

# 中欧纯债债券型证券投资基金 (LOF)

## 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 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

送出日期:2018 年 03 月 30 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 2018 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 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	
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	323,733,257.03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	2016-03-01	
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	15,884,930.37份	307,848,326.66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

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

中欧纯债债券（LOF）C主要财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年2月2日（基金份额转换后一工作日） -2016年12月31日
本期已实现收益	-1,560,637.82	32,396,698.20
本期利润	402,022.10	14,735,970.79
加权平均基金份额本期利润	0.0175	0.0270
本期基金份额净值增长率	1.81%	-0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0496	0.2845
期末基金资产净值	17,842,454.18	51,163,875.21
期末基金份额净值	1.123	1.287

中欧纯债债券（LOF）E主要财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年4月6日（基金转型日）-2016年12月31日
本期已实现收益	24,819,669.14	-4,002,271.89
本期利润	31,809,488.83	-12,245,187.84
加权平均基金份额本期利润	0.0395	-0.0081
本期加权平均净值利润率	3.40%	-0.20%
本期基金份额净值增长率	2.15%	-1.87%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	17,451,301.53	89,664,069.29
期末可供分配基金份额利润	0.0567	0.2872
期末基金资产净值	347,947,634.22	402,648,993.81
期末基金份额净值	1.130	1.290

3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	0.24%	-1.87%

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（为期末余额，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

##### 中欧纯债债券（LOF）C

阶段	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
过去三个月	0.71%	0.03%	-1.15%	0.06%	1.86%	-0.03%
过去六个月	1.66%	0.03%	-1.30%	0.05%	2.96%	-0.02%
过去一年	1.81%	0.05%	-3.38%	0.06%	5.19%	-0.01%
过去三年	12.77%	0.09%	-0.98%	0.08%	13.75%	0.01%
自基金合同生效至今	31.50%	0.12%	1.11%	0.09%	30.39%	0.03%

##### 中欧纯债债券（LOF）E

阶段	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
过去三个月	0.80%	0.04%	-1.15%	0.06%	1.95%	-0.02%

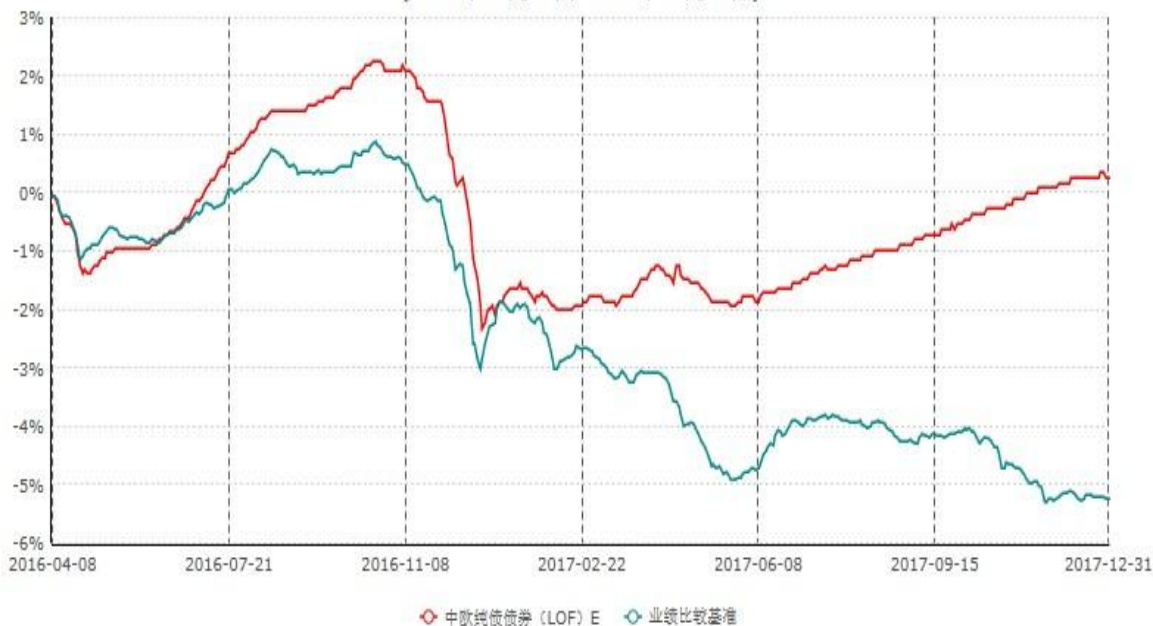
过去六个月	1.83%	0.04%	-1.30%	0.05%	3.13%	-0.01%
过去一年	2.15%	0.05%	-3.38%	0.06%	5.53%	-0.01%
自基金份额 运作日至今	0.24%	0.08%	-5.19%	0.08%	5.43%	0.00%

