

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

上市交易公告书

目 录

一、	重要声明与提示.....	2
二、	基金概览	2
三、	基金的历史、转型、日常申赎、上市交易和跨系统转托管	3
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	5
五、	基金主要当事人简介.....	6
六、	基金合同摘要.....	9
七、	基金财务状况（未经审计）	9
八、	基金投资组合.....	11
九、	重大事件揭示.....	13
十、	基金管理人承诺.....	13
十一、	基金托管人承诺.....	13
十二、	备查文件目录.....	13
附件：	基金合同摘要.....	15

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2016年3月1日

公告日期：2016年2月25日

一、重要声明与提示

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2015年9月12日刊登于《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》和中欧基金管理有限公司网站(www.zofund.com)的本基金更新招募说明书。

二、基金概览

1、基金名称：中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

场内简称：中欧纯债

2、交易代码：166016

- 3、基金份额总额：截止2016年2月23日，本基金总份额为498,253,007.50份
- 4、基金份额净值：截止2016年2月23日，本基金的基金份额净值为1.340元
- 5、本次上市交易份额：截止2016年2月23日，本次上市交易份额为1,666,870.00份
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2016年3月1日
- 8、基金管理人：中欧基金管理有限公司
- 9、基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

三、 基金的历史、转型、日常申赎、上市交易和跨系统转托管

（一）本基金的历史：

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）由中欧纯债分级债券型证券投资基金分级期届满转换而成。

中欧纯债分级债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2013年1月6日证监许可[2013]12号文核准募集。

中欧纯债分级债券型证券投资基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。基金管理人于2013年1月31日获得中国证监会书面确认，《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模976,522,201.53份。

（二）本基金的转型

根据《中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金合同生效后3年基金分级运作期届满，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，即可按照基金合同的约定转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）”。纯债A、纯债B将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。本基金管理人于2015年12月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及中欧基金管理有限公司网站上刊登了《中欧纯债分级债券型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的公告》。

本基金管理人于2016年2月1日对中欧纯债分级债券型证券投资基金进行了3 年分级届满后的转换工作。份额转换结果如下表：

转换前的 基金份 额 名称	转换前份 额 净值（元）	转换前份 额 数 （份）	转换比例	转换后的基 金份 额 名称	转换后份 额 数 （份）
------------------------	--------------------	-----------------------	------	------------------------	-----------------------

纯债 A	1.00022603	25,035,904.98	0.75543371	中欧纯债债券（LOF）	18,912,966.58
纯债 B	1.35102974	300,607,523.74	1.02038277	中欧纯债债券（LOF）	306,734,737.36

本基金管理人已根据合同约定，对纯债A、纯债B的份额持有人的基金份额进行了计算，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金管理人于2016年2月3日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及中欧基金管理有限公司网站上发布了《中欧纯债分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》。

（三）本基金的日常申购、赎回

本基金管理人自2016年2月5日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

（四）本基金上市交易的主要内容：

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2016】80号
- 2、上市交易日期：2016年3月1日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：中欧纯债债券（LOF）

场内简称：中欧纯债

5、交易代码：166016

6、本次上市交易份额：截止2016年2月23日，本次上市交易份额为1,666,870.00份

7、基金资产净值的披露：

基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率 I”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内即可上市流通。

（五）本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自2016年2月5日起可以开始办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2016年2月23日的基金份额持有情况：

场内基金份额持有人户数：31户；场外基金份额持有人户数：1,647户

平均每户持有的场内基金份额：53,770.00份；平均每户持有的场外基金份额：
301,509.50份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：1,500,375.00份，占90.01%；

场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例：166,495.00份，占9.99%；

场外机构投资者持有的基金份额及占场外基金总份额比例：455,450,192.96份，占91.72%。场外个人投资者持有的基金份额及场外基金占总份额比例：41,135,944.54份，占8.28%。

场内基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有中欧纯债份额（份）	占中欧纯债总份额比例（%）
1	中欧基金—浦发银行—上海浦银安盛资产管理有限公司	1,500,375.00	90.01%
2	张润国	74,704.00	4.48%
3	杨定宇	51,022.00	3.06%
4	程海东	7,496.00	0.45%
5	李丽兴	7,462.00	0.45%
6	黄丽	2,248.00	0.13%
7	任欢	1,500.00	0.09%
8	胡国华	1,500.00	0.09%
9	沈荟	1,499.00	0.09%
10	何琼	1,125.00	0.07%

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：中欧基金管理有限公司

2、法定代表人：窦玉明

3、总经理：刘建平

4、注册资本：1.88亿元人民币

5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层

6、设立批准文号：证监基金字[2006]102号

7、注册号/统一社会信用代码：91310000717866389C

8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和经中国证监会许可的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI ）出资 6580 万元人民币，占公司注册资本的 35% ；

