

**中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）2017年半年度报告摘要**

**2017年06月30日**

**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**

**送出日期：2017年08月29日**

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中欧纯债债券（LOF）	
基金主代码	166016	
交易代码	166016	
基金运作方式	契约型上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2013年01月31日	
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	
报告期末基金份额总额	913,243,910.23份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016年03月01日	
下属分级基金的基金简称	中欧纯债债券（LOF）C	中欧纯债债券（LOF）E
下属分级基金的场内简称	中欧纯债	-
下属分级基金的交易代码	166016	002592
报告期末下属分级基金的份 额总额	21,612,544.27份	891,631,365.96份

### 2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、 400-700-9700	95580
传真	021-33830351	010-68858120

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	中欧纯债债券（LOF）C	中欧纯债债券（LOF）E
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
本期已实现收益	-1,897,119.52	-6,051,872.24
本期利润	48,106.54	1,406,466.31
加权平均基金份额本期利润	0.0017	0.0086
本期基金份额净值增长率	0.16%	0.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1513	0.1561
期末基金资产净值	26,460,715.86	1,095,761,653.26
期末基金份额净值	1.2240	1.2290

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为

末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

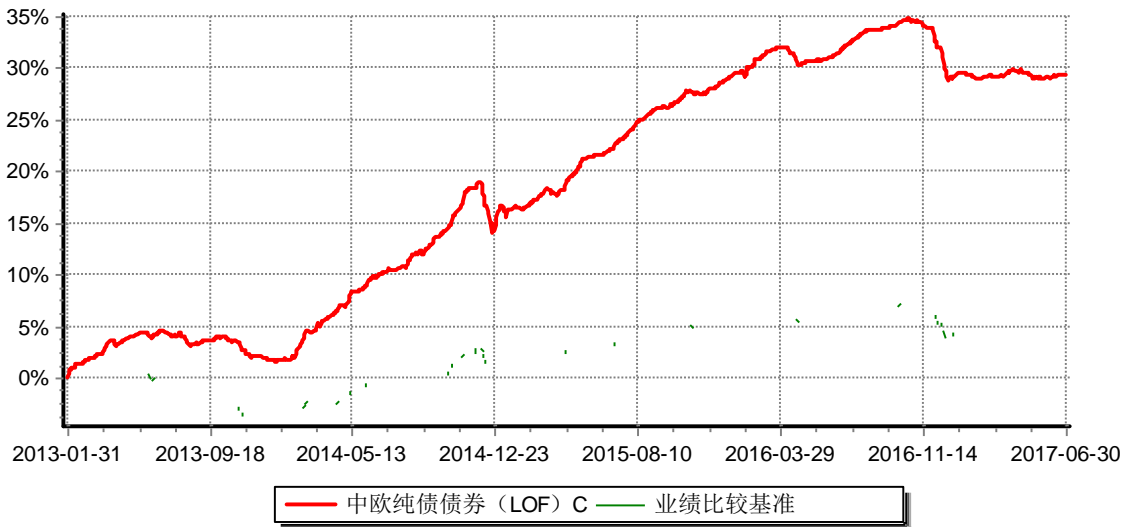
阶段 (中欧纯债债券 (LOF) C)	份额净 值增长 率①	份额净 值增长 率标准 差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.23%	0.05%	0.90%	0.06%	-0.67%	-0.01%
过去三个月	-0.23%	0.07%	-0.88%	0.08%	0.65%	-0.01%
过去六个月	0.16%	0.07%	-2.11%	0.08%	2.27%	-0.01%
过去一年	-1.58%	0.10%	-3.50%	0.10%	1.92%	0.00%
过去三年	17.48%	0.13%	2.70%	0.10%	14.78%	0.03%
自基金合同生效日至 今	29.36%	0.13%	-3.72%	0.09%	33.08%	0.04%

