

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:2014年8月27日

重要提示

基金管理人的董事、监事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。本基金半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并书面发表意见。

基金托管人的内部监督与稽核部门已经对本基金半年度报告进行复核，认为报告的内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金半年度报告摘要自得自半年度报告正式披露之日起供投资者查阅，及登载于基金管理人网站。

本报告公告费率为零。

本报告出自基金管理人。

5.1 基金基本情况

基金名称 中欧纯债分级债券型证券投资基金

基金简称 中欧纯债

基金代码 660016

契约型，本基金合同生效后3年内(含3年)为基金分级运作期，纯债A自基金合同期满日每满一年开放一次申购赎回，纯债B封闭运作并在深证证券交易所上市交易。

基金运作方式 基金份额按运作周期，基金份额不再赎回，并按照基金合同约定定期转换为中欧纯债债券型证券投资资金(LOF)。

基金合同生效日 2013年1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

报告期末基金资产总额 483,038,912.48份

报告期末基金份额总额 不定期

下属分级基金的基金简称 纯债A 纯债B

下属分级基金的交易代码 166017 150119

报告期末下属分级基金的份额总额 182,431,388.74份 300,607,523.74份

5.2 基金简介

基金名称 中欧纯债分级债券型证券投资基金

基金简称 中欧纯债

基金代码 660016

契约型，本基金合同生效后3年内(含3年)为基金分级运作期，纯债A自基金合同期满日每满一年开放一次申购赎回，纯债B封闭运作并在深证证券交易所上市交易。

基金运作方式 基金份额按运作周期，基金份额不再赎回，并按照基金合同约定定期转换为中欧纯债债券型证券投资资金(LOF)。

基金合同生效日 2013年1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

报告期末基金资产总额 483,038,912.48份

报告期末基金份额总额 不定期

下属分级基金的基金简称 纯债A 纯债B

下属分级基金的交易代码 166017 150119

报告期末下属分级基金的份额总额 182,431,388.74份 300,607,523.74份

5.3 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 利润数据和指标 报告期(2014年1月1日~2014年6月30日)

本期已实现收益 22,992,814.75

本期利润 40,560,402.95

加权平均基金份额本期利润 0.0782

本期基金份额净值增长率 8.16%

3.1.2 利润数据和指标 报告期(2014年1月1日~2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.1104

期末基金资产净值 525,727,881.91

期末基金份额净值 1.088

5.4 管理人报告

5.4.1 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，成为意大利意联银行的合作公司，公司证券有责任公司(北京)有限公司、万盛基业投资有限公司、黎明先生、刘峰平先生、周蔚华先生、许洋先生和陈文俊先生，注册资本为1.29亿元人民币，截至2014年6月30日，基金管理人共管理16只开放式基金，即中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小板股票型证券投资基金(LOF)、中欧中债3-5年期指数增强型债券投资基金(LOF)、中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、中欧分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金、中欧价值智选回报混合型证券投资基金、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金和中欧纯债分级债券型证券投资基金。

5.4.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

姓名 职务 从事业务经历

黄雷光 基金经理，同时担任中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理

2013年1月31日 8年

金融学专业毕业，历任汇丰晋信基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理，2009年10月加入中欧基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员、基金经理助理，2010年6月担任中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理，2012年1月担任中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理，2013年1月担任中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理。

5.4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.4 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.5 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.6 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.7 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.8 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.9 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.10 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.11 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.12 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.13 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.14 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.15 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.16 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.17 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.18 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.19 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.20 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.21 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.22 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.23 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.24 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.25 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.26 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.27 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.28 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.29 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。

5.4.30 管理人对报告期内公平交易制度执行情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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、致力于市场、诚信的原则管理运用基金资产，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理人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。