中欧鼎利分级债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十八日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧鼎利分级债券(场内简称:中欧鼎利)		
基金主代码	166010		
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效后一年内封闭运作,不开放申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额分别在深圳证券交易所上市交易。封闭期结束后,中欧鼎利份额开放申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额继续上市交易但不可单独申购、赎回。		
基金合同生效日	2011年6月16日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	126,152,099.04份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011年9月15日		
下属分级基金的基金简称	中欧鼎利分级债券	鼎利A	鼎利B
下属分级基金的交易代码	166010	150039	150040
报告期末下属分级基金的份额总额	99,938,060.04份	18,349,827.00份	7,864,212.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的长期回报。
投资策略	本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。在固定收益类资产投资方面,将综合运用久期配置策略、利率期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用策略、可转债投资策略、资产支持证券投资策略及流动性策略等。此外,本基金以股票类资产投资作为整体投资组合管理的辅助工具,为投资人提供适度参与股票市场的机会,并结合新股申购策略及权证投资策略以提高投资组合收益。
业绩比较基准	中国债券总指数×90%+沪深300指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。其中,鼎利A份额表现出低风险、收益稳定特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。鼎利B份额表现出较高风险、收益相对较高的特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额,类似于具有收益杠杆性的债券型基金份额。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	朱义明
	联系电话	021-68609600	010-65556899
	电子邮箱	liyihai@lcfunds.com	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95558
传真		021-33830351	010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	12,732,996.01
本期利润	8,016,007.33
加权平均基金份额本期利润	0.0510
本期基金份额净值增长率	4.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0875
期末基金资产净值	137,191,383.47
期末基金份额净值	1.088

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

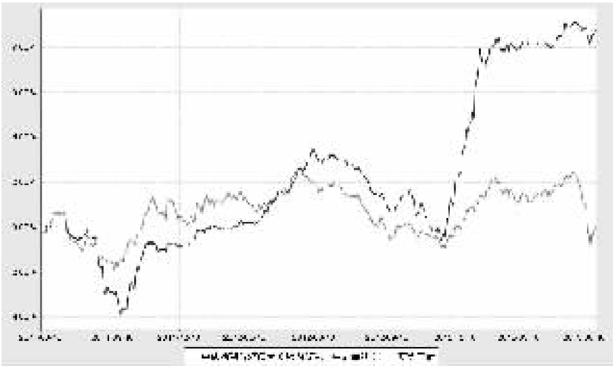
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.27%	0.15%	-2.27%	0.32%	2.00%	-0.17%
过去三个月	0.55%	0.11%	-1.17%	0.21%	1.72%	-0.10%
过去六个月	4.31%	0.18%	-0.82%	0.18%	5.13%	0.00%
过去一年	5.63%	0.19%	-1.79%	0.16%	7.42%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.80%	0.17%	-0.06%	0.16%	8.86%	0.01%

注:本基金大类资产的投资比例为:国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例占基金资产的比例不低于80%。本基金可以从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产,投资于股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于20%,其中权证资产比例不超过基金资产净值的3%。封闭期结束后,基金保留的现金以及投资于剩余期限在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围,我们选择将本基金主要投资的两个大类资产即债券资产和股票资产的市场表现组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在代表大类资产表现的标的指数选择上,我们选择了具有较强代表性的中国债券总指数和沪深300指数作为两大类资产的标的指数。比较基准中债券和股票类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考,最终具体比例为债券部分90%,股票部分10%。比较基准每个交易日进行一次再平衡,每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡,使大类资产比例保持恒定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧鼎利分级债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年6月16日至2013年6月30日)