阶段 (中欧纯债债券 (LOF) E)	份额净 值增长 率①	份额净 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
过去一个月	0.24%	0.04%	0.90%	0.06%	-0.66%	-0.02%
过去三个月	-0.15%	0.06%	-0.88%	0.08%	0.73%	-0.02%
过去六个月	0.31%	0.06%	-2.11%	0.08%	2.42%	-0.02%
过去一年	-1.27%	0.10%	-3.50%	0.10%	2.23%	0.00%
自基金份额运作起始 日至今	-1.56%	0.09%	-3.94%	0.09%	2.38%	0.00%

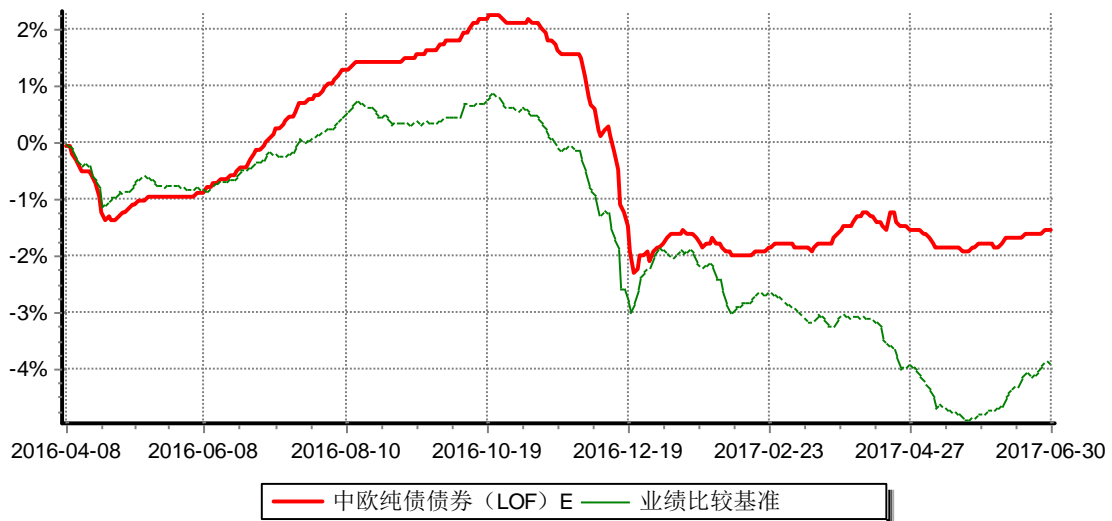
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧纯债债券（LOF）C

份额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01月31日-2017年06月30日)



中欧纯债债券（LOF）E  
份额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04月08日-2016年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7

月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2017年6月30日，本基金管理人共管理57只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘德元	基金经理	2016年02月16日	2017年06月27日	12年	历任大公国际资信评估有限公司技术总监、阳光资产管理股份有限公司高级研究员。2015年06月23日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司信用研究员。
朱晨杰	基金经理	2017年04月07日	—	5年	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。2016年03月24日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司投资经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损

害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

17年上半年经济表现强于2016年，在煤炭、钢铁供给侧改革的推进下，上游工业品的价格大幅抬升，产能过剩格局有效改善，上半年PPIRM累计同比8.7%、PPI累计同比6.6%，供给收缩带来的涨价预期，加大了补库存的力度，叠加发达国家经济回暖对出口的提振，我国经济有所反弹。上半年实际GDP累计同比增速为6.9%，名义GDP累计同比增速为11.4%，其中，工业表现尤其亮眼，上半年工业增加值累计同比增速为6.9%，高于去年同期增速6%；而在行政调控和金融监管的影响下，房地产业和金融业的增速有所放缓，经济整体呈现“脱虚向实”的局面。

今年4月上旬，银监会密集发文，针对银行业“三套利”、“三违反”、“四不当”、“十乱象”进行专项整治，同业业务、投资业务和理财业务成为治理的重点。4、5月央行也配合以“中性偏紧”的政策。期间，利率迅速大幅上行，一级债券发行受阻。而在6月，监管的力度边际减缓，银监会强调防范“处置风险的风险”，央行也有意维稳资金面。从成果上来看，银行理财规模和表内同业资产在上半年显著收缩，监管初见成效，但仍在进行中。

