	-2.11%	0.08%	2.27%
--------------------	-------	-------	--------	-------	-------

2016.2.2（转型为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF））-2017.6.30	0.09%	0.10%	-3.72%	0.09%	3.81%
---	-------	-------	--------	-------	-------

0.01%

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）E 类份额

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	--
----	-------	----------	-----------	--------------	----

2016.4.6-2016.12.31	-1.87%	0.11%	4.00%	0.10%	-5.87%
---------------------	--------	-------	-------	-------	--------

0.01%

2017.1.1-2017.6.30 0.31% 0.06% -2.11% 0.08% 2.42% -0.02%

2016.4.6-2017.6.30 -1.56% 0.09% -3.94% 0.09% 2.38% 0.00%

数据来源：中欧基金，wind

2.基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年1月31日-2017年06月30日）

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）E

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016年4月8日-2017年06月30日）

注：2016年4月6日本基金新增E类份额，图示日期为2016年4月8日至2017年6月30日。

第十三部分基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金上市费用；
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 基金销售服务费；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

三、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0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

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：

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3. 基金销售服务费

(1) 基金分级运作期内的销售服务费

本基金的销售服务费按前一日纯债 A 的基金资产净值的 0.35% 年费率计提，纯债 B 不收取销售服务费。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \times \text{当年天数}$$

H 为纯债 A 每日应计提的基金销售服务费

E 为纯债 A 前一日基金资产净值

(2) 基金分级运作期届满后的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 E 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \times \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

四、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费和基金上市初费及年费、基金银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

五、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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

六、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

七、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。

第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2017 年 3 月刊登的《中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

(一) 更新了第二部分释义部分中的相关内容。

更新了本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 7 月 30 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。的内容。

(二) 更新了第二部分释义部分中的相关内容。

更新了一些释义的表述。

(三) 更新了第三部分基金管理人部分中的相关内容。

1、补充了关于股权变更的期后事项。

2、更新了基金管理人董事会成员、监事会成员、高级管理人员、本基金基金经理和投资决策委员会成员

的相关信息。

（四）更新了第四部分基金托管人部分中的相关内容。

更新了托管人的相关信息。

（五）更新了第五部分相关服务机构部分中的相关内容。

1、更新了代销机构的相关信息。

2、更新了会计师事务所的相关信息。

（六）更新了第十部分基金份额的申购与赎回部分中的相关内容。

更新了拒绝或暂停申购的相关情形。

（七）更新了第十二部分基金的投资部分中的相关内容。

更新了十一、基金投资组合报告的内容，所载数据截至 2017 年 6 月 30 日。

（八）更新了第十三部分基金的业绩部分中的相关内容。

更新了本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较和基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图，基金业绩截止日 2017 年 6 月 30 日。

（九）更新了第二十六部分其他应披露事项部分中的相关内容。

更新了自 2017 年 1 月 31 日至 2017 年 7 月 30 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

以下为本基金管理人自 2017 年 1 月 31 日至 2017 年 7 月 30 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 披露日期

- 1 中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型类型的公告 2017-02-11
- 2 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过同花顺代销基金定投最低申购金额的公告 2017-02-16
- 3 中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告 2017-02-22
- 4 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告 2017-02-23
- 5 中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告 2017-03-02
- 6 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2017 年第 1 号） 2017-03-16
- 7 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号） 2017-03-16
- 8 中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国信证券代销基金定投最低申购金额的公告 2017-03-28
- 9 中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告 2017-03-30
- 10 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告 2017-03-31
- 11 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告摘要 2017-03-31
- 12 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告 2017-04-08
- 13 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）2017 年 1 季度报告 2017-04-21
- 14 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告 2017-04-22
- 15 中欧基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下部分基金代销机构的公告 2017-04-24
- 16 中欧基金管理有限公司关于新增方正证券为旗下部分基金代销机构的公告 2017-05-12
- 17 中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换与定投业务并参与费率优惠活动的公告 2017-05-16
- 18 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）分红公告 2017-06-23
- 19 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告 2017-06-28
- 20 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告 2017-06-30

21 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行申购费率优惠活动的公告
2017-07-01

22 中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2017 年 6 月 30 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计
净值公告 2017-07-01

23 中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）2017 年第 2 季度报告 2017-07-21

中欧基金管理有限公司

2017 年 9 月 13 日