### 3.2.2 自基金转型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



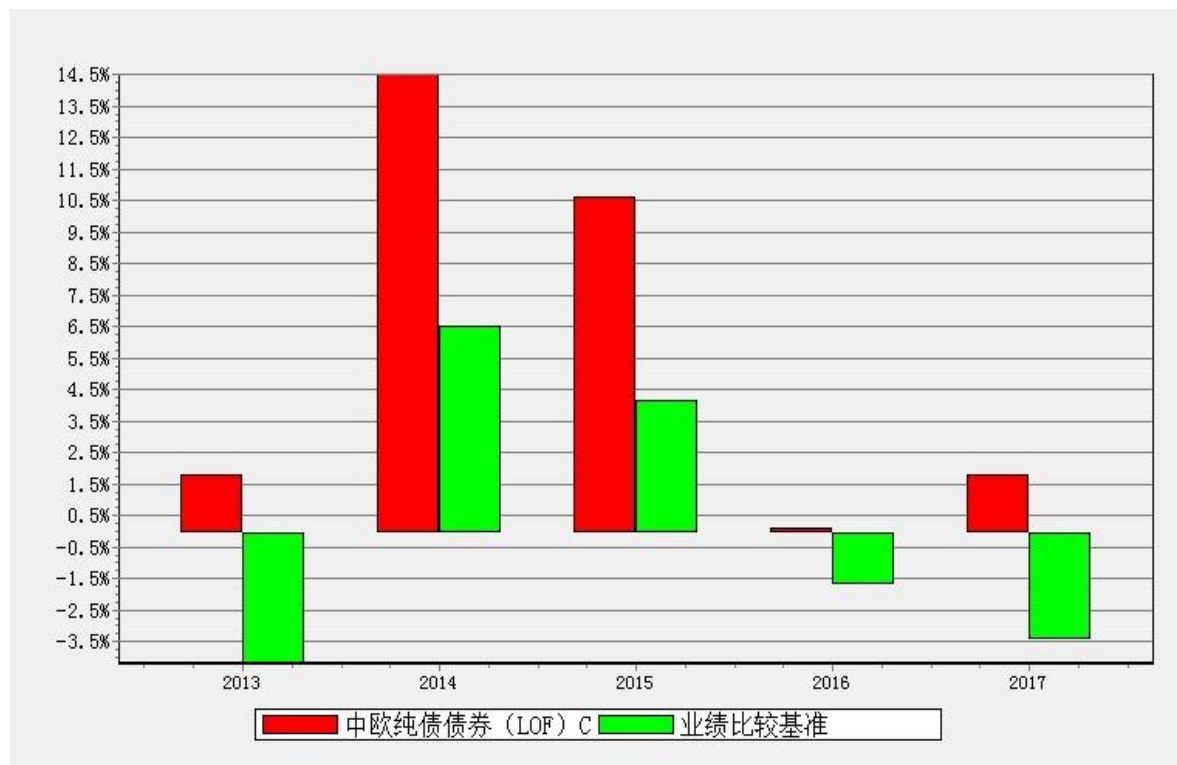
注：本基金转型日期为2016年2月2日。

中欧纯债债券（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04月08日-2017年12月31日)



注：自 2016 年 4 月 6 日起，本基金新增 E 类份额，图示日期为 2016 年 04 月 08 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2013年1月31日，2013年度数据为2013年1月31日至2013年12月31日数据。



注：自2016年4月6日起，本基金新增E类份额，2016年度数据为2016年4月8日至2016年12月31日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧纯债债券 (LOF) C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	1.85	3,278,572.27	545,533.45	3,824,105.72	-
2016	0.38	7,265,768.01	2,093,684.17	9,359,452.18	-
合计	2.23	10,544,340.28	2,639,217.62	13,183,557.90	-

中欧纯债债券 (LOF) E

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	1.85	287,145,094.13	54.38	287,145,148.51	-



2016	0.39	51,903,461.74	14,353,958.23	66,257,419.97	-
合计	2.24	339,048,555.87	14,354,012.61	353,402,568.48	-

#### § 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以及自然人股东，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、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司。截至2017年12月31日，本基金管理人共管理66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	2016-02-16	2017-06-27	12	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。2015-06-23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	2017-04-07	-	5	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。2016-03-24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