国都证券股份有限公司出资 3760 万元人民币，占公司注册资本的 20% ；

北京百骏投资有限公司出3760 万元人民币，占公司注册资本的 20% ；

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资3760万元人民币，占公司注册资本的20%；

万盛基业投资有限责任公司出940 万元人民币，占公司注册资本的 5% ；

上述5个股东共出资 18,800 万元人民币。

11、内部组织结构及职能

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、基金估值委员会、IT治理委员会等专业委员会。投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，对基金投资的所有重大问题进行决策。风险控制委员会是公司日常运作的最高风险控制机构。基金估值委员会是规范证券投资基金估值中的公允价值定价行为的机构。IT治理委员会是完善公司IT治理工作的机构。

公司目前下设投资事业部、研究部、中央交易室、营销策划部、机构业务部、零售业务部、业务发展部、客户服务部、公司财务部、基金运营部、行政部、信息技术部、人力资源部、监察稽核部、风险管理部等部门，各部门主要职责如下：

- （1） 投资事业部负责权益类资产和固定收益类资产的投资管理和风险控制。
- （2） 研究部负责对宏观经济、市场动态、行业及上市公司等领域进行调查研究，为投资决策提供研究支持以及定量投资的研究、基金业绩归因分析、基金风险评价、研究员业绩考核、衍生品的研究以及数量化程序开发。
- （3） 中央交易室负责执行各项交易指令，及时向基金经理汇报市场异常交易情况以及重大消息。
- （4） 营销策划部负责公司各类产品的市场调研、产品推广、公司品牌建设以及对外交流与合作等事务。
- （5） 机构业务部负责机构客户的开发和维护。
- （6） 零售业务部负责零售客户的开发和维护。
- （7） 业务发展部负责基金产品的研究、设计与开发，以及基金申报材料和发行材料的制作。
- （8） 客户服务部负责日常客户服务工作、并提供销售支持及客户服务相关工作。
- （9） 公司财务部负责公司的财务管理和会计核算。
- （10） 基金运营部负责基金注册登记、基金直销业务办理、基金资金清算以及基金会计核算等事务。
- （11） 行政部负责公司日常行政事务管理。
- （12） 信息技术部负责公司信息系统的建设、维护与管理，为公司管理和业务活动提供技术支持。
- （13） 人力资源部负责公司人力资源管理。
- （14） 监察稽核部负责公司法务、合规监察及内部稽核审计。
- （15） 风险管理部负责对公司旗下组合投资运作中的风险进行研究和控制。

12、人员情况：

截至2015年12月31日，本基金管理人已有正式员工204人，其中管理团队共4人，他们都具有丰富的工作经验和很强的管理能力。员工中59%以上具有硕士以上学位，绝大多数的员工具有多年证券、基金从业经验。

13、信息披露负责人及咨询电话：黎忆海021—68609600-2001

14、基金管理业务情况：

截至本公告编制日，本基金管理人共管理35只开放式基金，即中欧新趋势混合型证券投资基金（LOF）、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资

基金、中欧价值发现混合型证券投资基金、中欧行业成长混合型证券投资基金（LOF）、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）、中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长混合型证券投资基金（LOF）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）、中欧货币市场基金、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）、中欧价值智选回报混合型证券投资基金、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金、中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧明睿新起点混合型证券投资基金、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金、中欧精选灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金、中欧永裕混合型证券投资基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金、中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金、中欧兴利债券型证券投资基金、中欧潜力价值灵活配置混合型证券投资基金、中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金、中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金、中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金、中欧天禧纯债债券型证券投资基金、中欧骏盈货币市场基金和中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金。

15、本基金基金经理：

尹诚庸先生，中国籍。美国莱斯大学统计学硕士，4年以上证券及基金从业经验。历任招商证券股份有限公司固定收益总部研究员、投资经理，中欧基金管理有限公司基金经理助理兼研究员。现任中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金经理。

刘德元先生，中国籍。武汉轻工大学（原武汉工业学院）物流管理专业学士，10年以上证券及基金从业经验。历任大公国际资信评估有限公司技术总监，阳光资产管理股份有限公司高级研究员。2015年6月加入中欧基金管理有限公司，曾任信用研究员，现任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧兴利债券型证券投资基金基金经理、中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理、中欧骏盈货币市场基金基金经理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理。

（二）基金托管人

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）

法定代表人：李国华

注册资本：570 亿元人民币

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

托管部负责人：田东辉

信息披露负责人：田东辉

电话：010-68858126

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，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。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。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

