中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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:2019 年 08 月 26 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§1 重要提示及目录

1.1 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2019年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 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 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§6 半年度财务会计报告(未经审计) 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 43
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 44
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 44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.3 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 46
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 51
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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧纯债添利分级债券型证券投资基金	
基金简称	中欧纯债添利分级债券	
场内简称	中欧添利	
基金主代码	166021	
基金运作方式	契约型，添利A在添利B的每个封闭运作期内每满半年开放一次，接受申购与赎回申请；添利B根据基金合同的约定定期开放，接受申购与赎回申请，其余时间封闭运作。本基金在添利B的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利A与添利B的赎回、折算以及申购等事宜。基金合同生效，在本基金符合法律法规和深交所规定的上市条件的情况下，本基金添利B份额申请上市与交易。	
基金合同生效日	2013年11月28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	1,565,241,240.97份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧纯债添利分级债券A	中欧纯债添利分级债券B
下属分级基金场内简称	中欧添A	中欧添B
下属分级基金的交易代码	166022	150159
报告期末下属分级基金的份额总额	17,952,996.88份	1,547,288,244.09份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，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、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期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。	
下属分级基金的风险收益特征	添利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。	添利B将表现出高风险、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。

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	田东辉
	联系电话	021-68609600	010-68858113
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95580
传真		021-33830351	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区金融大街3号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		窦玉明	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披	证券时报

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

露报纸名称	
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	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年01月01日- 2019年06月30日）
本期已实现收益	45,005,042.79
本期利润	46,007,725.94
加权平均基金份额本期利润	0.0293
本期加权平均净值利润率	2.71%
本期基金份额净值增长率	2.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	505,664,821.71
期末可供分配基金份额利润	0.3231
期末基金资产净值	1,712,665,542.61
期末基金份额净值	1.094
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	36.44%

