

中欧强盈定期开放债券型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016年8月24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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月22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2016年3月25日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧强盈债券
基金主代码	002532
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年3月25日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	600,322,136.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金管理人将根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，“自上而下”在各类债券资产类别之间进行类属配置，“自下而上”进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。当市场收益率上行时，基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值，以回避一定的市场风险。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	张建春
	联系电话	021-68609600	010-63639180
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95595
传真		021-33830351	010-63639132

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.zofund.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（2016年3月25日至2016年6月30日）
本期已实现收益	5,639,101.17
本期利润	6,334,832.45
加权平均基金份额本期利润	0.0106
本期基金份额净值增长率	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0094
期末基金资产净值	606,656,969.30
期末基金份额净值	1.011

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、上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。

4、本基金合同于2016年3月25日生效。

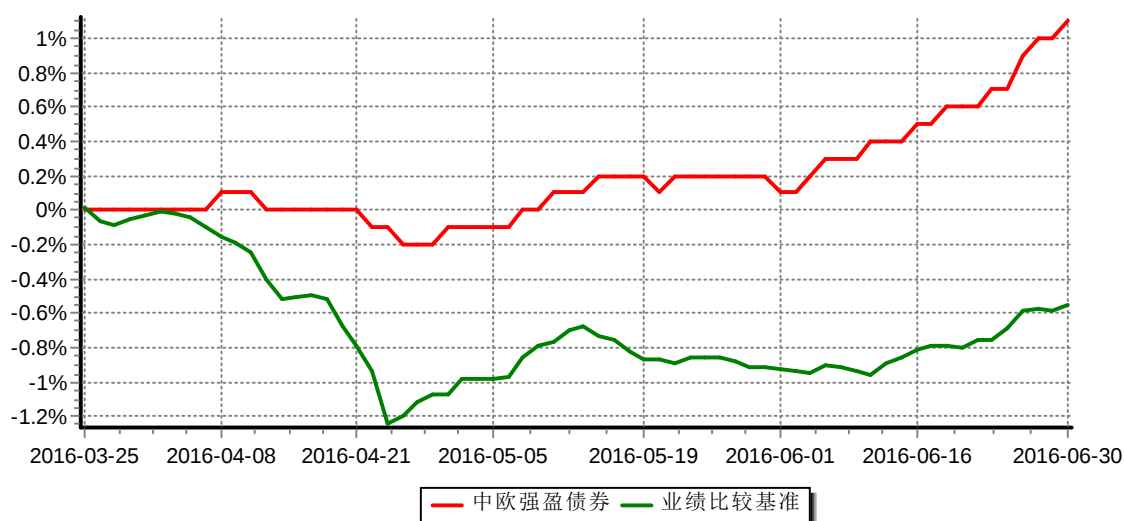
3.2 基金净值表现

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	0.90%	0.07%	0.36%	0.04%	0.54%	0.03%
过去三个月	1.10%	0.06%	-0.52%	0.07%	1.62%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	1.10%	0.06%	-0.55%	0.07%	1.65%	-0.01%

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

中欧强盈定期开放债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年3月25日-2016年6月30日)



注：本基金基金合同生效日为2016年3月25日，自基金合同生效日至本报告期末不满一年，按基金合

同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§ 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、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年6月30日，本基金管理人共管理40只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
刘德元	基金经理	2016年3月25日	—	11年	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，中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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、本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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，未发现不同投

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

回顾上半年，经济基本面年初迎来开门红，在信贷放量、基建发力、大宗商品上涨以及房地产销售投资回暖等因素共同刺激下，基本面一度呈现了“小阳春”的局面。但随着权威人士对经济L型走势的定调，市场预期回归平稳，经济再次面临小幅下行压力。

具体来看，固定资产投资方面，基建投资增速保持高位稳定，房地产行业一季度呈现火爆行情，使得一季度固定资产投资增速反弹，但受到二季度地产投资高位回落，以及制造业投资、民间投资失速下滑的拖累，二季度投资增速出现下滑；工业格局整体表现向好，工业增加值一季度有所反弹，二季度小幅回落，从工业企业盈利状况来看，上半年较去年亏损情况大幅改善，说明今年以来供给侧改革的效果正在逐渐体现；信贷方面，一季度天量信贷推升了通胀水平并带动地产等行业短期回暖，二季度收紧了信贷投放的力度，信贷数据整体属于中性水平，企业的融资需求依旧不强，信贷需求主要由居民中长期贷款构成。通胀方面，一季度在食品价格的拉动下CPI一度走高至2.3%，二季度随着蔬菜价格继续下跌、猪肉价格的增幅收窄，CPI逐步降低，从2.3%的同比增速向下跌至1.9%，而PPI方面得益于工业品价格的回升，跌幅持续收窄，整同比依旧为负值。报告期内，国际宏观风云巨变，英国脱欧爆“黑天鹅”加剧了全球金融资产的波动，也影响了美国的加息进程，使得美国年内加息概率大大降低。