债券市场走势震荡，一季度收益率曲线整体向上平移。开年经济数据的平稳以及通胀预期升温令收益率曲线先呈现熊市增陡，步入3月后，资金面紧张程度增强，短端利



率快速抬升，收益率曲线随后呈现熊市变平；3月受到资金紧张的影响，短端收益抬升，目前收益率曲线的平坦化明显。二季度前两个月债券市场发生了剧烈调整，在到监管引发的流动性冲击和经济相对悲观的预期下，4月初到5月底利率债1年期上行68BP而10年期上行30BP，收益率曲线呈现熊平态势，利率债期限利差不断压缩至历史低级水平。信用债收益率曲线则整体上行，信用利差走阔，中低等级总长久期信用债流动性骤减，一级信用债融资也持续负增，发行利率也随之大幅抬升。之后监管态度缓和、央行维稳资金面，市场情绪得以修复，6月份开始随着资金面平稳、同业存单发行收益率回落，债券市场大幅回暖，利率债中5-10年下行20BP左右，期限利差进一步压缩，信用债市场也得到极大的修复，成交活跃，3-5年估值下行30-40BP，曲线形态也更加平坦。

报告期组合根据市场行情，保持了适中的杠杆和久期水平，并布局行业利润改善，利差有望收窄的短久期票息较高产业债。在6月监管放缓的时间窗口，及时加仓流动性好的信用债和利率债以博取资本利得，并择机卖出流动性较弱和久期较长的债券。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，C级份额净值增长率为0.16%，同期业绩比较基准收益率为-2.11%；E级份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为-2.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月银行自查结束、金融工作会议召开，这些事件都会带来政策面的冲击，但是，基本面（经济增长和物价水平）将逐渐成为主导债券市场的因素。从近期的数据来看，基建投资增速已经回落，地产投资虽然保持韧性，但在地产调控高压政策的限制下，投资拐点已经显现。因此，经济增长下行的压力正在不断加大。但同时我们预计经济回落的速度会比较慢。首先全球经济依然处于复苏态势，尤其是近期欧洲经济复苏整体比较强劲，由此带动的国内净出口增速的回升，对内需下降有所对冲；第二，制造业方面，从实际利率变化看制造业投资大概滞后于实际利率8个月以上，3季度前制造业投资还会保持恢复性增长；房地产方面，由于房地产销售增速仍在高位，投资增速在3季度前会保持稳中有降的趋势。总体来看，下半年的经济增速虽有所回落，但是三季度仍然难以见到基本面快速下滑的情况，到了四季度经济下行压力可能会略有呈现，因此货币政策的放开仍然需要耐心。

在基本面缓慢下行及货币政策保持中性的背景下，我们坚持下半年震荡慢牛的观点，资金面及政策面的预期差会造成收益率的波动，同时也创造交易的机会。

展望下半年季度，组合会坚持不盲目追高的宗旨，但在市场震荡调整中把握低吸的机会，积极参与利率债的交易机会。信用债方面，从目前的信用利差来看处于中位数以下，基本在1/4分位处水平，相对来说信用利差保护依旧较小，在金融去杠杆周期中，信用利差未来依旧具有进一步走阔的空间。因此对于长久期中低等级的信用债而言，依旧需要保持较为谨慎的态度，会继续关注短久期高票息的信用债。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返

回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。权益登记日为2017年6月28日，场内除息日为2017年6月29日，场外除息日为2017年6月28日，C类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.65元，合计发放红利 1,401,143.36 元，其中现金分红 1,175,101.29 元。E类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.65元，合计发放红利 57,956,036.02 元，其中现金分红为 57,955,983.47 元。