注:本基金合同生效日为2011 年6 月16日,建仓期为2011年6月16 日至2011 年12 月15 日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会(证监基字[2006]102号文)批准,于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券有限责任公司、北京百骏投资有限公司、万盛基业投资有限责任公司,注册资本为1.88亿元人民币。截至2013年6月30日,本基金管理人共管理14只开放式基金,即中欧新趋势股票型证券投资基金(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、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小盘股票型证券投资基金(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)、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、中欧鼎利分级债券型证券投资基金、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金、中欧纯债分级债券型证券投资基金和中欧价值智选回报混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
聂曙光	本基金基金经理,中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)基金经理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理,固定收益部总监	2011-06-16	-	8年	企业管理硕士。历任南京银行债券分析师,兴业银行上海分行债券投资经理。2009年9月加入中欧基金管理有限公司,历任债券研究员、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、基金经理;现任中欧增强回报债券型证券投资基金(LOF)基金经理、中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、固定收益部总监。
袁争光	本基金基金经理助理	2012-09-25	2013-01-31	7年	金融学专业硕士。历任上海金信证券研究所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。2009年10月加入中欧基金管理有限公司至今,曾任研究员、高级研究员、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;现任中欧纯债分级债券型证券投资基金的基金经理、中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济复苏趋势有所松动,导致前期过强的预期向下调整。主要表现在经济增长数据下滑,房地产市场对经济约束提前显现,宏观政策在政府换届后显现出向控风险倾斜的苗头。同时,在外汇占款大幅增加推动下,一季度资金面整体维持了宽松局面。在经济基本面预期下修、资金宽松、理财新规推动下,一季度债券市场整体上涨,而转债和股票市场则经历了前期惯性上冲和后期向下调整的过程。二季度经济数据继续向下,自去年3季度开始的复苏进程夭折,市场所期待的保增长政策也未出现,控风险的重要性进一步上升到了突出的位置。伴随着美联储宽松政策退出路线图的公布和央行政策态度的转变,二季度末资金面出现了空前的紧张,导致股票市场和债券市场双双出现大幅下跌。

本基金一季度本基金主要操作是在一月底大幅减持了可转债和股票仓位,减持时机稍早,二季度依然维持谨慎态度,以现金类资产为主要操作对象,在可转债急跌过程中有少量建仓。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为4.31%,同期业绩比较基准增长率为-0.82%,基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计宏观政策将维持偏紧状态,以盘活存量为主,依靠增量推动经济增长的模式无以为继,在经济增长稳定在7%以上的情况下,政策思路将从保增长的角度转移到一边化解风险,一边以改革释放增长动力的角度。同时,美联储宽松政策退出大背景下,全球流动性逐步收紧也是重大的不利因素。在这样的背景下,股市和债市仍无趋势性机会,以区间震荡为主。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定,有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理,成员包括总经理、督察长、投资总监,基金运营部总监,监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:基金日常估值由基金管理人进行,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以XBRL形式报给基金托管人,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。截止本报告期末,根据本基金基金合同和相关法律法规的规定,本基金无需实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求,对基金管理人——中欧基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金的基金管理人——中欧基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中欧鼎利分级债券型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	9,100,518.60	3,175,778.70
结算备付金	3,099,345.77	261,751.05
存出保证金	59,159.60	500,000.00
交易性金融资产	84,659,517.66	228,990,217.30
其中:股票投资	3,349,828.96	28,824,416.32
基金投资	-	-
债券投资	81,309,688.70	200,165,800.98
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	47,000,000.00	1,800,000.00
应收证券清算款	-	577,636.05
应收利息	1,504,870.37	2,163,302.13
应收股利	-	-
应收申购款	8,546.27	4,018.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	145,431,958.27	237,472,703.41
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	32,000,000.00
应付证券清算款	6,985,416.66	-
应付赎回款	348,878.05	297,939.57
应付管理人报酬	85,196.07	141,251.00
应付托管费	24,341.72	40,357.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,030.88	68,133.81
应交税费	353,048.80	341,648.80
应付利息	-	18,530.24
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	442,662.62	810,157.90
负债合计	8,240,574.80	33,718,018.70
所有者权益:		
实收基金	126,152,099.04	195,424,544.41
未分配利润	11,039,284.43	8,330,140.30
所有者权益合计	137,191,383.47	203,754,684.71
负债和所有者权益总计	145,431,958.27	237,472,703.41

注:报告截止日2013年6月30日,中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额净值1.088元,中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额净值1.087元,中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额净值1.090;基金份额总额126,152,099.04份,其中中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额99,938,060.04份,中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额18,349,827.00份,中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额7,864,212.00份。

