

中欧鼎利分级债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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约定,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的约定,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、基金收益分配等进行了复核,未发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《中欧鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规、基金合同和托管协议的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、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数据、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容,符合会计准则、法规和基金合同的要求,真实、准确和完整。

6.1 资产负债表
报告截止日:2013年6月30日
单位:人民币元

资产	本报告期末 2013年6月30日	上年度期末 2012年12月31日
货币资金	9,109,518.60	3,175,778.70
交易性金融资产	3,349,838.57	261,751.65
应收利息	99,559.60	500,000.00
交易性金融资产	84,659,517.66	228,990,217.30
其中:股票投资	3,349,838.57	28,824,416.32
资产支持证券	81,309,688.70	200,165,800.98
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	47,000,000.00	1,800,000.00
应收款项类资产	-	377,630.05
应收利息	1,504,870.37	2,163,302.13
应收股利	-	-
应收证券清算款	-	8,546.27
其他应收款	-	4,018.18
其他资产	-	-
资产总计	145,431,988.27	237,472,703.41
负债和所有者权益	本报告期末 2013年6月30日	上年度期末 2012年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
应付短期融资款	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
预收账款	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他应付款	-	-
其他负债	-	-
所有者权益:	-	-
实收资本	126,152,099.04	126,152,099.04
未分配利润	19,279,889.23	111,320,604.37
所有者权益合计	145,431,988.27	237,472,703.41

6.2 利润表
报告截止日:2013年6月30日
单位:人民币元

项目	本报告期 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	10,010,207.25
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)	11,449,797.22	6,327,320.31
其中:股票投资收益	1,595,275.31	-1,176,515.58
基金投资收益	9,857,391.91	6,377,515.94
衍生工具投资收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	41,130.00	1,126,249.95
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-4,716,988.68	16,014,664.75
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	122,043.16	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	本报告期末 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	10,010,207.25
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)	11,449,797.22	6,327,320.31
其中:股票投资收益	1,595,275.31	-1,176,515.58
基金投资收益	9,857,391.91	6,377,515.94
衍生工具投资收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	41,130.00	1,126,249.95
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-4,716,988.68	16,014,664.75
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	122,043.16	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

6.4 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	195,424,544.41	8,330,140.30
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-69,272,445.37	-5,306,863.20
其中:1.基金申购款	5,706,951.34	441,762.04
2.基金赎回款	-74,979,396.71	-5,748,625.24
三、期末所有者权益(基金净值)	126,152,099.04	113,039,283.43

6.5 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.6 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.7 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.8 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.9 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.10 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.11 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.12 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.13 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.14 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.15 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.16 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.17 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.18 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)	-395,009,483.95	-12,803,020.78
其中:1.基金申购款	139,813.82	4,505.68
2.基金赎回款	-395,149,297.77	-12,807,526.46
三、期末所有者权益(基金净值)	480,247,913.79	14,451,860.46

6.19 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	本报告期末 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、期初所有者权益(基金净值)	875,257,397.74	-5,579,284.58
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
三、本期基金净值变动数(本期净值变动)		