

中欧鼎利分级债券型证券投资基金

[2012] 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年一月二十二日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

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1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告,并对本基金的运作情况、误报性陈述或重大遗漏,并承担基金一定盈利。

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。

基金管理人承诺不以谋求其本来源表现。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。

招募说明书

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中欧鼎利分级债券型证券投资基金

基金主代码 166012

基金运作方式 约定型,本基金在合同期效内一年定期封闭运作,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,在开放期申购、赎回,鼎利A份额和鼎利B份额的份额净值、交易价格等将不再单独申购、赎回。

基金合同生效日 2011年6月16日

报告期末基金份额总额 199,424,544.01份

报告目标 本基金在封闭期主要投资于货币市场工具,通过分级投资降低基金资产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性和在投资的货币市场工具方面,将投资于久期匹配的定期存款、利率期货及配置策略,固定收益类资产,以构建投资策略,资产支持证券、证券投资基金及流动性策略等。本基金以股票资产投资为载体,投资于基金管理的辅助工具,为投资人提供相对稳定的收益。

投资策略 本基金将通过定期开放机制,在投资的货币市场工具方面,并结合新申购策略及定期投资策略以提高投资组合的流动性。

业绩比较基准 中证综合债指数×90%+银行存款利率(税后)×10%

本基金为纯债券型基金,属于中低风险、预期收益和预期风险适中-偏低的货币市场基金。

风险收益特征 本基金在投资策略上秉承投资原则,并结合其固有的特点,通过分级投资降低基金资产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性和在投资的货币市场工具方面,将投资于久期匹配的定期存款、利率期货及配置策略,固定收益类资产,以构建投资策略,资产支持证券、证券投资基金及流动性策略等。本基金以股票资产投资为载体,投资于基金管理的辅助工具,为投资人提供相对稳定的收益。

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

报告期中基金费用情况 0.0271

报告期中基金利润 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元

报告期中基金亏损 1,043元

报告期中基金净值 1,408,600.37元

报告期中基金利润 6,968,060.15元

报告期中基金亏损 0.0271元

报告期中基金资产净值 203,754,684.03元