

中欧纯债分级债券型证券投资基金 更新招募说明书（摘要）

（2013 年第 1 号）

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

二〇一三年九月

重要提示

本基金经 2013 年 1 月 6 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧纯债分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]12 号文）核准，进行募集。本基金合同于 2013 年 1 月 31 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%。从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，基金分级运作期内，纯债 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普

通的债券型基金份额；纯债 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

纯债 A 场外认购的单笔最低认购金额为人民币 1,000 元；纯债 B 场外认购的单笔最低认购金额为人民币 50,000 元，纯债 B 场内认购的单笔最低认购份额为 50,000 份。

纯债 A 与纯债 B 两级基金的基金份额的初始配比原则上为 7:3。本基金基金合同生效之日起 3 年内，纯债 A 将每满半年开放一次，接受基金投资者的集中申购与赎回，纯债 B 封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。纯债 A 的每次开放日，基金管理人将对纯债 A 进行基金份额折算，纯债 A 的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的纯债 A 份额数按折算比例相应增减。纯债 A 的基金份额折算基准日与开放日为同一天。

在基金分级运作期内，纯债 A 约定收益率为一年期银行定期存款利率加上 1.25%。基金管理人并不承诺或保证每个开放日纯债 A 份额持有人的约定应得收益，即如在分级运作期内本基金资产出现极端损失情况下，纯债 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。本基金净资产优先分配予纯债 A 的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予纯债 B。

本基金分级运作期届满，本基金的两级基金份额将按约定的收益的分配规则进行净值计算，并以各自的份额净值为基准转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）的份额，并办理基金的申购、赎回业务。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

投资有风险，投资者在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据本基金的基金合同和《中欧纯债分级债券型证券投资基金更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有

人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2013 年 7 月 30 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

一、基金管理人	6
二、基金托管人	10
三、相关服务机构	13
四、基金的名称	22
五、基金的类型	22
六、基金的投资目标	23
七、基金的投资范围	23
八、基金的投资策略	23
九、基金的业绩比较基准	26
十、基金的风险收益特征	26
十一、基金投资组合报告	26
十二、基金的业绩	29
十三、基金的费用与税收	30
十四、对招募说明书更新部分的说明	33

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
3. 办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
4. 法定代表人：唐步
5. 组织形式：有限责任公司
6. 成立日期：2006 年 7 月 19 日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：吉亦超
13. 客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.88 亿元人民币
15. 股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；

国都证券有限责任公司出资 5,640 万元人民币，占公司注册资本的 30%；

北京百骏投资有限公司出资 5,640 万元人民币，占公司注册资本的 30%；

万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%；

上述四个股东共出资 18,800 万元人民币。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。21 年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

Marco D'Este 先生，中欧基金管理有限公司副董事长。意联银行 (UBI Banca) 机构银行业务部总监，历任布雷西亚农业信贷银行（简称“CAB”）国际部总监，联合信贷银行 (Unicredit) 米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，联合信贷银行东京分行资金部经理，并曾在Credito Italiano(意大利信贷银行) 圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

Guido Masella 先生，中欧基金管理有限公司董事，伦敦 Arkadian 咨询公司常务董事，意大利籍。历任意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

陈金占先生，中欧基金管理有限公司董事，中国籍。历任国都证券有限责任公司副总经理，中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

Barry Livett 先生，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司 (International Securities Consultancy Ltd.) 咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

刘桓先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

肖微先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

（注：经公司股东会会议决议通过，2013年8月6日起公司董事会成员发生变更，具体的变更情况请参阅公司于2013年8月8日披露的《中欧基金管理有限公司关于公司董事会成员变更的公告》。上述事项已按相关法律法规向中国证监会和上海证监局报告。）

2. 基金管理人监事会成员

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事

务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

刘中先生，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

刘玫女士，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商投资促进中心项目经理、加拿大 DESROSIERS—LOMBARDI—DOLBEC 注册会计师事务所审计师、美国 GENERAL EASTERN TRADING 公司财务经理。