执行事务合伙人：李丹

主要经营场所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

经办注册会计师：单峰 俞伟敏

电话：021-23238888

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、 基金财务状况（未经审计）

深圳证券交易所在中欧纯债分级债券型证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

中欧纯债债券型证券投资基金 (LOF) 2016年2月23日资产负债表如下：

项目	行次	2016年2月23日
资产		
银行存款	1	97,834,293.37
清算备付金	2	21,682,395.37
交易保证金	3	
应收证券清算款	4	
应收股利	5	
应收利息	6	16,364,934.36
应收申购款	7	220,782,103.17
其他应收款	8	
股票投资—市值	9	
其中：股票投资成本	10	
债券投资—市值	11	357,051,440.00
其中：债券投资成本	12	353,282,960.26
权证投资	13	
其中：权证投资成本	14	
买入返售证券	15	20,000,000.00
待摊费用	16	
其他资产	17	
资产总计	18	733,715,166.27
负债		
应付证券清算款	19	65,003,354.17
应付赎回款	20	239,375.62
应付赎回费	21	
应付管理人报酬	22	164,744.14
应付托管费	23	54,914.72
应付销售服务费	24	88,331.11
应付交易费用	25	1,340.00
应付利息	26	
应付收益	27	
应交税金	28	192,640.00
其他应付款项	29	
卖出回购证券款	30	
短期借款	31	
预提费用	32	
其他负债	33	308,688.56
负债合计	34	66,053,388.32
持有人权益		
实收基金	35	474,401,365.23
未实现利得	36	

未分配收益	37	193,260,412.72
持有人权益合计	38	667,661,777.95
负债及持有人权益总计	39	733,715,166.27

八、 基金投资组合

截止到2016年2月23日，中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票		
2	债券	357,051,440.00	48.66%
3	权证		
4	银行存款及清算备付金	119,516,688.74	16.29%
5	其他资产	257,147,037.53	35.05%
	合计	733,715,166.27	100%

（二）期末按行业分类的股票投资组合

注：截止 2016 年 2 月 23 日，本基金未持有股票。

（三）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

注：截止 2016 年 2 月 23 日，本基金未持有股票。

（四）期末按券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	316,975,440.00	47.48%
5	企业短期融资券	40,076,000.00	6.00%
6	可转债	-	-
7	其他		
8	合计	357,051,440.00	53.48%

（五）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	122648	12 宣国投	500,000	53,420,000.00	8.00%
2	122722	PR 淮水利	500,000	42,230,000.00	6.33%
3	124242	13 营经开	400,000	41,096,000	6.16%
4	041653013	16 大丰海港 CP001	400,000	40,076,000	6.00%
5	122702	PR 海安债	500,000	39,300,000	5.89%

（六）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号	项目	金额（元）
1	买入返售金融资产	20,000,000.00
2	交易保证金	
3	应收利息	16,364,934.36
4	应收申购款	220,782,103.17
5	应收股利	
6	待摊费用	
7	其他应收款	
8	应收证券清算款	
合计		257,147,037.53

4、本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5、本报告期末本基金未持有权证。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、 备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件：

- (一) 中国证监会核准中欧纯债分级债券型证券投资基金募集的文件；
- (二) 中欧纯债分级债券型证券投资基金基金合同；
- (三) 中欧纯债分级债券型证券投资基金托管协议；
- (四) 中欧纯债分级债券型证券投资基金招募说明书；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站 (www.zofund.com) 查阅。

中欧基金管理有限公司

2016年2月25日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利义务

（一）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8. 依据本基金合同约定，转换本基金运作方式；
9. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
10. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
11. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，

对其行为进行必要的监督和检查；

12. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

13. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

14. 依法召集基金份额持有人大会；

15. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7. 依法接受基金托管人的监督；

8. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12. 编制季度、半年度和年度基金报告；

13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

19. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26. 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 安全保管基金财产；
2. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（五）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法转让纯债 B 和中欧纯债分级债券型证券投资基金（LOF）基金份额及根据基金合同约定申请赎回其持有的纯债 A 和中欧纯债分级债券型证券投资基金（LOF）基金份额；
4. 按照规定要求召集基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7. 监督基金管理人的投资运作；
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

分级运作期内，同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。本基金转为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）后，每份基金份额具有同等的合法权益。

（六）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1. 在基金分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由纯债 A、纯债 B 基金份额持有人独立进行表决。纯债 A、纯债 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2. 基金分级运作期届满，本基金转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）。基金份额持有人将按其所持有的上市开放式基金的每一基金份额享有

相应的投票权。

（二）召集事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召集基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式，但本基金分级运作期届满后转为上市开放式基金（LOF）除外；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）提前终止纯债 A、纯债 B 并进行基金运作方式的转换；