本基金本年度收益分配满足法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基

金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金于2017年6月28日开始向全体份额持有人进行利润分配。场内除息日为2017年6月29日，场外除息日为2017年6月28日，C类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.650元，合计发放红利1,401,143.36元，其中现金分红1,175,101.29元。E类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.650元，合计发放红利57,956,036.02元，其中现金分红为57,955,983.47元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	10,687,596.94	50,271,055.22
结算备付金	22,508.34	25,207,124.23
存出保证金	63,131.00	41,418.64
交易性金融资产	1,030,573,369.86	433,360,900.00
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—

债券投资	930,506,000.00	433,360,900.00
资产支持证券投资	100,067,369.86	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	70,000,345.00	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	11,566,834.53	13,420,069.16
应收股利	—	—
应收申购款	16,500.00	48,625.00
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,122,930,285.67	522,349,192.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年06月30日</b>	<b>2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	40,000,000.00
应付证券清算款	—	27,010,123.39
应付赎回款	—	90,954.69
应付管理人报酬	165,549.63	591,449.91
应付托管费	55,183.21	197,149.95
应付销售服务费	8,246.72	19,538.29
应付交易费用	13,360.64	32,822.86
应交税费	192,640.00	192,640.00
应付利息	—	26,644.14
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	272,936.35	375,000.00
负债合计	707,916.55	68,536,323.23

<b>所有者权益：</b>		
实收基金	869,284,088.50	334,999,806.26
未分配利润	252,938,280.62	118,813,062.76
所有者权益合计	1,122,222,369.12	453,812,869.02
负债和所有者权益总计	1,122,930,285.67	522,349,192.25

注：报告截止日2017年6月30日，中欧纯债C类基金份额净值1.224元，中欧纯债C类基金份额21,612,544.27份；中欧纯债E类基金份额净值1.229元，中欧纯债E类基金份额891,631,365.96份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年 06月30日	上年度可比期间2016年02月 02日（基金转型日）-2016 年06月30日
<b>一、收入</b>	<b>3,371,323.97</b>	<b>18,559,815.54</b>
1.利息收入	6,761,687.46	56,483,689.59
其中：存款利息收入	191,104.98	633,223.75
债券利息收入	6,326,226.92	55,404,231.47
资产支持证券利息收 入	31,013.69	—
买入返售金融资产收 入	213,341.87	—
其他利息收入	—	446,234.37
2.投资收益（损失以“—”号 填列）	-12,793,931.01	-12,756,215.64
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-12,793,931.01	-12,756,215.64
资产支持证券投资收 益	—	—
贵金属投资收益	—	—

衍生工具收益	—	—
股利收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“—”号填列）	9,403,564.61	-25,319,641.73
4.汇兑收益（损失以“—”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2.91	151,983.32
<b>减：二、费用</b>	<b>1,916,751.12</b>	<b>12,478,165.35</b>
1. 管理人报酬	745,491.97	5,593,403.37
2. 托管费	248,497.30	1,864,467.80
3. 销售服务费	62,595.54	1,558,017.71
4. 交易费用	14,136.48	44,567.60
5. 利息支出	634,293.48	3,242,157.92
其中：卖出回购金融资产支出	634,293.48	3,242,157.92
6. 其他费用	211,736.35	175,550.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,454,572.85</b>	<b>6,081,650.19</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>1,454,572.85</b>	<b>6,081,650.19</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2017年01月01日-2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	334,999,806.26	118,813,062.76	453,812,869.02
二、本期经营活动产生的基金	0	1,454,572.85	1,454,572.85

