

中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)

[2016]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:中银国际银行股份有限公司

报告送出日期:2017年01月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人对本基金的年度报告书、年度报告摘要和年度报告复核意见等文件已进行核查，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人和基金托管人承诺不从事内幕交易、不公平交易及其他法律禁止的行为，但不保证基金一定盈利。

基金管理人和基金托管人承诺根据相关法律法规的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的职责和义务，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧纯债债券(LOF)
场内简称	中欧纯债
基金主代码	160016
基金运作方式	契约型、开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年4月30日
报告期末基金份额总额	361,921,474.96份
投资目标	在严格控制风险的前提下实现高确定性的收益。力争为投资者带来稳健的回报。
投资策略	本基金主要通过对宏观经济、利率水平、信用环境、证券市场走势等方面的研究，结合对利率期限结构、收益率曲线形状、信用利差、券种选择、久期配置、杠杆运用、资产配置、组合管理等多方面的综合分析，通过积极的资产配置，把握不同券种的相对价值，从而在严格控制风险的前提下实现高确定性的收益。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于具有低风险收益特征的品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，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	中银国际银行股份有限公司
基金类别	中国证监会核准的债券型证券投资基金
下属分级基金的基金简称	中欧纯债债券(LOF)A
下属分级基金的基金代码	中欧纯债债券(LOF)A
下属分级基金的交易代码	160016
报告期末下属分级基金的份额总额	39,746,803.99份
报告期末下属分级基金的净值总额	312,176,024.76份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月01日-2016年12月31日)
中欧纯债债券(LOF)C	中欧纯债债券(LOF)A
-1,906,994.42	-31,073,893.05
2.05%(-0.05%)	-3,391,191.62/-53,090,453.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0290/-0.0400
4.期末基金资产净值	51,163,975.21/402,648,993.01
5.期末基金份额净值	1.297/1.200

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

费用后的余额,本期利润为本期已实现收益减去本期公允价值变动收益。

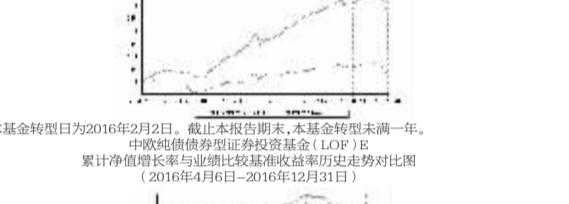
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.基金净值表现

3.2.1.本基金报告期内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

中欧纯债债券(LOF)C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图(2013年1月31日至2016年12月31日)



注:本基金转型日为2016年2月2日。截至本报告期末,本基金转型未满一年。

中欧纯债债券型证券投资基金(LOF)C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图(2016年4月6日至2016年12月31日)



注:2016年4月6日本基金新增C类份额,图表日期为2016年4月6日至2016年12月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘德元	基金经理	2016年02月06日	11年	41,161.64	历任大公国际资信评估有限公司技术部职员、助理研究员、项目经理、高级分析师、项目经理、高级分析师、项目经理、高级分析师、基金经理。2013年4月加入中欧基金管理有限公司,曾任基金经理助理、基金经理。

5.1.1 本基金的债券型基金

5.1.1.2 其他资产构成

5.1.2 报告期末持有的债券投资

5.1.2.1 报告期末持有的债券投资明细

5.1.2.2 报告期末持有的债券投资成本

5.1.2.3 报告期末债券投资的公允价值

5.1.2.4 报告期末持有债券投资的减值准备

5.1.2.5 报告期末持有的债券投资的公允价值

5.1.2.6 报告期末持有的债券投资的账面价值

5.1.2.7 报告期末持有的债券投资的账面余额

5.1.2.8 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.9 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.10 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.11 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.12 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.13 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.14 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.15 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.16 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.17 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.18 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.19 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.20 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.21 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.22 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.23 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.24 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.25 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.26 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.27 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.28 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.29 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.30 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.31 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.32 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.33 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.34 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.35 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.36 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.37 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.38 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.39 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.40 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.41 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.42 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.43 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.44 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.45 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.46 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.47 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.48 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.49 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.50 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.51 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.52 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.53 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.54 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.55 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.56 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.57 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.58 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.59 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.60 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.61 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.62 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.63 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.64 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.65 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.66 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.67 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.68 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.69 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.70 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.71 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.72 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.73 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.74 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.75 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.76 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.77 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.78 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.79 报告期末持有的债券投资的公允价值变动

5.1.2.80 报告期末持有的债券投资的公