6.2 利润表

会计主体:中欧鼎利分级债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	9,105,587.46	37,497,231.80
1.利息收入	2,317,014.46	15,100,207.25
其中:存款利息收入	72,183.70	163,354.97
债券利息收入	1,061,652.00	13,322,589.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,183,178.76	1,614,262.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	11,493,797.22	6,327,250.31
其中:股票投资收益	1,595,275.31	-1,176,515.58
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,857,391.91	6,377,515.94
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	41,130.00	1,126,249.95
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-4,716,988.68	16,014,664.75
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	11,764.46	55,109.49
减:二、费用	1,089,580.13	4,663,065.98
1.管理人报酬	590,264.41	3,008,203.57
2.托管费	168,646.94	859,486.72
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	55,549.94	347,450.71
5.利息支出	63,075.68	218,861.94
其中:卖出回购金融资产支出	63,075.68	218,861.94
6.其他费用	212,043.16	229,063.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	8,016,007.33	32,834,165.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	8,016,007.33	32,834,165.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中欧鼎利分级债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	195,424,544.41	8,330,140.30	203,754,684.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,016,007.33	8,016,007.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-69,272,445.37	-5,306,863.20	-74,579,308.57
其中:1.基金申购款	5,706,951.34	441,762.04	6,148,713.38
2.基金赎回款	-74,979,396.71	-5,748,625.24	-80,728,021.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	126,152,099.04	11,039,284.43	137,191,383.47

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58	869,678,113.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,834,165.82	32,834,165.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-395,009,483.95	-12,803,020.78	-407,812,504.73
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68	144,319.50
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46	-407,956,824.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46	494,699,774.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘建平,主管会计工作负责人:黄峰,会计机构负责人:丁骍雯

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧鼎利分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]第550号《关于核准中欧鼎利分级债券型证券投资基金募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,在基金合同生效后一年内封闭运作,不开放申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额分别在深圳证券交易所(以下简称"深交所")上市交易。封闭期结束后,中欧鼎利份额开放申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额继续上市交易但不可单独申购、赎回。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币874,872,108.90元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第239号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为875,257,397.74份,其中认购资金利息折合385,288.84份,场外认购的全部份额确认为中欧鼎利分级债券型证券投资基金之基础份额(以下简称"中欧鼎利份额")781,957,028.74份,场内认购部分按照基金合同约定的7:3比例份额确认为中欧鼎利分级债券型证券投资基金之A份额(以下简称 "鼎利A份额")65,310,258.00份和中欧鼎利分级债券型证券投资基金之B份额 (以下简称 "鼎利B份额")27,990,111.00份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》和《中欧鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理中欧鼎利份额与鼎利A份额、鼎利B份额之间的份额配对转换业务, 基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算并对折算后的中欧鼎利份额的场内份额按照7:3的比例拆分为预期收益与风险不同的两个份额类别, 即获取稳健收益的基金份额(即"鼎利A份额")和获取进取收益的基金份额(即"鼎利B份额"),两类基金份额的基金资产合并运作。本基金7份鼎利A份额与3份鼎利B份额构成一对份额组合, 一对鼎利A份额与鼎利B份额的份额组合的净值之和将等于10份中欧鼎利份额的净值。鼎利A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款利率加上1%。鼎利B份额的份额净值根据中欧鼎利份额的份额净值、鼎利A份额的份额净值以及中欧鼎利份额、鼎利A份额、鼎利B份额的份额净值关系计算。在满足一定条件的情况下,本基金的基金管理人将根据基金合同约定,对本基金所有份额进行折算,所有的基金份额净值调整到1.000元。

经深交所深证上[2011]第279号文审核同意,本基金93,300,369.00份基金份额于2011年9月15日在深交所挂牌交易(其中鼎利A份额为65,310,258.00份,鼎利B份额为27,990,110.00份)。一年封闭期结束后,中欧鼎利份额开放场内和场外申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额继续上市交易但不可单独申购、赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、短期融资券、资产支持证券、可转债、可分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%,本基金可以从二级市场买入股票、权证等非固定收益类资产,本基金投资于股票、权证等非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%,其中权证资产比例不超过基金资产净值的3%。中欧鼎利份额开始办理申购赎回业务后,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数 × 90%+沪深300 指数 × 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2013年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称 "企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日半年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,经中国证监会证监许可[2013]240号文核准,中欧基金管理有限公司新增北京百骏投资有限公司为本基金管理人股东,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方均未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金代销机构
国都证券有限责任公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	3,957,388.50	14.64%	41,506,593.86	18.27%