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2017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。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。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。下半年经济逐渐显露出疲态，但韧性犹在。7、8月经济基本面数据连续全面不及预期，且大宗商品（尤其指黑色系期货和有色期货）在9月持续走弱，因此市场普遍预期四季度基本面下行压力较大，然而整个四季度投资增速仍显强韧、工业增速维持高位，PPI亦没有明显回落。

政策方面，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。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。四季度监管也再次加码，资管新规征求意见稿出台，表明去杠杆仍在进程中，银行从表外回表内的方向难以发生变化，机构负债端的压力进一步提高。货币政策方面，中央经济工作会议中对货币政策的描述是“稳健的货币政策要保持中性，管住货币供给总闸门”，方向上比上一年度更加趋严。

债券市场方面，一季度收益率曲线整体向上平移，二季度前两个月债券市场发生了剧烈调整，在监管日趋收紧的预期下，4月初到5月底利率债1年期上行68BP而10年上行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极低水平。信用债收益率曲线则整体上行，信用利差走阔，中低评级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。进入6月央行维稳资金面，市场情绪得以修复。随着同业存单发行收益率的回落，债券市场大幅回暖，迎来了全年最大幅度的一次反弹。三季度初债券市场受到基本面和资金面两方面的作用力，走出窄幅震荡的行情。但由于市场一致预期四季度经济有望出现下行给债券市场带来机会，因此交易性头寸开始建仓长久期利率债。然而在四季度，基本面仍显强韧、工业增速维持高位，PPI亦没有明显回落，市场引发了剧烈的调整，四季度债券各品种收益大幅上行。

报告期内，本基金主要投资于短融、同业存款和同业存单，对短期债券进行了波段操作。组合整体流动性较好，期限搭配和杠杆维持适当水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金C类份额净值增长率为1.81%，同期业绩比较基准增长率为-3.38%；E类份额净值增长率为2.15%，同期业绩比较基准率为-3.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

阶段性来看，2月资金面的超预期宽松是本轮债市回暖的核心逻辑。而由于年初基本面数据相对有限，并且扰动因素相对较多，2月PMI数据的大幅走弱，需求的边际放缓态势下，基本面对利率债不会构成进一步的利空，但也难以成为趋势性债牛的主要支撑。

在此背景下，债券市场情绪短期仍将取决于对资金面和政策面的变化。从3月份流动性供给看，CRA逐渐退出将回收2万亿流动性，流动性将逐步趋紧。外部环境看，3月中下旬美联储或加息，国内政策利率仍有不确定性；从流动性需求看，NCD到期量处在年内较高水平。再加上3月份有部分监管新规实行，同业负债比例、净稳定资金比例(NSFR)、可能落地的“资管新规”，都将导致金融机构风险偏好下降，甚至出现明显的流动性压力。在资管细则没有出台并被市场消化前，现存“违规”资管产品仍在勉强维持，银行体系资金紧张的局面短期仍无法解决。

操作方面，展望下季度，本基金将继续做好期限匹配，主要投资于收益率较高的短融、同业存款和同业存单，维持适当的杠杆水平，并对短期债券进行波段操作以提高组合的收益。

#### 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验。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

根据本基金基金合同的相关约定，本基金向本基金份额持有人进行利润分配，第一次分红权益登记日为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0.650元，合计发放红利1,401,143.36元，其中现金分红为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。第二次分红权益登记日为2017年8月9日，场内除息日为2017年8月10日，场外除息日为

2017年8月9日，C类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.1元，合计发放红利2,210,438.62元，其中现金分红为1,908,847.86元，E类份额持有人按每10份基金份额派发红利1.1元，合计发放红利216,151,122.82元，其中现金分红为216,151,121.96元。第三次分红权益登记日为2017年12月19日，场内除息日为2017年12月20日，场外除息日为2017年12月19日，C类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.100元，合计发放红利212,523.74元，其中现金分红为194,623.12元，E类份额持有人按每10份基金份额派发红利0.100元，合计发放红利13,037,989.67元，其中现金分红为13,037,988.70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（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遵规守信、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，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本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 审计报告**

