

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

2014 第四季度报告



注:本基金合同生效日为2013年11月28日,建仓期为2013年11月28日至2014年5月27日,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

3.2 报告期末基金份额总额 463,970,624.54份

单位:人民币元

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判断,采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益利差策略、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保值增值。

业绩比较基准 中证综合债指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%

风险收益特征 本基金是债券型基金,属于具有中低风险预期、预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

基金管理人 中欧基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 中欧纯债添利分级债券A

下属分级基金的场内简称 中欧债A

下属分级基金的交易代码 166022

报告期末下属分级基金的份额总额 238,564,674.54份

405,405,950.00份

下属分级基金的基金风险收益特征 本基金是债券型基金,属于具有中低风险预期、预期收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称 报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)

1.本期已实现收益 20,289,268.88

2.本期利润 9,389,121.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0118

4.期末基金资产净值 710,267,086.71

5.期末基金份额净值 1.103

注:1.本期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,余额为本期已实现收益。2.本期利润指基金利润减去负债利息后的金额,并包括持有人认购或申购基金时产生的利息收入,赎回或卖出基金时产生的利息支出,以及在申购或赎回基金份额过程中产生的利息收入或利息支出。3.基金净值是指基金资产净值除以基金份额总数,即每份基金的净资产值。4.期末可供分配利润指期末可供分配的未向基金份额持有人进行分配的利润,不包括基金已实现收益扣减公允价值变动后的部分。5.期末可供分配利润的计算公式为:期末可供分配利润=期末可供分配基金份额总额-期末未分配利润-期末未弥补亏损。

3.1.1 本期利润实现情况:报告期利息收入 20,289,268.88元,投资收益 -9,389,121.06元,公允价值变动收益 -0.0118元,手续费 -1.03元。

3.1.2 本期利润构成情况:利息收入 20,289,268.88元,投资收益 -9,389,121.06元,公允价值变动收益 -0.0118元,手续费 -1.03元。

3.1.3 本期利润与本期已实现收益的差异:报告期利息收入 20,289,268.88元,投资收益 -9,389,121.06元,公允价值变动收益 -0.0118元,手续费 -1.03元。

3.1.4 本期已实现收益扣除非经常性损益项目后的净利润:报告期利息收入 20,289,268.88元,投资收益 -9,389,121.06元,公允价值变动收益 -0.0118元,手续费 -1.03元。