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券	5,389,682.01	3.61%	110,849,369.93	38.21%

6.4.8.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	43,000,000.00	0.82%	2,362,800,000.00	65.35%

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	3,602.62	14.84%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	35,382.34	18.58%	35,382.34	19.08%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	590,264.41	3,008,203.57
其中:支付销售机构的客户维护费	111,226.25	877,631.99

注:支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	168,646.94	859,486.72

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	465,989.61	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	465,989.61	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.37%	-

注:本基金管理人本报告期内申购本基金的交易委托国都证券办理,所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	9,100,518.60	38,007.69	6,876,227.47	126,928.93

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2013年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为24,587,517.66元,属于第二层级的余额为60,072,000.00元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级157,693,217.30元,第二层级71,297,000.00元,第三层级无)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,349,828.96	2.30
	其中:股票	3,349,828.96	2.30
2	固定收益投资	81,309,688.70	55.91
	其中:债券	81,309,688.70	55.91
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	47,000,000.00	32.32
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,199,864.37	8.39
6	其他各项资产	1,572,576.24	1.08
7	合计	145,431,958.27	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,231,828.96	2.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,800.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	95,200.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,349,828.96	2.44

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600066	宇通客车	90,000	1,649,700.00	1.20
2	600276	恒瑞医药	22,000	579,920.00	0.42
3	600079	人福医药	19,962	520,608.96	0.38
4	000982	中银绒业	30,000	240,300.00	0.18
5	002444	巨星科技	10,000	129,300.00	0.09
6	600141	兴发集团	10,000	112,000.00	0.08
7	601117	中国化学	10,000	95,200.00	0.07
8	600795	国电电力	10,000	22,800.00	0.02

注:本基金本报告期末共持有八只股票,已在上表列示。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002304	洋河股份	519,690.00	0.26
2			-	-
3			-	-
4			-	-
5			-	-
6			-	-
7			-	-
8			-	-
9			-	-
10			-	-
11			-	-
12			-	-
13			-	-
14			-	-
15			-	-
16			-	-
17			-	-
18			-	-
19			-	-
20			-	-

注:买入金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600795	国电电力	2,651,270.00	1.30
2	002304	洋河股份	2,454,526.00	1.20
3	601888	中国国旅	1,975,741.65	0.97
4	002318	久立特材	1,929,553.36	0.95
5	600549	厦门钨业	1,484,853.98	0.73
6	600141	兴发集团	1,221,166.39	0.60
7	600547	山东黄金	1,083,480.10	0.53
8	002041	登海种业	982,961.00	0.48
9	300115	长盈精密	788,469.82	0.39
10	601933	永辉超市	730,598.75	0.36
11	601117	中国化学	693,722.00	0.34
12	300285	国瓷材料	668,008.00	0.33
13	000708	大冶特钢	599,634.04	0.29
14	000002	万科A	588,468.00	0.29
15	600157	永泰能源	497,193.50	0.24
16	600138	中青旅	481,686.00	0.24
17	002236	大华股份	471,100.00	0.23
18	000937	冀中能源	464,305.00	0.23
19	600021	上海电力	456,200.00	0.22
20	601601	中国太保	455,800.00	0.22

注:卖出金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	519,690.00
卖出股票的收入(成交)总额	26,503,756.15

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,001,000.00	7.29
	其中:政策性金融债	10,001,000.00	7.29
4	企业债券	102,500.00	0.07
5	企业短期融资券	50,071,000.00	36.50
6	中期票据	-	-
7	可转债	21,135,188.70	15.41
8	其他	-	-
9	合计	81,309,688.70	59.27

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041253037	12联通CP001	200,000	20,114,000.00	14.66
2	011350002	13商飞SCP002	200,000	19,924,000.00	14.52
3	041253059	12新奥CP001	100,000	10,033,000.00	7.31
4	080215	08国开15	100,000	10,001,000.00	7.29
5	110023	民生转债	30,000	3,118,500.00	2.27

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1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。

7.9.2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。

7.10投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.10.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,159.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,504,870.37
5	应收申购款	8,546.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,572,576.24

