

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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

报告送出日期:2016年1月22日

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人保证复核基金经理的报告，并对报告的内容真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金合同生效后，基金管理人和基金托管人不承担对投资者的损失赔偿责任。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本基金合同生效之日起2015年1月21日起。

基金管理人和基金托管人对本基金的持续监督。

§ 2 基金产品概况

中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

场内简称 中欧纯债

基金主代码 166002

基金运作方式 契约型开放式基金

基金合同生效日 2013年11月21日

报告期结束日 2015年12月31日

基金资产净值 475,699,210,679.09

投资目标 在严格控制风险的基础上，追求绝对收益，寻求稳定的资本增值。

本基金通过投资于国债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券、信用债、短期融资券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类金融产品，以及股票、权证等资产，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的稳定增值。

本基金不进行股票投资。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。

本基金合同生效之日起2015年1月21日起。

基金管理人和基金托管人对本基金的持续监督。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1本期已实现收益 11,206,616.02

2期初基金份额总额 11,842,056.63

3加权平均基金份额本期利润 0.0238

4期末基金份额净值 568,274,527.61

5期末总资产净值 1,220.00

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.所列基金业绩指标不包括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将低于所列数据。

3.主要财务指标

4.1 资产负债情况

5.1 报告期末未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

5.2 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.6 报告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

5.7 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

5.8 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权证投资明细

5.9 报告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指期货投资组合

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资组合

5.11 报告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期权投资组合

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权投资组合

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权投资组合

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权投资组合

5.15 报告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指期权投资组合

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权投资组合

5.17 报告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互换投资组合

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换投资组合

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换投资组合

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换投资组合

5.21 报告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指互换投资组合

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换投资组合

5.23 报告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期权组合

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.27 报告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指期权组合

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.29 报告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互换组合

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.33 报告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指互换组合

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.35 报告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期权组合

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.39 报告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指期权组合

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.41 报告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互换组合

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.45 报告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指互换组合

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.47 报告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期权组合

5.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.51 报告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指期权组合

5.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.53 报告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互换组合

5.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.57 报告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指互换组合

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.59 报告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期权组合

5.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.63 报告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指期权组合

5.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.65 报告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互换组合

5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.69 报告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指互换组合

5.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.71 报告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期权组合

5.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.75 报告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指期权组合

5.76 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.77 报告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互换组合

5.78 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.79 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.80 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.81 报告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指互换组合

5.82 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.83 报告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期权组合

5.84 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.85 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合

5.86 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证期权组合

5.87 报告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指期权组合

5.88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期权组合

5.89 报告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互换组合

5.90 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券互换组合

5.91 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属互换组合

5.92 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证互换组合

5.93 报告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指互换组合

5.94 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债互换组合

5.95 报告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期权组合

5.96 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券期权组合

5.97 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属期权组合