

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
报告送出日期:二〇一二年七月十九日

§ 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、基金托管人及其员工不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，保证报告不存在虚假记载、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。

报告书中财务资料未经审计。

本基金报告中自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中欧新动力股票型证券投资基金(LOF) (场内简称:中欧动力)

基金主代码 166009

交易代码 166009

基金运作方式 约型上市开放式(LOF)

基金合同生效日 2011年1月20日

报告期末基金份额总额 261,909,113.10份

本基金通过投资于促进中国经济经济发展方式加快转变的新动力行业和上市公司，以求充分分享中国经济未来持续发展的成果并力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的回报。

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，在资产配置方面，自上而下地选股和债券等各类资产的配置比例，在投资品种选择方面，自下而上地选择具有投资价值的证券品种。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种，预期风险和预期收益高于混合型基金、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 中国光大银行股份有限公司

§ 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4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -6,455,361.24

2.本期利润 21,358,954.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0804

4.期末基金份额净值 250,987,409.17

5.期末基金份额净值 0.9583

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率
净值率标准差 ①
业绩比较基准收益率②
准收益率③
准差④

过去三个月 8.82% 0.93% 0.88% 0.83% 7.94% 0.10%

3.2.2 本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

中欧新动力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

2011年2月10日至2012年6月30日

注:本基金管理人于2011年2月10日，建仓期为2011年2月10日至2011年8月9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

本报告中财务资料未经审计。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 225,337,290.27 87.10

2 固定收益投资 10,095,000.00 3.90

3 资产支持证券 - -

4 买入返售金融资产 6,000,000.00 2.32

5 银行存款和结算备付金合计 8,341,506.03 3.22

6 其他各项资产 8,930,563.85 3.45

7 合计 258,704,360.15 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采掘业 - -

3 制造业 - -

4 食品、饮料 - -

5 纺织、服装、皮毛 - -

6 木材、家具 - -

7 纸、造纸、印刷 - -

8 石油、化学、塑胶、塑料 - -

9 电子 - -

10 金属、非金属 - -

11 机械、设备、仪表 - -

12 医药、生物制品 - -

13 其他制造业 - -

14 电力、煤气及水的生产与供应 - -

15 建筑业 3,463,844.66 5.76

16 交通运输、仓储业 8,543,117.70 3.40

17 信息技术业 767,915 7.70,287.45 3.07

18 批发和零售贸易 5,598,064.80 2.23

19 住宿业 236,595 5,313,923.70 2.12

20 金融业 4,626,000.00 1.84

21 上市公司 319,944 4,571,999.76 1.82

22 电子元件 207,000 4,425,660.00 1.76

23 贵州茅台 16,500 3,945,975.00 1.57

24 东华软件 171,886 3,815,869.20 1.52

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国家债券 579,017 21.04

2 行业票据 - -

3 金融债券 10,095,000.00 3.90

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 8,341,506.03 3.22

6 其他各项资产 8,930,563.85 3.45

7 合计 258,704,360.15 100.00

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 03国开02 03国开02 100,000 10,095,000.00 4.02

2 - - - - -

3 - - - - -

4 - - - - -

5 - - - - -

6 - - - - -

7 - - - - -

8 - - - - -

9 - - - - -

10 - - - - -

11 - - - - -

12 - - - - -

13 - - - - -

14 - - - - -

15 - - - - -

16 - - - - -

17 - - - - -

18 - - - - -

19 - - - - -

20 - - - - -

21 - - - - -

22 - - - - -

23 - - - - -

24 - - - - -

25 - - - - -

26 - - - - -

27 - - - - -

28 - - - - -

29 - - - - -

30 - - - - -

31 - - - - -

32 - - - - -

33 - - - - -

34 - - - - -

35 - - - - -

36 - - - - -

37 - - - - -

38 - - - - -

39 - - - - -

40 - - - - -

41 - - - - -

42 - - - - -

43 - - - - -

44 - - - - -

45 - - - - -

46 - - - - -

47 - - - - -

48 - - - - -

49 - - - - -

50 - - - - -

51 - - - - -

52 - - - - -

53 - - - - -

54 - - - - -

55 - - - - -

56 - - - - -

57 - - - - -

58 - - - - -

59 - - - - -

60 - - - - -

61 - - - - -

62 - - - - -

63 - - - - -

64 - - - - -

65 - - - - -

66 - - - - -

67 - - - - -

68 - - - - -

69 - - - - -

70 - - - - -

71 - - - - -

72 - - - - -

73 - - - - -

74 - - - - -

75 - - - - -

76 - - - - -

77 - - - - -