（注：经公司股东会会议决议通过，2013年8月6日起公司监事会成员发生变更，具体调整如下：监事会成员由三人调整为四人，分别为唐步先生、廖海先生、黎忆海女士和黄峰先生。其中，唐步先生任公司监事会主席，黎忆海女士和黄峰先生为职工监事。）

3. 基金管理人高级管理人员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。（注：经公司董事会会议决议通过，唐步先生因任期届满原因自2013年8月6日起不再担任公司董事及董事长职务。自2013年8月6日起至公司新任董事长到任止，由公司总经理刘建平先生代为履行公司董事长职务。上述事项已按相关法律法规向中国证监会和上海证监局报告，并于2013年8月8日予以公告。）

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，17年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

黄桦先生，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，22年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

周蔚文先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2011年5月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自2011年

8月起至今）、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自2012年3月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，14年以上证券及基金从业经验。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自2006年11月起至2011年1月），中欧基金管理有限公司研究部总监。

朱彦先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学经济学学士，23年以上信托、证券及基金从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工，海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管，海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理，北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理，国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理、上海长阳路证券营业部总经理，中欧基金管理有限公司督察长。

4. 本基金基金经理

袁争光先生，中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理，中国籍。上海财经大学金融学专业硕士，7年以上证券及基金从业经验。历任上海金信证券研究有限责任公司研究员，中原证券股份有限公司证券研究所研究员，光大保德信基金管理有限公司研究员，中欧基金管理有限公司研究员、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧货币市场基金基金经理助理兼高级研究员。现任中欧基金管理有限公司中欧纯债分级债券型证券投资基金基金经理（自2013年1月31日起至今）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理（自2013年4月11日起至今）。

5. 基金管理人投资决策委员会成员

基金管理人投资决策委员会的成员为：公司副总经理兼投资总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、总经理助理兼权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、研究部副总监杨坤女士、专户理财部副总监沈洋先生、基金经理王海先生。其中副总经理兼投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1. 基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

法定代表人：李国华

成立时间：2007 年 3 月 6 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：450 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复[2006]484 号

基金托管资格批文及文号：证监许可[2009]673 号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于 2007 年 3 月 20 日）于 2012 年 1 月 21 日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2. 主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设市场处、内控稽核处、运营等处室。现有员工 20 人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3. 托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第 16 家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2013 年 6 月 30 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 18 只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利分级债券型证券投资基金（164208）、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金（162105）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）。托管的特定客户资产管理计划共 17 只，其中 10 只已到期，包括南方-灵活配置之出口复苏 1 号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信-邮储银行-灵活配置 1 号客户资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置 1 号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置 2 号资产管理计划、南方灵活配置 2 号资产管理计划、鹏华基金鹏诚理财高息债分级 2 号资产管理计划、华安基金-增益分级债券型特定多个客户资产管理计划、农银汇理-邮储-国投信托雨燕 1 号悦达债券 1 号资产管理计划等。至今中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管

理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司定向资产管理计划、保险资金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 3,723.16 亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2. 内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制组，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

3. 内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 场内发售机构

具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

2. 场外发售机构

（1）直销机构：

1) 中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人：王李李

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：www.lcfunds.com

2) 中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址：www.lcfunds.com

（2）代销机构（排名不分先后）

1) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 A 座 6 层

法定代表人：李国华

联系人：文彦娜

传真：010-68858117

客服热线：95580

公司网址：www.psbc.com

2) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：95533

传真：010-66275654

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

3) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408440

客户热线：95559

网址：www.bankcomm.com

5) 杭州银行股份有限公司

住所：杭州庆春路 46 号

办公地址：杭州庆春路 46 号

法定代表人：吴太普

联系人：严俊

客服热线：4008888508

网址：www.hzbank.com.cn

6) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

电话：025-83290979

传真：025-51863323

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

7) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

传真：010-66045527

客服热线：010-66045678

网址：www.txsec.com 、 www.jjm.com.cn

8) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法人代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址： www.guosen.com.cn