本报告期基金年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## **§ 7 年度财务报表**

## 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	45,066,723.68	50,271,055.22
结算备付金	1,020,624.29	25,207,124.23
存出保证金	20,641.62	41,418.64
交易性金融资产	298,277,000.00	433,360,900.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	298,277,000.00	433,360,900.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	14,000,141.00	-
应收证券清算款	2,003,967.12	-
应收利息	7,726,739.72	13,420,069.16
应收股利	-	-
应收申购款	251,030.00	48,625.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	368,366,867.43	522,349,192.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 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	1,169,082.32	90,954.69
应付管理人报酬	627,303.86	591,449.91
应付托管费	209,101.31	197,149.95
应付销售服务费	5,798.40	19,538.29
应付交易费用	47,853.14	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	325,000.00	375,000.00
负债合计	2,576,779.03	68,536,323.23
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	308,196,131.78	334,999,806.26
未分配利润	57,593,956.62	118,813,062.76
所有者权益合计	365,790,088.40	453,812,869.02
负债和所有者权益总计	368,366,867.43	522,349,192.25

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.130元，基金份额总额323,733,257.03份。其中下属C类基金份额净值为人民币1.123元，份额总额为15,884,930.37份；下属E类基金份额净值为人民币1.130元，份额总额为307,848,326.66份。

## 7.2 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日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月2日(基金转型日) 至2016年12月31日
一、收入	45,277,848.67	33,958,373.76
1. 利息收入	63,173,763.37	129,593,009.69

其中：存款利息收入	408,180.21	1,145,456.09
债券利息收入	58,584,103.75	127,893,573.06
资产支持证券利息收入	3,134,956.73	-
买入返售金融资产收入	1,046,522.68	553,980.54
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-26,859,912.61	-69,882,980.81
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-26,708,513.21	-69,882,980.81
资产支持证券投资收益	-151,399.40	-
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）	8,952,479.61	-25,903,643.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	11,518.30	151,988.24
<b>减：二、费用</b>	<b>13,066,337.74</b>	<b>31,465,751.80</b>
1. 管理人报酬	5,705,103.00	12,378,761.91
2. 托管费	1,901,700.97	4,126,253.95
3. 销售服务费	100,222.18	1,964,138.00
4. 交易费用	55,587.65	76,148.01
5. 利息支出	4,881,323.94	12,486,252.41
其中：卖出回购金融资产支出	4,881,323.94	12,486,252.41
6. 其他费用	422,400.00	434,197.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>	<b>32,211,510.93</b>	<b>2,492,621.96</b>



号填列)		
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	32,211,510.93	2,492,621.96

### 7.3 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日至2017年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31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净值变动数(本期利润)	-	32,211,510.93	32,211,510.93
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)	-26,803,674.48	197,538,637.16	170,734,962.68
其中: 1. 基金申购款	1,913,405,056.50	619,098,351.38	2,532,503,407.88
2. 基金赎回款	-1,940,208,730.98	-421,559,714.22	-2,361,768,445.20
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)	-	-290,969,254.23	-290,969,254.23
五、期末所有者权益(基金净值)	308,196,131.78	57,593,956.62	365,790,088.40
项目	上年度可比期间 2016年2月2日(基金转型日)至2016年12月31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	121,124,416.84	431,165,609.67

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,492,621.96	2,492,621.96
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)	24,958,613.43	70,812,896.11	95,771,509.54
其中：1. 基金申购款	5,223,588,508.32	2,175,960,728.33	7,399,549,236.65
2. 基金赎回款	-5,198,629,894.89	-2,105,147,832.22	-7,303,777,727.11
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)	-	-75,616,872.15	-75,616,872.15
五、期末所有者权益(基金净值)	334,999,806.26	118,813,062.76	453,812,869.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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2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(基金转换日)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《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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自2017年12月19日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同

业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

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	基金托管人、基金销售机构
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
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司（“北京百骏”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的控股子公司
中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司（“钱滚滚”）	基金管理人的控股子公司

注：1、本报告期内，经中欧基金管理有限公司（以下简称“中欧基金”）2017年股东会通过，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(Unione di Banche Italiane S.p.A.)将其持有的公司10%股权转让给窦玉明、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。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2017年8月8日在指定媒介进行了信息披露，变更后的公司股权结构详见2017年8月8日披露的相关公告。

2、本报告期内，中欧基金管理有限公司旗下子公司钱滚滚财富管理（上海）有限公司，自2017年11月20日起将公司名称变更为“中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司”。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2017年11月22日在指定媒体进行了信息披露。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月2日（基金转型日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国都证券	30,167,672.60	4.26%	91,526,272.61	6.30%

7.4.8.1.5 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日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月2日（基金转型日）至2016年12月31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	3.96%	4,535,600,000.00	7.60%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至	上年度可比期间 2016年2月2日（基金转型

	2017年12月31日	日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,705,103.00	12,378,761.91
其中:支付销售机构的客户维护费	66,373.99	412,108.19

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月2日(基金转型日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,901,700.97	4,126,253.95