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

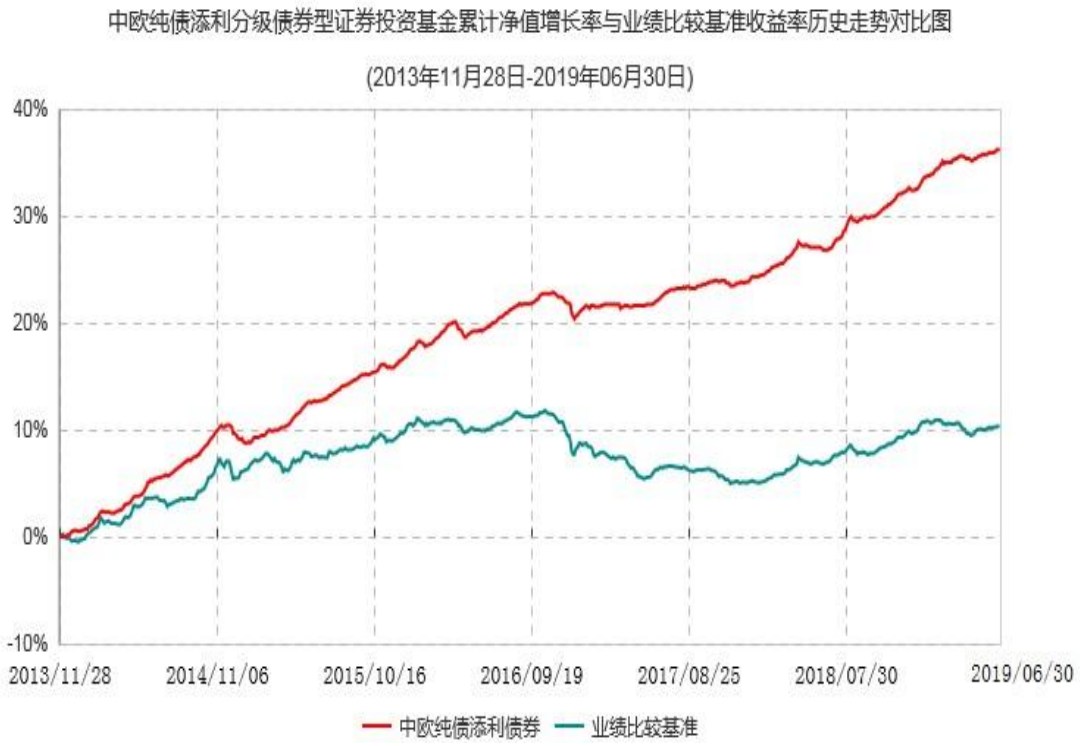
3.2 基金净值表现

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

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
过去一个月	0.39%	0.05%	0.28%	0.03%	0.11%	0.02%
过去三个月	0.59%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.83%	-0.01%
过去六个月	2.76%	0.06%	0.24%	0.06%	2.52%	-
过去一年	7.26%	0.06%	2.82%	0.06%	4.44%	-
过去三年	13.62%	0.06%	0.03%	0.08%	13.59%	-0.02%
自基金合同生效起至今	36.44%	0.07%	10.49%	0.08%	25.95%	-0.01%

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期末（2019年06月30日）
添利A与添利B基金份额配比	0.035:3
期末添利A份额参考净值	1.003
期末添利A份额累计参考净值	1.215
期末添利B份额参考净值	1.095
期末添利B份额累计参考净值	1.430
添利A的预计年收益率	3.40%

§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有限公司、国都证券股份有限公司、北京

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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2.20亿元人民币，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2019年6月30日，本基金管理人共管理70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		
王家柱	基金经理	2018-09-21	-	5	历任工银瑞信基金管理有限公司信用评级研究员（2013.07-2016.11）。2016-12-05加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理

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。

3、因个人原因，王家柱自2019年7月19日起不再担任该基金的基金经理，并于2019年7月20日进行了信息披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有1次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2019年以来，我国经济基本面呈现阶梯下行态势，一季度金融经济数据阶段性缓和，GDP同比增长6.4%略超预期，主要得益于房地产调控边际放松下的地产景气度回升、地方债发行前置下的财政发力、消费企稳和工业生产的超预期回升。二季度开始，受棚改退潮带动三四线房地产市场景气度回落，热点城市调控政策加码，以及地产融资渠道收紧影响，房地产行业疲态出现，2019年上半年商品房销售面积同比下降1.8%，销售金额增速也出现回落，对下半年的房地产投资构成不利影响。春节因素消除后，工业增加值增速在4、5月下行，6月有所回升，拖累上半年规模以上工业增加值累计同比增速回落0.7个百分点。2019年以来地方政府专项债发行前置，6月10日专项债充当项目资本金的新政推出，可撬动一定的基建投资，但对全年基建投资的影响预计仍较为有限。消费的主线是减税降费促进居民购买力，但2019年以来社零增速受到汽车、家电的拖累而呈现下滑态势，虽然2019年6月受国五换国六促销影响，汽车销售反季节性超预期提升，但考虑汽车销量增速在2018年顶部回落后进入下行周期，手机等电子产品消费增速明显放缓，房地产财富效应也在下降，综合而言，消费层面较难形成趋势性改善。

中美贸易摩擦成为了扰动市场的重要变量，5月10日起美国对从中国进口的2000亿美元清单商品加征的关税税率由10%提高到25%。6月29日G20峰会上中美双方宣布重启谈判，贸易摩擦一度迎来阶段性缓和。8月2日至8月6日特朗普威胁对3000亿美元输美商品加增关税，人民币汇率破7，美国将中国列入汇率操纵国，中美关系再次陷入紧张局面。展望未来，中美贸易战仍将旷日持久。

债券市场方面，经济基本面弱化，中美贸易战反复，以及包商事件引起市场恐慌，带动利率债在4月下旬开启了新一轮下行，十年期国债收益率从4月的3.4%逐步逼近3.0%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附近。受包商事件导致的流动性分层影响，自6月开始，非银机构的产品杠杆难以为继，结构化融资的爆仓重灾区集中在低资质城投和地产领域出现，债市投资者总体转为避险，市场流动性分层有逐步向信用分层演化的迹象。