净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	534,284,282.24	192,027,824.39	726,312,106.63
其中：1.基金申购款	866,420,520.03	310,454,544.72	1,176,875,064.75
2.基金赎回款	-332,136,237.79	-118,426,720.33	-450,562,958.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0	-59,357,179.38	-59,357,179.38
五、期末所有者权益(基金净值)	869,284,088.50	252,938,280.62	1,122,222,369.12
项 目	上年度可比期间		
	2016年02月02日(基金转型日)-2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	310,041,192.83	123,560,172.28	433,601,365.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	7,769,427.49	3,774,332.85	11,543,760.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,401,466,706.38	588,421,160.46	1,989,887,866.84
其中：1.基金申购款	5,157,159,313.74	2,015,251,596.22	7,172,410,909.96
2.基金赎回款	-3,755,692,607.36	-1,426,830,435.76	-5,182,523,043.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,719,277,326.70	715,755,665.59	2,435,032,992.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")是由中欧纯债分级债券型证券投资基金转型而来。根据《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》原中欧纯债分级债券型证券投资基金为契约型开放式基金，基金分级运作期为3年。根据《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金份额转换结果的公告》，原中欧纯债分级债券型证券投资基金于2016年2月1日(基金转换日)，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)。自2016年2月2日起，本基金转型为中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称"中国邮政储蓄银行")。

根据《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》以及中欧基金管理有限公司披露的《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金份额转换结果的公告》，原中欧纯债分级债券型证券投资基金，纯债A份额和纯债B份额的基金份额转换日(即2016年2月1日)日终，基金管理人将根据纯债A和纯债B基金份额折算比例将基金份额持有人转换日登记在册的两类基金份额折算为中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)份额并不再分拆。折算后纯债A和纯债B的份额净值均调整为1.324元，基金份额数相应增加或减少，其后原中欧纯债分级债券型证券投资基金更名为中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)。于2016年2月1日(基金份额转换日)日终，纯债A折算前份额数为25,035,904.98份，折算比例为0.75543371，折算后份额数为18,912,966.58份；纯债B折算前份额数为300,607,523.74份，折算比例为1.02038277，折算后份额数为306,734,737.36份。基金管理人已根据《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》约定，对纯债A、纯债B的份额持有人的基金份额进行了计算，并由基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上字[2016]第80号文审核同意，本基金1,666,870.00份基金份额于2016年3月1日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或在封闭期满按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，在封闭期满可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据本基金管理人中欧基金管理有限公司2016年4月6日《中欧基金管理有限公司关



于中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)增加E类基金份额并相应修改基金合同的公告》的规定，经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，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。本基金原有的基金份额类别更名为C类基金份额，新增的基金份额类别命名为E类基金份额。C类基金份额的业务规则与现行规则相同；新增E类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司，只接受场外申赎，不参与上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括通知存款、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。本基金投资组合中：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%。本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2017年8月29日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2017年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（"中欧基金"）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（"中国	基金托管人、基金销售机构

邮政储蓄银行")	
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

###### 6.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年02月02日(基金转型日)-2016年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券	9,665,672.60	2.54%	10,126,410.96	1.16%

###### 6.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年02月02日(基金转型日)-2016年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

国都证券	134,400,000.00	7.81%	854,500,000.00	3.69%
------	----------------	-------	----------------	-------

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年02月02日(基金 转型日)-2016年06月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	745,491.97	5,593,403.37
其中：支付销售机构的客户维护费	10,016.56	231,356.70

注：支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年02月02日(基金 转型日)-2016年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	248,497.30	1,864,467.80

注：支付基金托管人 邮储银行 的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧纯债债券 (LOF) C	中欧纯债债券 (LOF) E	合计

中欧基金	701.92	—	701.92
中国邮政储蓄银行	19,764.89	—	19,764.89
国都证券	5.43	—	5.43
合计	20472.24	—	20472.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年02月02日(基金转型日)-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧纯债债券(LOF) C	中欧纯债债券(LOF) E	合计
中欧基金	1,258,628.73		1,258,628.73
中国邮政储蓄银行	38,059.87	—	38,059.87
国都证券	49.45	—	49.45
合计	1296738.05	—	1296738.05

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中欧基金管理有限公司，再由中欧基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 × 0.35%/ 当年天数。

本基金E类基金份额不收取销售服务费。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方本报告期内均未持有本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日-2017年06月30	2016年02月02日(基金转型)

	日		日)-2016年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄 银行	10,687,596.94	121,039.83	6,771,113.93	347,608.90