9) 国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

客服热线：400-818-8118

网址： www.guodu.com

10) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址： bank.ecitic.com

11) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：4008888108

传真：010-65182261

客服热线：4008888108

网址：www.csc108.com

12) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767880

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

13) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客服热线：95558

网址：www.citics.com

14) 金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

客服热线：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

15) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

16) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

公司网址：www.swsc.com.cn

17) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

办公地址：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

法定代表人：沈强

联系人：周研

电话：0571-86078823

客服热线：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

18) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-4890619

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

19) 东吴证券股份有限公司

住所：苏州市工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服热线：4008601555

公司网址：www.dwzq.com.cn

20) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层、5 层

法定代表人：宋德清

联系人：黄恒

电话：010-58568235

传真：010-58568062

客服热线：010-58568118

网址：www.hrsec.com.cn

21) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

众禄基金销售网：www.zlfund.cn

基金买卖网：www.jjmmw.com

22) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

23) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-58788678

传真：021-58788678-8815

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

24) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998-7019 客服热线：400-1818-188

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

25) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

传真：021-68596916

客服热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

26) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人：王莉

电话：021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：licaikexun.com

27) 北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020088-8802

客服热线：400-888-6661

网址：www.myfp.cn

注：以上场外销售机构未特别注明的，仅代理销售纯债 A 和中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）。

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（三）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法人代表：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：刘颖

经办会计师：单峰 刘颖

四、基金的名称

中欧纯债分级债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险和合理保持流动性的基础上，力争为投资者谋求稳健的投资收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于国内依法发行或上市的债券、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等固定收益类资产。

本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转换债券等，也不参与一级市场的新股、可转换债券申购或增发新股。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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预测，采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、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稳定增值。

（一）信用策略

个券信用风险管理的主要依据为该证券的外、内部评级结果。信用评级包括主体信用评级、债项信用评级和评级展望，评级对象包括除国债、央行票据和政策性金融债之外的其他各类固定收益证券。

在内部评级过程中需要进行包括行业分析、企业分析、财务分析和增信措施在内的综合分析，并运用信用评级方法，结合国内主要信用评级机构的评级结果，

给出内部信用评估结果和建议，并经过讨论后形成信用风险评级报告并审定，经内部审定后最终确定固定收益证券的内部信用评级。同时还将进行信用评级跟踪，及时、准确的修正评级结果；若发现重大信用风险，及时应对。

本基金在信用风险内部评估时，遵循以下原则：审慎评级原则，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，应遵循审慎的原则评估其经营状况和财务风险；定性分析与定量分析相结合的原则，经营风险评估和财务风险评估是信用分析的两大主要内容，前者采用以定性为主、定量为辅的分析方法，后者采取以定量为主、定性为辅的分析方法，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，需综合考虑两方面的因素，综合评定；历史考察和未来预测相统一的原则：债券评级的目的是预测发行主体未来的偿债能力和违约风险，在评级过程中，需要根据其历史经营业绩、竞争优势和劣势、发展规划以及管理层的经营能力，着重考察其未来经营和现金流状况，预测和评价发行主体的营运周期、未来资本运作以及其对未来财务状况的影响。

（二）久期策略

本基金根据中期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

（三）收益率曲线策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化。并针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中（子弹）策略、两端（哑铃）策略和梯形（阶梯）策略等，在短期债券间进行动态调整，从债券的相对价格变化中获利。

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率

水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获得价差收益。

（四）息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于债券的收益率，为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略，以提高投资组合收益水平。

（五）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

（六）流动性策略

本基金还将从市场环境，债券发行人特征和债券特征等方面充分考察固定收益类资产的流动性风险，具体包括个券的发行方式、发行规模、交易规模、交易方式、交易场所、交易成本、交易即时性、信用评级、剩余期限、债券票息、债券复杂性等方面，充分考察固定收益类资产的流动性风险，并确定该个券投资总量的上限。