操作方面，一季度债券市场利率行情快速向信用债行情切换，本基金严格控制仓位和久期，增加杠杆套息的仓位比例。二季度以来，本基金在严控回撤风险前提下增加长久期利率债和高等级信用债仓位，顺势拉长久期，以获取资本利得收益。为了规避六月中下旬的流动性风险，本组合将银行间杠杆移到资金可得性更好的交易所，进一步降低总体杠杆率，防止资金面的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为2.76%，同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年是我国经济结构的转型之年，经济的主要动能正从地产和基建逐渐向制造业和消费转变。大方向是守住不发生系统性风险的底线，推进经济结构转型，有序降低房地产行业的重要性，发力财政基建对冲下行压力，减税降费利于先进制造业企业复苏，同时促进最终消费。在经济新旧动能转换的阵痛期内，7月政治局会议对当前经济运行的判断更为谨慎，经济基本面下行压力加大已成为各方的共识，而中美贸易摩擦也成为了重要的不确定因素。总体来看，2019年下半年政策仍将维持宽松，流动性易松难紧，人民币汇率弹性加大也给国内债券市场带来新的想象空间。

信用债呈现的结构性分化行情在2019年下半年或将继续演绎，但是内在的逻辑却有所变化，2018年四季度至2019年6月信用利差的快速回落的原因在于信用基本面的改善和优质信用品的供不应求，前者是基于总体偏松的货币政策推动市场从宽货币向宽信用切换，龙头国企、核心地区城投的基本面边际改善；后者则是在民企信用事件频发和资管新规过渡期的影响下，债券投资者在信用品的行业和期限的选择上高度一致。2019年下半年信用债的结构性分化逻辑则来自债券市场风险偏好的收缩，流动性分层逐渐催生尾部金融机构和尾部信用品的风险，原本在宽信用环境中下沉资质的资金也会转而投向中高资质信用品，因此这类信用品的供不应求会在2019年下半年延续，信用债两极分化程度会继续上升，中低资质信用品利差走阔是大概率事件。

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、

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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"）在中欧纯债添利分级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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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：中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	555,389.06	261,177.49
结算备付金		43,244,189.27	51,014,788.95
存出保证金		92,554.26	153,503.54
交易性金融资产	6.4.7.2	2,070,805,785.00	2,657,850,306.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,938,267,785.00	2,505,065,506.70
资产支持证券投资		132,538,000.00	152,784,800.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	49,960,314.94	-
应收证券清算款		10,276,242.10	2,443,203.99
应收利息	6.4.7.5	47,270,164.23	42,157,850.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,222,204,638.86	2,753,880,831.29
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		497,580,000.00	1,077,091,000.00
应付证券清算款		9,293,538.88	2,354,319.51
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		842,784.75	850,313.69
应付托管费		210,696.22	212,578.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,659.69	18,154.11
应交税费		1,389,973.54	1,413,503.03
应付利息		34,120.14	1,191,169.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	185,323.03	335,000.00
负债合计		509,539,096.25	1,083,466,038.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,168,235,878.22	1,170,123,955.46
未分配利润	6.4.7.10	544,429,664.39	500,290,837.62
所有者权益合计		1,712,665,542.61	1,670,414,793.08
负债和所有者权益总计		2,222,204,638.86	2,753,880,831.29

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额总1,565,241,240.97。其中A类份额净值1.003元，基金份额17,952,996.88份；B类份额净值1.095元，基金份额1,547,288,244.09份。

6.2 利润表

会计主体：中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日 至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

一、收入		64,237,272.99	66,593,529.77
1.利息收入		49,335,195.22	50,337,861.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	434,015.87	232,284.21
债券利息收入		45,727,331.14	48,142,628.94
资产支持证券利息收入		2,931,858.62	1,493,084.03
买入返售金融资产收入		241,989.59	469,863.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,899,222.60	-3,333,510.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	13,805,370.55	-2,834,721.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	93,852.05	-498,788.94
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,002,683.15	19,589,178.76
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	172.02	-
减：二、费用		18,229,547.05	25,530,096.39
1．管理人报酬		5,057,642.15	4,739,900.11
2．托管费		1,264,410.53	1,184,975.09
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	10,554.05	21,567.00
5．利息支出		11,615,585.76	19,232,219.83