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

###### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为930,506,000.00元，属于第三层次的余额为100,067,369.86元，无属于第一层次的余额(2016年12月31日：属于第二层次的余额为433,360,900.00元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月27日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1

月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	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
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	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	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	10,710,105.28	0.95
7	其他资产	11,646,465.53	1.04
8	合计	1,122,930,285.67	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细



本基金本报告期内未买入股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无买入及卖出股票的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

### 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	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

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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。

**§ 8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额	持有人户数	户均持有的	持有人结构
----	-------	-------	-------

级别	(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧纯债债券（LOF）C	1,089	19,846.23	2,783,957.09	12.88%	18,828,587.18	87.12%
中欧纯债债券（LOF）E	13	68,587,028.15	891,592,022.75	100.00%	39,343.21	0.00%
合计	1,102	828,714.98	894,375,979.84	97.93%	18,867,930.39	2.07%

注：本基金E类份额期末机构投资者实际占比为99.9956%，个人投资者实际占比为0.0044%，上表为四舍五入结果。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中欧基金—浦发银行—上海浦银安盛资产管理有限公司	1500375	34.71%
2	中国船舶工业集团公司企业年金计划—中信银行股份有限公司	1000000	23.13%
3	杨合娥	273900	6.34%
4	严云澄	250000	5.78%
5	叶维保	240000	5.55%
6	高德荣	212200	4.91%
7	张润华	119402	2.76%
8	刘玉琼	103840	2.40%
9	罗羽旻	90000	2.08%
10	王方	87000	2.01%

注：以上均为纯债C场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	中欧纯债债券（LOF）C	749.00	0.00%
	中欧纯债债券（LOF）E	23.15	0.00%
	合计	772.15	0.00%

注：基金管理人的从业人员持有本基金C类份额的实际占比为0.0035%，持有本基金E类份额的实际占比为0.000003%，合计占比为0.00008%，上表为四舍五入结果。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中欧纯债债券（LOF）C	0
	中欧纯债债券（LOF）E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧纯债债券（LOF）C	0
	中欧纯债债券（LOF）E	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧纯债债券（LOF）C	中欧纯债债券（LOF）E
基金合同生效日(2013年1月31日)基金份额总额	976,522,201.53	—
本报告期期初基金份额总额	39,746,450.19	312,175,024.76
本报告期基金总申购份额	14,585,809.92	895,649,967.46
减：本报告期基金总赎回份额	32,719,715.84	316,193,626.26
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	21,612,544.27	891,631,365.96

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2017年3月30日发布公告，顾伟先生自2017年3月30日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向上海证监局报告。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金	占当期股票	佣金	占当期佣金	
	元					

	数量	额	成交总额比 例		总量的比例	
招商证券	1	—	—	—	—	
国都证券	1	—	—	—	—	
安信证券	1	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	
东方证券	1	—	—	—	—	
方正证券	1	—	—	—	—	
国泰君安	1	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	
民生证券	1	—	—	—	—	
申万宏源西 部证券	1	—	—	—	—	
申银万国	1	—	—	—	—	
中金公司	1	—	—	—	—	
中信证券	2	—	—	—	—	

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金 额	占当期债券 成交总额比例	成交金 额	占当期债券 回购成交总 额比例	成交 金额	占当期权证 成交总额比 例
招商证券	371,478, 519.5	97.46%	1,585,90 0,000	92.19%	—	—
国都证券	9,665,67 2.6	2.54%	134,400, 000	7.81%	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—

方正证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年6月30日	28750 1737.4 1	—	287,50 1,737. 41	—	—
机构	2	2017年6月22日至2017年6月30日	0	232,01 7,788. 09	—	232,017,78 8.09	25.41%
机构	3	2017年6月22日至2017年6月30日	0	232,01 7,788. 09	—	232,017,78 8.09	25.41%
机构	4	2017年6月22日至2017年6月30日	0	232,01 7,788. 09	—	232,017,78 8.09	25.41%
产品特有风险							



本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中欧基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十九日