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

#### 7.4.8.2.3 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日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧纯债债券(L0 F) C	中欧纯债债券(L0 F) E	合计
国都证券	10.30	-	10.30
中国邮政储蓄银行股份有限公司	34,118.74	-	34,118.74
中欧基金	824.52	-	824.52
合计	34,953.56	-	34,953.56



获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年2月2日（基金转型日）至2016年12月31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
国都证券	11,446.10	-	11,446.10
中国邮政储蓄银行股份有限公司	62,724.16	-	62,724.16
中欧基金	194,406.59	-	194,406.59
合计	268,576.85	-	268,576.85

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日纯债C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=前一日纯债C基金资产净值×0.35%/当年天数。

2、纯债E不收取销售服务费。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固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。

##### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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日至2017年12月31日		2016年2月2日(基金转型日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	45,066,723.68	296,358.64	50,271,055.22	587,117.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31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工具中属于第二层次的余额为人民币298,277,000.00元，无划分为第一层次和第三层次的余额。(于2016年12月31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工具中属于第二层次的余额为人民币433,360,900.00元，无划分为第一层次和第三层次的余额。)

###### 7.4.14.1.2.2 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、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关的股票和债券的

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的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

#### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	298,277,000.00	80.97
	其中：债券	298,277,000.00	80.97
	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	14,000,141.00	3.80
	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	46,087,347.97	12.51
8	其他各项资产	10,002,378.46	2.72
9	合计	368,366,867.43	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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。

#### 8.4.2 累计卖出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卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

### 8.5 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	19,950,000.00	5.45
	其中：政策性金融债	19,950,000.00	5.45
4	企业债券	59,373,000.00	16.23
5	企业短期融资券	171,171,000.00	46.79
6	中期票据	47,783,000.00	13.06
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	298,277,000.00	81.54

### 8.6 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	011759028	17晋能SCP003	300,000	30,201,000.00	8.26
2	124602	14国网01	300,000	30,201,000.00	8.26
3	101653022	16国电集MTN	300,000	29,469,000.	8.06

		001		00	
4	136469	16联通01	300,000	29,172,000.00	7.98
5	011771013	17中材国际SCP001	200,000	20,148,000.00	5.51

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

##### 8.11.3 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

### 8.12.3 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	20,641.62
2	应收证券清算款	2,003,967.12
3	应收股利	-
4	应收利息	7,726,739.72
5	应收申购款	251,030.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,002,378.46

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总	持有份额	占总

	(户)			份 额 比 例		份 额 比 例
中欧 纯债 债券 (LO F) C	931	17,062.22	2,306,275.00	14.5 2%	13,578,655.37	85.4 8%
中欧 纯债 债券 (LO F) E	7	43,978,332.38	307,809,744.7 8	99.9 9%	38,581.88	0.01%
合计	938	345,131.40	310,116,019.7 8	95.7 9%	13,617,237.25	4.21%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 中欧纯债债券 (LOF) C

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	1,306,27 5.00	34.30
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	1,000,00 0.00	26.25
3	严云澄	250,000.0 0	6.56
4	高德荣	212,200.0 0	5.57
5	魏海清	201,168.0 0	5.28
6	叶维保	200,000.0 0	5.25
7	张润华	119,402.0 0	3.13
8	刘玉琼	103,840.0	2.73

		0	
9	周希海	59,389.00	1.56
10	郭允健	49,700.00	1.30

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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 持有本基金	中欧纯债债券 (L OF) C	749.00	0.00%
	中欧纯债债券 (L OF) E	15.42	0.00%
	合计	764.42	0.00%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金C类份额的实际比例为0.004715%，持有本基金E类份额的实际比例为0.000005%，合计占比为0.000236%，上表展示系四舍五入结果。

### 9.4 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 和研究部门负责人持有本开放式 基金	中欧纯债债券 (LO F) C	0
	中欧纯债债券 (LO F) 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 (LO F) C	0
	中欧纯债债券 (LO F) E	0
	合计	0

## § 10 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01月31)	976,522,201.53	-



日)基金份额总额		
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	37,217,956.10	1,972,857,539.87
减:本报告期基金总赎回份额	61,079,475.92	1,977,184,237.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,884,930.37	307,848,326.66

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

#### 11.2.1 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。

#### 11.2.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人改聘了为基金进行审计的会计师事务所,为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为115,000.00元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	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。

#### 11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总量的比例	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	30,167,672.60	4.26%	134,400,000.00	3.96%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	677,626,134.87	95.74%	3,258,900,000.00	96.04%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中欧基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十日