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

其中：卖出回购金融资产支出		11,615,585.76	19,232,219.83
6．税金及附加		157,431.53	176,588.95
7．其他费用	6.4.7.19	123,923.03	174,845.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,007,725.94	41,063,433.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,007,725.94	41,063,433.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019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)	1,170,123,955.46	500,290,837.62	1,670,414,793.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,007,725.94	46,007,725.94
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)	-1,888,077.24	-1,868,899.17	-3,756,976.41
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-1,888,077.24	-1,868,899.17	-3,756,976.41
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“-”	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,168,235,878.22	544,429,664.39	1,712,665,542.61
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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)	1,174,284,513.24	391,916,120.50	1,566,200,633.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,063,433.38	41,063,433.38
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)	-2,921,424.00	-2,699,544.90	-5,620,968.90
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-2,921,424.00	-2,699,544.90	-5,620,968.90
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,171,363,089.24	430,280,008.98	1,601,643,098.22

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2013]第1216号《关于核准中欧纯债添利分级债券型证券投资基金募集的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,346,909,981.68元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2013）第734号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,347,672,794.64份基金份额，包含认购资金利息折合762,812.96份，其中添利A的基金份额总额为942,266,844.64份，包含认购资金利息折合355,562.96份，添利B的基金份额总额为405,405,950.00份，包含认购资金利息折合407,250.00份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》和《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，添利A基金份额（以下简称"添利A"） 根据基金合同的规定获取约定收益，并在添利B基金份额（以下简称"添利B"）的每个封闭运作期内每满半年开放一次，接受申购与赎回申请。添利B根据基金合同的约定定期开放，接受申购与赎回申请，其余时间封闭运作。基金管理人可以根据有关规定，在符合基金上市交易条件下，添利B将申请在深圳证券交易所上市交易。本基金在添利B的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利A与添利B的赎回、折算以及申购等事宜。添利B的每一封闭运作期长度为3年。添利A的基金份额折算基准日为自添利B当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日。添利A的基金份额净值调整为1.000元，折算后，基金份额持有人持有的添利A的份额数按照折算比例相应增减。本基金在扣除添利A的约定收益后的全部剩余收益归添利B享有，亏损以添利B的资产净值为限并由添利B承担。添利A根据基金合同的规定获取约定收益，为一年期银行定期存款利率（税后）加上利差。其中计算添利A首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效之日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率；其后添利A每个赎回开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新调整添利A的约定年收益率。视国内利率市场变化，基金管理人应最迟于每个过渡期开始之前2个工作日，设定并公告添利B下一个封闭运作期内适用的、计算添利A约定收益的利差值。利差的取值范围从0%（含）到2.5%（含）。

基金合同生效后，添利B首个封闭运作期内适用的、添利A的约定收益的利差值由基金管理人在基金份额发售前设定，并在本基金的《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》中公告。基金管理人在基金资产净值计算的基础上，采用"虚拟

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

清算"原则计算并公告添利A和添利B的基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、可转债、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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证，也不参与一级市场的新股申购或增发。本基金投资组合中：债券资产占基金资产的比例不低于80%；在添利A的开放日及该日前4个工作日和添利B的赎回开放日及该日前4个工作日，本基金所持有现金和到期日不超过一年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。

6.4.2 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。

6.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	555,389.06
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	555,389.06

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,385,962,989.24	1,394,136,785.00	8,173,795.76
	银行间市场	541,088,206.86	544,131,000.00	3,042,793.14
	合计	1,927,051,196.10	1,938,267,785.00	11,216,588.90
资产支持证券		132,538,000.00	132,538,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,059,589,196.10	2,070,805,785.00	11,216,588.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	49,960,314.94	-
合计	49,960,314.94	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	1,182.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	17,513.91
应收债券利息	44,162,393.61
应收资产支持证券利息	3,009,256.62
应收买入返售证券利息	79,780.48
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	37.53
合计	47,270,164.23

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	2,659.69
合计	2,659.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用-审计费	47,108.87
预提费用-信息披露费	138,214.16
合计	185,323.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 （中欧纯债添利分级债券A）	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,348,050.82	10,910,397.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,756,976.41	-1,888,077.24
本期末	17,952,996.88	9,022,320.35