（七）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：

1. 研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；
2. 运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；
3. 利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；

4. 考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；

5. 综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债综合（全价）指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，基金分级运作期内，纯债 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；纯债 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2013 年第 2 季度报告，所载数据截至 2013 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	1,003,042,412.32	75.15

	其中：债券	1,003,042,412.32	75.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	300,000,771.99	22.48
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	300,000,771.99	22.48
5	银行存款和结算备付金合计	5,151,225.40	0.39
6	其他各项资产	26,542,779.31	1.99
7	合计	1,334,737,189.02	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,003,042,412.32	98.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,003,042,412.32	98.50

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资
----	------	------	-------	---------	------

					产净值比例（%）
1	123495	11 国君债	900,000	90,057,994.52	8.84
2	1280111	12 营口债	500,000	52,970,000.00	5.20
3	1280127	12 扬化工债	500,000	52,425,000.00	5.15
4	1380181	13 遵汇城投债	500,000	50,395,000.00	4.95
5	123008	11 长征债	400,000	41,180,931.51	4.04

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

9、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	266,389.98
2	应收证券清算款	1,343,329.76
3	应收股利	-
4	应收利息	24,933,059.57
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,542,779.31

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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资产，但不保证基金一定盈利。

基金的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。

本基金合同生效日 2013 年 1 月 31 日，基金业绩截止日 2013 年 6 月 30 日。

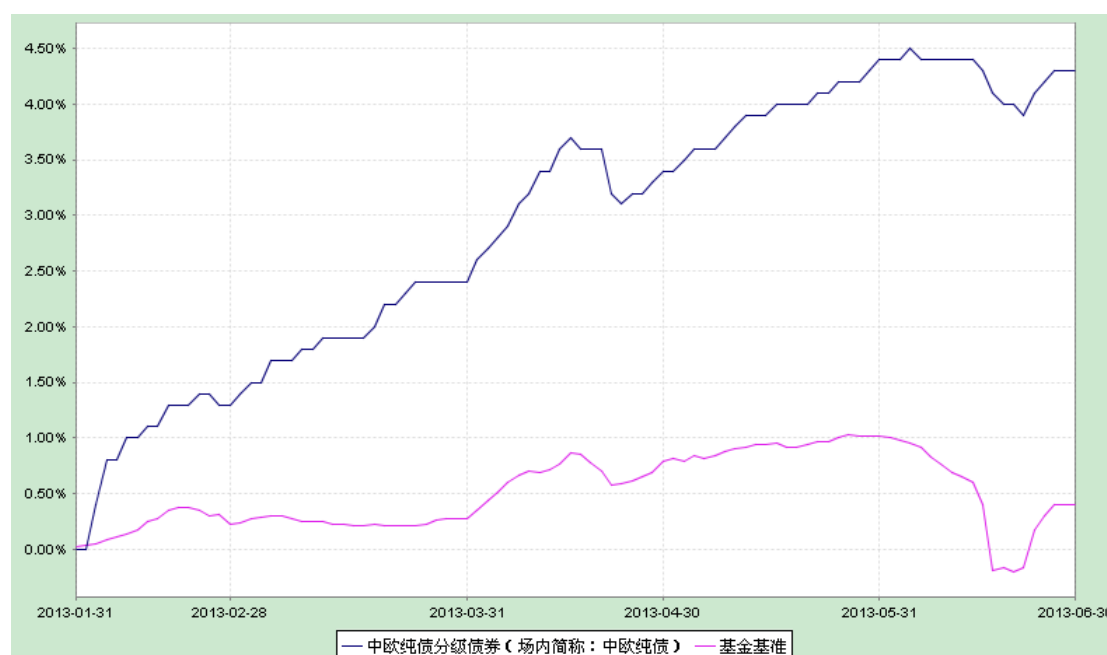
1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013.1.31-2013.6.30	4.30%	0.10%	0.40%	0.08%	3.90%	0.02%