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	2,994,600.00	2.18
2	125089	深机转债	2,879,640.00	2.10
3	110017	中海转债	2,767,800.00	2.02
4	113001	中行转债	2,002,200.00	1.46
5	110020	南山转债	1,998,200.00	1.46
6	113002	工行转债	1,640,700.00	1.20
7	110012	海运转债	1,046,200.00	0.76
8	110011	歌华转债	977,000.00	0.71
9	110018	国电转债	776,005.60	0.57
10	113003	重工转债	546,600.00	0.40
11	110016	川投转债	120,800.00	0.09
12	127001	海直转债	111,781.00	0.08
13	125887	中鼎转债	110,607.00	0.08
14	110022	同仁转债	12,963.00	0.01
15	110019	恒丰转债	10,649.00	0.01
16	110007	博汇转债	10,426.00	0.01

7.10.5 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。

7.10.6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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧鼎利分级债券	1,146	87,205.99	50,466,795.16	50.50%	49,471,264.88	49.50%
鼎利A	128	143,358.02	17,005,879.00	92.68%	1,343,930.00	7.32%
鼎利B	122	64,460.75	7,009,589.00	89.13%	854,623.00	10.87%
合计	1,396	90,366.83	74,482,263.16	59.04%	51,669,817.88	40.96%

8.2 期末上市基金前十名持有人

鼎利A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司-光大稳健1号信托计划	7,000,583.00	38.15%
2	中国对外经济贸易信托有限公司-资产配置固定收益信托	7,000,291.00	38.15%
3	启东市农村信用合作联社企业年金计划-中国银行	1,415,687.00	7.71%
4	中江国际信托股份有限公司企业年金计划-交通银行	748,200.00	4.08%
5	湖南省烟草公司郴州市公司企业年金计划-中国工商银行	540,446.00	2.95%
6	麦秋红	420,052.00	2.29%
7	熊惠君	350,014.00	1.91%
8	丽江黑白水电力股份有限公司企业年金计划-招商银行	300,000.00	1.63%
9	谢素娟	63,700.00	0.35%
10	高超	51,815.00	0.28%

注:以上均为场内持有人。

鼎利B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司-光大稳健1号信托计划	3,000,250.00	38.15%
2	中国对外经济贸易信托有限公司-资产配置固定收益信托	3,000,125.00	38.15%
3	金元证券股份有限公司	539,124.00	6.86%
4	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托R2007ZX115	256,988.00	3.27%
5	麦秋红	180,023.00	2.29%
6	熊惠君	150,006.00	1.91%
7	中信证券-中信-中信证券可转债集合资产管理计划	115,983.00	1.47%
8	李华	97,100.00	1.23%
9	钱晓晴	88,000.00	1.12%
10	建设银行养颐乐.金岁企业年金集合计划-农行	72,316.00	0.92%

注:以上均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中欧鼎利分级债券	鼎利A	鼎利B
基金合同生效日(2011年6月16日)基金份额总额	781,957,028.74	65,310,258.00	27,990,111.00
本报告期期初基金份额总额	157,839,975.41	26,309,198.00	11,275,371.00
本报告期基金总申购份额	17,077,481.34	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	74,979,396.71	7,959,371.00	3,411,159.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,938,060.04	18,349,827.00	7,864,212.00

注:中欧鼎利申购含配对转换入、转换入份额;赎回含配对转换出、转换出份额。鼎利A、鼎利B申购为配对转换入份额;赎回为配对转换出份额。其中,鼎利A份额、鼎利B份额的本期赎回(即配对转换出份额)之和等于中欧鼎利分级债券基金份额配对转换入份额。配对转换业务所产生的实收基金变动以净额列示。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	1	3,957,388.50	14.64%	3,602.62	14.84%	-
兴业证券	1	10,155,991.06	37.58%	9,246.14	38.09%	-
光大证券	1	12,910,066.59	47.77%	11,424.16	47.07%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注:1、根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2、本报告期内,本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国都证券	5,389,682.01	3.61%	43,000,000.00	0.83%	-	-
兴业证券	137,063,548.34	91.89%	4,480,000,000.00	85.93%	-	-
光大证券	6,700,113.04	4.49%	690,700,000.00	13.25%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中欧基金管理有限公司
二〇一三年八月二十八日