

中欧中小盘股票型证券投资基金 LOF)

[2012] 第一季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一二年四月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的准确性、准确性和完整性承担个别连带责任。

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的准确性、准确性和完整性承担个别连带责任。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金管理人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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:中欧中小盘股票(LOF)(场内简称:中欧小盘)

基金主代码:166006

交易代码:166006

基金运作方式:契约型上市开放式(LOF)

基金合同生效日:2009年12月30日

报告期末基金份额总额:291,956,376.61份

投资目标:本基金主要通过投资于具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业,特别处于加速成长的中小型企业在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增长。

投资策略:本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略,重点投资于预期增长和业绩持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业。同时,结合基金的预测动态调整策略和动量策略,动态调整股票持仓结构。

业绩比较基准:40%×中证中小盘指数收益率+40%×天相小盘指数收益率+20%×中信标普全债指数收益率

风险收益特征:本基金属于股票型基金,本基金投资于高风险、高收益品种,其预期平均风险和收益预期高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金。

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -7,470,731.30

2.本期利润 18,171,224.75

3.加权平均基金份额本期利润 0.0620

4.期末基金份额净值 232,075,454.04

5.期末基金份额总额 0.7949

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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. 所述基金业绩指标不包括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 本报告期基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 8.46% 1.53% 3.64% 1.41% 4.82% 0.12%

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

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2009年12月30日至2012年3月31日

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 215,450,502.37 91.93

其中:股票 215,450,502.37 91.93

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

货币支持证券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

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 17,655,449.05 7.53

6 其他各项资产 1,262,632.90 0.54

7 合计 234,368,584.32 100.00

5.4 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 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 采掘业 - -

C 制造业 16,740,000.00 7.21

C0 食品、饮料 - -

C1 纺织、服装、皮革 - -

C2 木材、家具 - -

C3 造纸、印刷 - -

C4 石油、化学、塑胶、塑料 - -

C5 电子 - -

C6 金属、非金属 - -

C7 机械、设备、仪表 - -

C8 医药、生物制品 - -

C99 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 15,696,329.68 6.76

F 交通运输、仓储业 3,725,000.00 1.61

G 信息技术业 - -

H 批发和零售业 5,540,426.16 2.39

I 金融、保险业 56,964,814.07 24.55

J 房地产业 108,199,393.26 46.62

K 社会服务业 7,780,539.20 3.35

L 传播与文化产业 - -

M 综合类 804,000.00 0.35

D 合计 215,450,502.37 92.84

5.5 报告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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600383 金地集团 3,800,000 22,760,000.00 9.81

2 000002 万科A 2,709,924 22,438,170.72 9.67

3 600048 保利地产 1,740,226 19,645,151.54 8.47

4 000024 招商地产 904,321 18,538,580.50 7.99

5 600067 中国建筑 2,000,000 16,740,000.00 7.21

6 600016 民生银行 2,100,000 13,167,000.00 5.67

7 601668 中信建投 4,100,000 12,505,000.00 5.39

8 600036 招商银行 1,006,026 11,971,709.40 5.16

9 600015 华夏银行 990,000 10,622,700.00 4.58

10 000001 深发展A 660,000 10,368,600.00 4.47

5.6 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债券投资明细

序号 基金代码 基金名称 数量(只) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600199 金种子酒 1,518,391 30,458,923.46 4.39

2 600016 民生银行 3,930,000 24,641,100.00 3.55

3 002304 洋河股份 146,914 21,618,395.10 3.12

4 600036 招商银行 1,710,230 20,351,737.00 2.93

5 601166 兴业银行 1,400,000 18,648,000.00 2.69

6 000157 中信联科 1,757,917 15,223,561.22 2.19

7 002410 广联达 392,298 11,965,089.00 1.72

8 002535 林州重机 826,229 11,087,993.18 1.60

9 000651 格力电器 517,478 10,520,327.74 1.52

10 600104 上汽集团 700,000 10,381,000.00 1.50

5.7 报告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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600199 金种子酒 1,518,391 30,458,923.46 4.39

2 600016 民生银行 3,930,000 24,641,100.00 3.55

3 002304 洋河股份 146,914 21,618,395.10 3.12

4 600036 招商银行 1,710,230 20,351,737.00 2.93

5 601166 兴业银行 1,400,000 18,648,000.00 2.69

6 000157 中信联科 1,757,917 15,223,561.22 2.19

7 002410 广联达 392,298 11,965,089.00 1.72

8 002535 林州重机 826,229 11,087,993.18 1.60

9 000651 格力电器 517,478 10,520,327.74 1.52

10 600104 上汽集团 700,000 10,381,000.00 1.50

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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 030203 03国债02 200,000 20,118,000.00 2.90

2 010203 01国债(3) 158,940 15,895,589.40 2.29

3 - - -

4 - - -

5 - - -

6 - - -

7 - - -

8 - - -

9 - - -

10 - - -

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 代码 证券简称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 030406 金种子权 1,000 1,000.00 0.00

2 010406 01国债(4) 1,000 1,000.00 0.00

3 - - -

4 - - -

5 - - -

6 - - -

7 - - -

8 - - -

9 - - -

10 - - -

5.10 报告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

序号 代码 证券简称 数量(只) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 030406 金种子债 1,000 1,000.00 0.00

2 010406 01国债(4) 1,000 1,000.00 0.00

3 - - -

4 - - -

5 - - -

6 - - -

7 - - -