数据来源：中欧基金，wind

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2013 年 1 月 31 日至 2013 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2013 年 1 月 31 日。建仓期为 2013 年 1 月 31 日至 2013 年 7 月 30 日，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期，基金合同生效不满一年。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金上市费用；
4. 基金财产拨划支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 基金销售服务费；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

3. 基金销售服务费

（1）基金分级运作期内的销售服务费

本基金的销售服务费按前一日纯债 A 的基金资产净值的 0.35% 年费率计提，纯债 B 不收取销售服务费。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为纯债 A 每日应计提的基金销售服务费

E 为纯债 A 前一日基金资产净值

（2）基金分级运作期届满后的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

（四）基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费和基金上市初费及年费、基金银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

（五）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（六）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

（七）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2013 年 1 月 18 日刊登的《中欧纯债分级债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“重要提示”部分

增加了“本更新招募说明书所载内容截止日 2013 年 7 月 30 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。”的描述。

（二）“三、基金管理人”部分

- 1、更新了基金管理人的注册资本数额和股权结构。
- 2、更新了基金管理人董事会成员、高级管理人员、本基金基金经理的相关信息。

（三）“四、基金托管人”部分

更新了托管人的相关信息。

（四）“相关服务机构”部分

- 1、更新了直销机构联系人和代销机构的信息。
- 2、更新了会计师事务所办公地址。

（五）“七、基金的募集”部分

- 1、增加了基金的募集信息。
- 2、删除了涉及募集期的描述。

（六）“八、基金合同的生效”部分

- 1、增加了基金合同的生效日期。
- 2、删除了涉及基金合同生效和募集失败的描述。

（七）“十、基金份额的申购与赎回”部分

增加了纯债 A 第一次办理申购、赎回业务的时间。

（八）“十二、基金的投资”部分

增加了“（十一）基金投资组合报告”的内容，数据截至 2013 年 6 月 30 日。

（九）“十三、基金的业绩”部分

增加了整章的信息，包括“本报告期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”和“基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至 2013 年 6 月 30 日。

（十）“二十三、基金合同的内容摘要”

更新了基金管理人的注册资本数额和经营范围。

（十一）“二十四、基金托管协议的内容摘要”

更新了基金管理人的注册资本数额和经营范围。

（十二）“二十六、其他应披露事项”

增加了自 2013 年 1 月 31 日至 2013 年 7 月 30 日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自 2013 年 1 月 31 日至 2013 年 7 月 30 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同生效公告	2013. 2. 1
2	中欧基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	2013. 2. 22
3	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告	2013. 4. 19
4	中欧纯债分级债券型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	2013. 4. 20
5	中欧基金管理有限公司关于公司股东变更及增加注册资本的公告	2013. 4. 20
6	中欧基金管理有限公司关于新增西南证券为旗下部分基金代销机构的公告	2013. 5. 2
7	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为中欧纯债分级债券型证券投资基金代销机构的公告	2013. 5. 2
8	中欧基金管理有限公司关于新增东吴证券为旗下部分基金代销机构并同时开通定期定额投资业务的公告	2013. 6. 18

9	中欧基金管理有限公司旗下基金 2013 年 6 月 28 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2013. 6. 29
10	中欧基金管理有限公司旗下基金 2013 年 6 月 30 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	2013. 7. 1
11	中欧纯债分级债券型证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	2013. 7. 17
12	中欧基金管理有限公司关于新增华融证券为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告	2013. 7. 24
13	中欧纯债分级债券型证券投资基金之纯债 A 份额开放日常申购与赎回业务公告	2013. 7. 25
14	中欧基金管理有限公司关于中欧纯债分级债券型证券投资基金之纯债 A 份额折算方案的公告	2013. 7. 25

以上内容仅为摘要，须与本基金更新招募说明书（正文）所载之详细资料一并阅读。

中欧基金管理有限公司

2013 年 9 月 13 日