（10）终止纯债 B 或中欧纯债分级债券型证券投资基金（LOF）上市，但因纯债 B 或中欧纯债分级债券型证券投资基金（LOF）不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（12）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会。在分级运作期内，依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有纯债 A 和纯债 B 各自的基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人”；

（13）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召集基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更申购费率、调低赎回费率、变更或新增收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、证券交易所或注册登记机构业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

(三) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召集基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召集；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召集的，应当自行召集。

3. 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召集基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召集；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召集的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召集。

4. 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召集基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有

人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（四）召集基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召集基金份额持有人大会，召集人必须于会议召集日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召集的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- （6）代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

1. 会议方式

（1）基金份额持有人大会的召集方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规或监管机构允许的其他方式。

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

（3）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

（4）会议的召集方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（5）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

2. 召集基金份额持有人大会的条件

（1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，在分级运作期内，指纯债 A、纯债 B 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日纯债 A、纯债 B 各自基金总份额的 50%以上（含 50%））；

2）到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1）召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称

为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3）召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，在分级运作期内，指本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日纯债 A、纯债 B 各自基金总份额的 50%以上（含 50%））；

5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

（六）议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召集基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召集事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照

基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召集 30 日前及时公告。否则，会议的召集日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

2. 议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上（含 50%，在分级运作期内，指纯债 A、纯债 B 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日纯债 A、纯债 B 各自基金总份额的 50%以上（含 50%））多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人（在分级运作期内，指出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的纯债 A、纯债 B 各自基金份额 50%以上（含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人）。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部

有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。在基金分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由纯债 A、纯债 B 基金份额持有人独立进行表决，且纯债 A、纯债 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。但在基金分级运作期内，一般决议须同时经参加大会的纯债 A、纯债 B 各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；

（2）特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式（本基金依据本基金合同的约定转换运作方式的除外）、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。在基金分级运作期内，特别决议须同时经过参加大会的纯债 A、纯债 B 各自的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（八）计票

1. 现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人或基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、

基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（二）基金收益分配的原则

基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金在分级运作期内及分级运作期届满时，收益分配应遵循下列原则：

（1）本基金不单独对纯债 A 与纯债 B 进行收益分配；

（2）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2. 本基金转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式，若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红，若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；登记在深圳证券账户的基金份额的收益分配只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 10%（期末可供分配利润指基金收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；

（4）基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于初始面值；

（5）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（6）基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

（7）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（四）收益分配的时间和程序

1. 本基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2. 在收益分配方案公告后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红的划付。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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。

五、基金资产的投资范围和投资限制

（一）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。

（二）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

2.本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

3.本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过该基金资产净值的 10%；

4. 本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%；

5.本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

6. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

7.本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

8.本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

9.本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

10.在纯债 A 的开放日及该日前 4 个工作日和分级运作期终止后，本基金所持有现金或到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

11.法律法规或中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

（三）禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

1. 承销证券；
2. 将基金财产向他人贷款或提供担保；
3. 从事承担无限责任的投资；
4. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
7. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
8. 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值

（二）基金资产净值的公告方式

1. 本基金的基金合同生效后，在纯债 B 上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；
2. 在纯债 B 上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；
3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值登载在指定报刊和基金管理人的公司网站上；
4. 在基金管理人在纯债 A 的开放日披露纯债 A 的基金份额参考净值，在纯债 B 的封闭期届满日披露纯债 A 与纯债 B 的基金份额参考净值；
5. 基金托管人对基金资产净值、基金份额净值、纯债 A 和纯债 B 的基金份额参考净值、纯债 A 的每个开放日的基金份额参考净值和纯债 B 的封闭期届满

日纯债 A 与纯债 B 的基金份额参考净值及相关披露内容进行复核；

6. 在本基金分级运作期届满并转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）后：

在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或开始上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过基金管理人的公司网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和基金管理人的公司网站上。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召集基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式，但本基金分级运作期届满转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）除外；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）提前终止纯债 A、纯债 B 并进行基金运作方式的转换；

（10）终止纯债 B 或中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）上市，但因纯债 B 或中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（11）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（12）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更或新增收费方式；

（3）因相应的法律法规、证券交易所或注册登记机构业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 法律法规、中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1. 基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2. 基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3. 清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）基金清算组做出清算报告；

（6）会计师事务所对清算报告进行审计；

（7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（8）将基金清算结果报告中国证监会；

（9）公布基金清算公告；

（10）对基金剩余财产进行分配。

4. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

5. 基金财产清算剩余资产的分配

若在基金分级运作期届满前基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，根据基金合同“虚拟清算”的原则计算并确定纯债 A 和

纯债 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对纯债 A 和纯债 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若在基金分级运作期届满，即本基金转换为中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）后基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6. 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