央行稳健的货币政策态度明确，一季度末银行及非银机构经历了一季度的MPA考核，使得资金面一度呈现紧张局面，在二季度应对流动性方面都准备更加充分，再加上央行的MLF和公开市场操作的悉心呵护，整体二季度流动性无忧，资金面较为平稳。

债券市场在上半年整体走势震荡。债券市场在年初经济悲观预期和央行宽松的预期下，收益率一度走低，后在经济基本面企稳、通胀预期反弹等利空影响下，行情震荡走弱，收益率有所上行，期限利差先收窄后走扩。进入4月，债券市场迎来了一大波调整，主要有一下两方面原因：一方面在天量信贷刺激下，一季度地产投资、工业增速、通胀水平等指标均显示经济处于小周期复苏当中，使得市场对于经济基本面估计较为乐观；另一方面是各类信用风险事件不断发生，从东特钢、华昱能源等国企央企违约，到铁物资停牌事件，信用风险无序爆发导致公募基金赎回风潮并最终引发市场流动性危机。进入5月后，随着经济基本面的回落和信用风险事件的逐步消化，市场收益率重新回到下行通道。回顾上半年走势，各品种收益率经历了先盘整后调整然后下行的过程。

本基金在操作上保持了较为稳健操作策略，灵活控制组合的杠杆和久期，择机出掉了久期较长和资质较弱的信用债券，适当地缩短了基金的久期，同时以中短久期城投债和资质良好的公司债为主力品种；加强行业研究，挖掘个券阿尔法，为组合进一步增加收益。同时把握了利率债波段交易的机会，进一步增强了组合的收益。

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1.10%，同期业绩比较基准增长率为-0.55%。

4.5 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。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望16年下半年，整体经济下行压力依旧较大，地产投资拐点已至，5月之后房地产市场销售开始放缓，可能意味着本轮房地产热潮顶点已过，预期未来销售下滑将逐渐传导至开工、拿地、投资，房地产作为经济的动力日渐式微；制造业投资、民间投资失速下滑，短期内民间投资融资困难、投资意愿低迷的状况难见改善；而基建投资在下半年成为托底经济最重要的力量，在当前经济环境并不乐观的情形下，积极的财政政策预计加大力度，基建增速有望保持，但仅有基建投资发力独木难支，年内投资高点可能已经过去，基本面仍存在较大的下行压力。工业格局较为稳健，供给侧改革的发力使得企业盈利状况改善，但未来的供给侧改革的力度和需求端的持续性存疑。通胀方面，二季度以来，受菜价回落影响，食品价格的上涨趋势减弱。目前食品项中较为明确的涨价因素仅剩猪肉，涨价因素减少加上食品项整体权重降低，预计CPI整体涨幅有限。6月份CPI已经向下破2，以历史趋势分析，CPI将在三季度逐步走低保持较低水平，预计三季度会成为为全年低点，需要注意的是，受到厄尔尼诺的影响，南方洪涝灾害严重，会对CPI食品项目产生一定正向拉动作用，大宗商品的上涨也有助于拉动PPI环比跌幅继续收窄，需要保持密切关注。

货币政策未来预计会维持稳健的态度，虽然通胀数据三季度大概率低位运行，但四

季度通胀在低基数的影响下仍有反弹动力，因此会对货币政策的宽松形成制约。另外美国加息阴影犹存，年内加息的可能性不能完全排除，而我国央行主动提及频繁降准、降息对汇率贬值的副作用，预计未来一段时间央行主动降准的概率较小，货币政策更多的将会通过公开市场操作维持资金面的稳定性。

上半年债市在风雨中前行，虽受到来自政策面、基本面、资金面、外部环境以及信用风险事件的多重冲击，但债市仍处于牛市行情，尽管期间曾出现调整，但不改牛市格局。展望下半年，基本面来看，地产拐点已现，基建独木难支，经济仍面临较大下行压力；通胀来看，食品价格上行压力减小，大宗商品价格上涨持续性存疑，国内下半年通胀压力无忧；资金面来看，利率走廊初步确立，资金利率在央行呵护下保持平稳；政策面来看，供给侧改革是下半年的主角，无效融资需求有望随之下降，推动无风险利率下行。

因此在操作上，本组合依旧保持较为稳健的风格，灵活调整组合的久期，控制组合的久期，以中高等级信用债作为组合的优选标的，适时把握住利率债波段交易的行情为组合增强收益。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

2016 年上半年度，中国光大银行在中欧新动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对中欧新动力混合型投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——中欧基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

中国光大银行依法对基金管理人——中欧基金管理有限公司编制的“中欧新动力混合型证券投资基金 2016 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§ 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：中欧强盈定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年6月30日
资 产：	
银行存款	2,263,630.67
结算备付金	9,547,587.82
存出保证金	657,482.75
交易性金融资产	953,734,404.50
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	953,734,404.50
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—

衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	—
应收利息	20,735,651.07
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	986,938,756.81
负债和所有者权益	本期末 2016年6月30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	379,799,135.30
应付证券清算款	41,730.61
应付赎回款	—
应付管理人报酬	197,742.68
应付托管费	49,435.68
应付销售服务费	—
应付交易费用	22,151.22
应交税费	—
应付利息	86,448.64
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	85,143.38
负债合计	380,281,787.51
所有者权益:	
实收基金	600,322,136.85

未分配利润	6,334,832.45
所有者权益合计	606,656,969.30
负债和所有者权益总计	986,938,756.81

注：1、报告截止日2016年6月30日， 本基金份额总额600,322,136.85份, 基金份额净值1.011元。

2、本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：中欧强盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年3月25日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期2016年3月25日（基金合同生效日）至2016年6月30日
一、收入	8,104,811.20
1. 利息收入	6,809,270.82
其中：存款利息收入	512,642.91
债券利息收入	5,862,780.07
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	433,847.84
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	599,809.10
其中：股票投资收益	—
基金投资收益	—
债券投资收益	792,074.32
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	-192,265.22
股利收益	—

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	695,731.28
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	—
减：二、费用	1,769,978.75
1. 管理人报酬	637,429.06
2. 托管费	159,357.27
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	20,507.77
5. 利息支出	867,541.27
其中：卖出回购金融资产支出	867,541.27
6. 其他费用	85,143.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6,334,832.45
减：所得税费用	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6,334,832.45

注：本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中欧强盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年3月25日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年3月25日(基金合同生效日)至2016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)	600,322,136.85	—	600,322,136.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,334,832.45	6,334,832.45

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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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)	600,322,136.85	6,334,832.45	606,656,969.30

注：本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

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：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧强盈定期开放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[2016]398号《关于准予中欧强盈定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。经向中国证监会备案，《中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年3月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为600,322,136.85份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧强盈定期开放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，包括国债、金融债、企业债、中期票据、公司债、央行票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可转换债券（包括可分离交易可转债）、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款等固定收益类资产、国债期货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）。本基金投资组合中：债券的投资比例不低于基金

资产的80%。本基金投资于可转换债券和可交换债券的比例不得超过基金资产净值的20%。在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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%，在封闭期，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

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2016年8月24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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧强盈定期开放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2016年3月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间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2016年6月30日的财务状况以及2016年3月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年3月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利

息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(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，应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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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
无。

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(“中欧基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司(“国都证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司(“万盛基业”)	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司(“北京百骏”)	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a (“意大利意联银行”)	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙) (“上海睦亿合伙”)	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 (“中欧盛世资管”)	基金管理人的控股子公司

钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司 （“钱滚滚财富”）	基金管理人的控股子公司
--------------------------------	-------------

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

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.1.4 债券交易

无。

6.4.8.1.5 债券回购交易

无。

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 2016年3月25日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	637,429.06
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：1、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0.40%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 × 0.40% / 当年天数。

2、本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月25日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,357.27

注：1、支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 × 0.10% / 当年天数。

2、本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

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

无。

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	
	2016年3月25日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	2,263,630.67	239,546.29

1、本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

2、本基金合同于2016年3月25日生效，故无上年度可比期间数据。

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（2016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

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,830,042.50元，属于第二层次的余额为951,904,362.00元，无属于第三层次的余额。

(ii) 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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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。

(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（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	953,734,404.50	96.64
	其中：债券	953,734,404.50	96.64
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金	—	—

	融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	11,811,218.49	1.20
7	其他各项资产	21,393,133.82	2.17
8	合计	986,938,756.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无买入及卖出股票的情况。

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	49,710,000.00	8.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	29,904,000.00	4.93
	其中：政策性金融债	29,904,000.00	4.93
4	企业债券	671,005,000.00	110.61

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	200,116,000.00	32.99
7	可转债（可交换债）	2,999,404.50	0.49
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	953,734,404.50	157.21

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1380371	13六安债01	500,000	55,040,000.00	9.07
2	1480182	14信阳债	500,000	54,995,000.00	9.07
3	1380243	13振湘治理债	500,000	53,415,000.00	8.80
4	160006	16付息国债06	500,000	49,710,000.00	8.19
5	1480200	14衢州国资债	400,000	43,580,000.00	7.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T1609	10年期国债 1609	30	-30,108,000.00	-27,200.00	
T1612	10年期国债 1612	2	-1,994,800.00	4,215.22	
公允价值变动总额合计(元)					-22,984.78
国债期货投资本期收益(元)					-192,265.22
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-22,984.78

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	657,482.75

2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	20,735,651.07
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,393,133.82

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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

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
318	1,887,805.46	599,999,009.94	99.95%	323,126.91	0.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基	148,878.63	0.0248%

金		
---	--	--

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年3月25日)基金份额总额	600,322,136.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	600,322,136.85

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
民族证券	1	—	—	—	—	—
英大证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	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. 本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
海通证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	155,614,004.4	63.54%	7,371,100,000	87.17%	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
民族证券	—	—	—	—	—	—
英大证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	89,276,693.46	36.46%	1,085,350,000	12.83%	—	—

中欧基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日