3.1.5 其他重要事项:无。

3.2 期末可供分配利润:期末可供分配利润指基金利润减去负债利息后的余额,即每份基金的净资产值。4.4 报告期内基金资产净值表现

4.5 报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.6 报告期内基金利润分配情况

4.7 报告期末基金资产净值

4.8 报告期末可供分配基金份额总额

4.9 报告期末基金资产净值

4.10 报告期末基金份额净值

4.11 报告期末可供分配基金份额总额

4.12 报告期末基金资产净值

4.13 报告期末基金份额净值

4.14 报告期末可供分配基金份额总额

4.15 报告期末基金资产净值

4.16 报告期末基金份额净值

4.17 报告期末可供分配基金份额总额

4.18 报告期末基金资产净值

4.19 报告期末基金份额净值

4.20 报告期末可供分配基金份额总额

4.21 报告期末基金资产净值

4.22 报告期末基金份额净值

4.23 报告期末可供分配基金份额总额

4.24 报告期末基金资产净值

4.25 报告期末基金份额净值

4.26 报告期末可供分配基金份额总额

4.27 报告期末基金资产净值

4.28 报告期末基金份额净值

4.29 报告期末可供分配基金份额总额

4.30 报告期末基金资产净值

4.31 报告期末基金份额净值

4.32 报告期末可供分配基金份额总额

4.33 报告期末基金资产净值

4.34 报告期末基金份额净值

4.35 报告期末可供分配基金份额总额

4.36 报告期末基金资产净值

4.37 报告期末基金份额净值

4.38 报告期末可供分配基金份额总额

4.39 报告期末基金资产净值

4.40 报告期末基金份额净值

4.41 报告期末可供分配基金份额总额

4.42 报告期末基金资产净值

4.43 报告期末基金份额净值

4.44 报告期末可供分配基金份额总额

4.45 报告期末基金资产净值

4.46 报告期末基金份额净值

4.47 报告期末可供分配基金份额总额

4.48 报告期末基金资产净值

4.49 报告期末基金份额净值

4.50 报告期末可供分配基金份额总额

4.51 报告期末基金资产净值

4.52 报告期末基金份额净值

4.53 报告期末可供分配基金份额总额

4.54 报告期末基金资产净值

4.55 报告期末基金份额净值

4.56 报告期末可供分配基金份额总额

4.57 报告期末基金资产净值

4.58 报告期末基金份额净值

4.59 报告期末可供分配基金份额总额

4.60 报告期末基金资产净值

4.61 报告期末基金份额净值

4.62 报告期末可供分配基金份额总额

4.63 报告期末基金资产净值

4.64 报告期末基金份额净值

4.65 报告期末可供分配基金份额总额

4.66 报告期末基金资产净值

4.67 报告期末基金份额净值

4.68 报告期末可供分配基金份额总额

4.69 报告期末基金资产净值

4.70 报告期末基金份额净值

4.71 报告期末可供分配基金份额总额

4.72 报告期末基金资产净值

4.73 报告期末基金份额净值

4.74 报告期末可供分配基金份额总额

4.75 报告期末基金资产净值

4.76 报告期末基金份额净值

4.77 报告期末可供分配基金份额总额

4.78 报告期末基金资产净值

4.79 报告期末基金份额净值

4.80 报告期末可供分配基金份额总额

4.81 报告期末基金资产净值

4.82 报告期末基金份额净值

4.83 报告期末可供分配基金份额总额

4.84 报告期末基金资产净值

4.85 报告期末基金份额净值

4.86 报告期末可供分配基金份额总额

4.87 报告期末基金资产净值

4.88 报告期末基金份额净值

4.89 报告期末可供分配基金份额总额

4.90 报告期末基金资产净值

4.91 报告期末基金份额净值

4.92 报告期末可供分配基金份额总额

4.93 报告期末基金资产净值

4.94 报告期末基金份额净值

4.95 报告期末可供分配基金份额总额

4.96 报告期末基金资产净值

4.97 报告期末基金份额净值

4.98 报告期末可供分配基金份额总额

4.99 报告期末基金资产净值

4.10 报告期末基金份额净值

4.11 报告期末可供分配基金份额总额

4.12 报告期末基金资产净值

4.13 报告期末基金份额净值

4.14 报告期末可供分配基金份额总额

4.15 报告期末基金资产净值

4.16 报告期末基金份额净值

4.17 报告期末可供分配基金份额总额

4.18 报告期末基金资产净值

4.19 报告期末基金份额净值

4.20 报告期末可供分配基金份额总额

4.21 报告期末基金资产净值

4.22 报告期末基金份额净值

4.23 报告期末可供分配基金份额总额

4.24 报告期末基金资产净值

4.25 报告期末基金份额净值

4.26 报告期末可供分配基金份额总额

4.27 报告期末基金资产净值

4.28 报告期末基金份额净值

4.29 报告期末可供分配基金份额总额

4.30 报告期末基金资产净值

4.31 报告期末基金份额净值

4.32 报告期末可供分配基金份额总额

4.33 报告期末基金资产净值

4.34 报告期末基金份额净值

4.35 报告期末可供分配基金份额总额

4.36 报告期末基金资产净值

4.37 报告期末基金份额净值

4.38 报告期末可供分配基金份额总额

4.39 报告期末基金资产净值

4.40 报告期末基金份额净值

4.41 报告期末可供分配基金份额总额

4.42 报告期末基金资产净值

4.43 报告期末基金份额净值

4.44 报告期末可供分配基金份额总额

4.45 报告期末基金资产净值

4.46 报告期末基金份额净值

4.47 报告期末可供分配基金份额总额

4.48 报告期末基金资产净值

4.49 报告期末基金份额净值

4.50 报告期末可供分配基金份额总额

4.51 报告期末基金资产净值