

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

2015年6月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送达日期:2015年7月20日

1.1 相关提示

基金份额持有人在办理基金份额申购、赎回时不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和基金托管人根据法律法规规定或基金合同约定，于2015年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人数等信息，保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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财产，但不保证基金一定盈利。

基金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。

本基金在封闭期内不计提管理费。

本基金自2015年4月1日起至6月30日止。

4.2 基金产品概况

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 约定定期开放的货币市场基金

基金合同生效日 2013年1月28日

报告期末基金份额总额 510,547,839.72份

投资目标 在严格控制风险的基础上，为投资者寻求稳健的投资收益。

投资策略 本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用环境、风险状况、证券市场的动态分析和预测，采取积极的资产配置策略，通过投资组合的调整，实现基金资产的稳定增值。

业绩比较基准 中证国债指数(收益率)

风险收益特征 本基金是债券型基金，属于较低风险品种，预期风险和预期收益水平低于股票基金。

4.3 主要财务指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 11,358,269.13

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金份额净值 598,406,174.68

4.期末基金资产净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.3 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 11,358,269.13

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金份额净值 598,406,174.68

4.期末基金资产净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.4 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.5 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.6 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.7 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.8 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.9 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.10 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.11 其他指标

报告期(2015年4月1日—2015年6月30日) 单位:人民币元

1.本期利润 17,538,464.57

2.本期平均基金份额利润率 0.0294

3.期末基金资产净值 598,406,174.68

4.期末基金份额净值 1,172

5.期末基金份额持有人数 不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入份额后实际收益水平要低于所列示数据。

6.报告期末下属分级基金的份额总额 105,411,839.72份

7.报告期末下属分级基金的份额变动情况 由于申购或赎回导致的份额变动

8.报告期末下属分级基金的风险收益特征 本基金主要投资于债券，风险较低，预期收益和预期风险水平低于股票基金。

9.报告期末基金资产净值 799,253,357.25

10.报告期末基金资产净值占基金资产净值的比例(%) 100.00

11.报告期末基金份额净值 3.12 其他指标

报告期(2015年4月1日—20