金额单位：人民币元

项目 （中欧纯债添利分级债券B）	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,547,288,244.09	1,159,213,557.87
本期申购	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,547,288,244.09	1,159,213,557.87

注：根据《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金招募说明书》的相关内容，自添利B当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日，基金管理人将对添利A进行基金份额折算，折算日日终，添利A的基金份额参考净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的添利A份额数按招募说明书规定的折算方式进行折算。

根据基金管理人于2019年5月29日发布的《关于中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之纯债A份额折算方案的公告》，添利A于2019年5月31日进行了2019年度的第一次份额折算。2019年5月31日，添利A的基金份额净值为1.01695342元，据此计算的添利A的折算比例为1.01695342。折算后，添利A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人原来持有的每1份添利A相应增加至1.01695342份。折算前，添利A的基金份额总额为21,348,050.82份，折算后，添利A的基金份额总额为21,709,973.293份，各基金份额持有人持有的添利A经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	462,396,291.96	37,894,545.66	500,290,837.62
本期利润	45,005,042.79	1,002,683.15	46,007,725.94
本期基金份额交易产生的变动数	-1,736,513.04	-132,386.13	-1,868,899.17
其中：基金申购款	0.00	0.00	-
基金赎回款	-1,736,513.04	-132,386.13	-1,868,899.17
本期已分配利润	0.00	-	0.00
本期末	505,664,821.71	38,764,842.68	544,429,664.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	27,742.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

结算备付金利息收入	405,269.74
其他	1,003.32
合计	434,015.87

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,805,370.55
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	13,805,370.55

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,304,164,360.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,262,531,563.85
减：应收利息总额	27,827,426.33
买卖债券差价收入	13,805,370.55

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	29,912,927.80
减：卖出资产支持证券成本总额	29,246,800.00
减：应收利息总额	572,275.75
资产支持证券投资收益	93,852.05

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1.交易性金融资产	1,002,683.15
——股票投资	-
——债券投资	1,002,683.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,002,683.15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	172.02
合计	172.02

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	4,429.05
银行间市场交易费用	6,125.00
合计	10,554.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	47,108.87
信息披露费	58,214.16
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,923.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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	143,899,545.34	24.03%	510,814,627.57	31.69%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

称	2019年01月01日至2019年06月30日		2018年01月01日至2018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	11,501,236,000.00	21.17%	3,622,800,000.00	14.69%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,057,642.15	4,739,900.11
其中：支付销售机构的客户维护费	25,205.63	33,339.49

注：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×0.60%÷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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,264,410.53	1,184,975.09

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0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷当年天数

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金

6.4.10.4.2 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

本报告期期末及上年度可比期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	555,389.06	27,742.81	17,827,385.33	62,008.29

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上半年度末均未持有中国邮政储蓄银行发行的同业存单。

6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019-06-20	2019-07-08	未上市	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币497,580,000.00元，分别于2019年7月2日、2019年7月8日、2019年7月12日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，属证券投资基金中的中低风险收益品种，其长期平均风险和收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。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，添利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；添利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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。在严格控制风险的基础上，为投资者谋求稳健的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责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提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。 本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	30,288,000.00	60,501,000.00
A-1以下	-	-
未评级	40,212,000.00	100,352,000.00
合计	70,500,000.00	160,853,000.00

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为期限在一年以内未有三方评级的超短期融资债券。3.债券投资以净价列示。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	132,538,000.00	146,000,000.00
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	132,538,000.00	146,000,000.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.债券投资以净价列示。3. A-1为AAA，A-1以下为AAA以下。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	1,033,637,848.70	1,321,231,674.20
AAA以下	725,151,936.30	961,111,832.50
未评级	108,978,000.00	61,869,000.00
合计	1,867,767,785.00	2,344,212,506.70

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的政策性金融债。3.债券投资以净价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	6,784,800.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	-	6,784,800.00

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.债券投资以净价列示。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。 针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。 针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同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%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。 于2019年06月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金流动性情况良好，持有的资产主要为银行存款及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款，固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种，均能及时以合理的价格及时变现以满足流动性的需求。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注6.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

其他有重大流动性风险的投资品种。综合来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。 本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。 本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	555,389.06	-	-	-	555,389.06
结算备付金	43,244,189.27	-	-	-	43,244,189.27
存出保证金	92,554.26	-	-	-	92,554.26
交易性金融资产	1,340,836,217.70	656,546,582.50	73,422,984.80	-	2,070,805,785.00
买入返售金融资产	49,960,314.94	-	-	-	49,960,314.94
应收证券清算款	-	-	-	10,276,242.10	10,276,242.10
应收利息	-	-	-	47,270,164.23	47,270,164.23

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

资产总计	1,434,688,665.23	656,546,582.50	73,422,984.80	57,546,406.33	2,222,204,638.86
负债					
卖出回购金融资产款	497,580,000.00	-	-	-	497,580,000.00
应付证券清算款	-	-	-	9,293,538.88	9,293,538.88
应付管理人报酬	-	-	-	842,784.75	842,784.75
应付托管费	-	-	-	210,696.22	210,696.22
应付交易费用	-	-	-	2,659.69	2,659.69
应交税费	-	-	-	1,389,973.54	1,389,973.54
应付利息	-	-	-	34,120.14	34,120.14
其他负债	-	-	-	185,323.03	185,323.03
负债总计	497,580,000.00	-	-	11,959,096.25	509,539,096.25
利率敏感度缺口	937,108,665.23	656,546,582.50	73,422,984.80	45,587,310.08	1,712,665,542.61
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	261,177.49	-	-	-	261,177.49
结算备付金	51,014,788.95	-	-	-	51,014,788.95
存出保证金	153,503.54	-	-	-	153,503.54
交易性	1,732,576,301.90	907,164,094.60	18,109,910.20	-	2,657,850,306.70

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金融资产					
应收证券清算款	-	-	-	2,443,203.99	2,443,203.99
应收利息	-	-	-	42,157,850.62	42,157,850.62
资产总计	1,784,005,771.88	907,164,094.60	18,109,910.20	44,601,054.61	2,753,880,831.29
负债					
卖出回购金融资产款	1,077,091,000.00	-	-	-	1,077,091,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,354,319.51	2,354,319.51
应付管理人报酬	-	-	-	850,313.69	850,313.69
应付托管费	-	-	-	212,578.41	212,578.41
应付交易费用	-	-	-	18,154.11	18,154.11
应交税费	-	-	-	1,413,503.03	1,413,503.03
应付利息	-	-	-	1,191,169.46	1,191,169.46
其他负债	-	-	-	335,000.00	335,000.00
负债总计	1,077,091,000.00	-	-	6,375,038.21	1,083,466,038.21
利率敏感度缺口	706,914,771.88	907,164,094.60	18,109,910.20	38,226,016.40	1,670,414,793.08

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	利率下降25BP	4,759,495.30	6,979,255.16
	利率上升25BP	-4,693,662.67	-6,928,256.98

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。 本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2019年06月30日,本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%(2018年12月31日：0.00%),因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018年12月31日:同)。

6.4.14 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

1.1不以公允价值计量的金融工具

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、买入反售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

1.2以公允价值计量的金融工具

1.2.1各层次金融工具公允价值

于2019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一层次的余额为人民币21,331,096.60元，属于第二层次的余额为人民币1,916,936,688.40元，属于第三层次的余额为人民币132,538,000.00元（2018年12月31日：属于第一层次的余额为人民币22,039,075.20元，属于第二层次的余额为人民币2,483,026,431.50元，属于第三层次的余额为人民币152,784,800.00元）。

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可转换债券，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股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

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第三层次公允价值期末余额为人民币132,538,000.00元，期初余额为人民币152,784,800.00元，本期减少人民币20,246,800.00元。

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。

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。

4.财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月23日经本基金的基金管理人批准。

§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	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,070,805,785.00	93.19
	其中：债券	1,938,267,785.00	87.22
	资产支持证券	132,538,000.00	5.96
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	49,960,314.94	2.25
	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	43,799,578.33	1.97
8	其他各项资产	57,638,960.59	2.59
9	合计	2,222,204,638.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

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所有股票投资明细

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。

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	108,978,000.00	6.36
	其中：政策性金融债	108,978,000.00	6.36
4	企业债券	1,362,398,688.40	79.55
5	企业短期融资券	70,500,000.00	4.12
6	中期票据	374,754,000.00	21.88
7	可转债(可交换债)	21,637,096.60	1.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,938,267,785.00	113.17

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	101655022	16沙钢MTN002	700,000	70,441,000.00	4.11
2	122333	14嘉宝债	661,010	66,484,385.80	3.88
3	122323	14凤凰债	640,000	64,268,800.00	3.75
4	143670	18中煤03	600,000	61,752,000.00	3.61
5	143671	18恒安01	600,000	59,910,000.00	3.50

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	139302	链融01A1	500,000	50,000,000.00	2.92
2	139284	联易融08	360,000	36,000,000.00	2.10

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3	139303	万科30A1	120,000	12,000,000.00	0.70
4	156441	金保01优	100,000	10,000,000.00	0.58
5	156676	金保02优	90,000	9,000,000.00	0.53
6	139285	绿城6优1	80,000	8,000,000.00	0.47
7	156199	PR航租A1	200,000	7,538,000.00	0.44

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 报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	92,554.26
2	应收证券清算款	10,276,242.10
3	应收股利	-
4	应收利息	47,270,164.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,638,960.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110041	蒙电转债	3,359,205.00	0.20
2	110042	航电转债	2,330,828.80	0.14
3	128047	光电转债	971,208.00	0.06
4	110045	海澜转债	189,619.20	0.01
5	110031	航信转债	107,160.00	0.01
6	128016	雨虹转债	15,918.00	-

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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

份额级别	持有人户数(户)	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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧纯债添利分级债券A	2,045	8,778.97	0.00	0.00%	17,952,996.88	100.00%
中欧纯债添利分级债券B	24	64,470,343.50	1,547,088,483.81	99.99%	199,760.28	0.01%
合计	2,069	756,520.66	1,547,088,483.81	98.84%	18,152,757.16	1.16%

8.2 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	中欧纯债添利分级债券A	0.00	0.00%
	中欧纯债添利分级债券B	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	中欧纯债添利分级债券A	0
	中欧纯债添利分级债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧纯债添利分级债券A	0
	中欧纯债添利分级债券B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧纯债添利分级债券A	中欧纯债添利分级债券B
基金合同生效日(2013年11月28日)基金份额总额	942,266,844.64	405,405,950.00
本报告期期初基金份额总额	21,348,050.82	1,547,288,244.09
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,756,976.41	-
本报告期基金拆分变动份额	361,922.47	-
本报告期期末基金份额总额	17,952,996.88	1,547,288,244.09

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 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。

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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国都证券	143,899,545.34	24.03%	11,501,236,000.00	21.17%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	454,988,890.29	75.97%	42,815,400,000.00	78.83%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2018年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证监会指定媒介	2019-01-01
2	中欧纯债添利分级债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号）	中国证监会指定媒介	2019-01-11
3	中欧纯债添利分级债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1号）	中国证监会指定媒介	2019-01-11

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4	中欧基金管理有限公司中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2019-01-18
5	中欧基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证监会指定媒介	2019-01-18
6	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2019-01-22
7	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报	中国证监会指定媒介	2019-03-28
8	中欧基金管理有限公司旗下基金2018年基金年报摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-28
9	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	中国证监会指定媒介	2019-04-12
10	中欧基金管理有限公司旗下基金2019年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2019-04-18
11	中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之中欧添A份额开放赎回业务公告	中国证监会指定媒介	2019-05-29
12	中欧基金管理有限公司关于中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之添利A份额折算方案的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-29
13	中欧基金管理有限公司关于中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之中欧添A份额年约定收益率的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-01
14	中欧基金管理有限公司关于中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之添利A份额折算和赎回结果的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-04

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	499,999,000.00	0.00	0.00	499,999,000.00	31.94%
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。							

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

二〇一九年八月二十六日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn