

2012年7月19日 星期四

中欧稳健收益债券型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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责任。

基金托管人对本基金履行了监督职责，对本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等进行复核，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺以诚实守信、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未来的业绩表现。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。

本基金合同于2012年4月1日至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中欧稳健收益债券

基金主代码 166003

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2009年4月12日

报告期末基金份额总额 284,471,559.58份

投资目标 本基金根据宏观经济的运行状况和金融市场的运行趋势，通过自上而下的宏观分析和自下而上的券种精选，动态优化债券组合，力争实现长期稳定的长期资本增值。

投资策略 本基金将充分挖掘基金管理人的研究优势，结合严谨、规范化的基本面研究和积极主动的投资风格，自上而下地进行债券类属配置，债券到期久期配置和期限结构调整；同时综合考虑企业债、公司债、短期融资券的评级、流动性、供求关系、收益率水平等因素，自下而上地选择个券。本基金也将通过运用久期偏离、息差套利、新股认购等策略提高债券组合收益。

业绩比较基准 中信标普全债指数

风险收益特征 本基金属于债券型基金，该证券投资基金中的中低风险收益品种，其长期平均风险收益预期低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。

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

下属两级基金的基金简称 中欧稳健收益债券 A

基金代码 166003

下属两级基金的交易代码 166004

报告期末下属两级基金的份额 67,126,161.10份

总额 217,345,398.48份

§ 3 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)

中欧稳健收益债券 A 1,104,542.99

中欧稳健收益债券 C 1,981,831.58

2,609,090.70 5,018,379.12

3.2 报告期平均基金份额持有人数 0.0378 0.0365

4.期初基金份额总额 70,292,212.28 227,140,728.09

5.期末基金份额总额 1,104,542.99

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、不含汇率升值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所送红利业已计入本期的可供分配利润。

3.2.1 本期报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中欧稳健收益债券 A: 3.70% 0.11% 1.98% 0.04% 1.72% 0.07%

2.中欧稳健收益债券 C: 3.70% 0.11% 1.98% 0.04% 1.72% 0.07%

3.2.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同生效日为2009年4月24日，建仓期为2009年4月24日至2009年10月23日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

2.中欧稳健收益债券 C:

3.2.3 本期报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金合同生效日为2009年4月24日，建仓期为2009年4月24日至2009年10月23日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

4. 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期限 证券从业年限 说明

赖海英 本基金基金经理 2011-7-28 2012-6-13 7年 应用数学专业硕士。历任平安资产管理公司债券交易员、平安财富管理有限公司高级研究员、平安资产管理有限公司债券投资部研究员。2010年9月加入中欧基金管理有限公司。

姚文辉 本基金基金经理、中欧信用增强分级债券型证券投资基金基金经理 2012-6-13 - 5年 国信证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理。2011年5月加入中欧基金管理有限公司，历任中欧信用增强收益债券型证券投资基金基金经理助理，中欧信用增级分级债券型证券投资基金基金经理，中欧信用增强收益债券型证券投资基金基金经理助理，中欧信用增强收益债券型证券投资基金基金经理，中欧信用增强分级债券型证券投资基金基金经理，中欧信用增强分级债券型证券投资基金基金经理。

注:1.任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

2.基金经理的任何变动情况,基金管理人将予以公告。

3.4.2 对交易价格的影响的说明

4.4.1 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.2 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.3 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.4 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.5 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.6 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.7 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.8 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.9 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.10 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.11 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.12 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.13 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.14 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.15 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.16 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.17 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.18 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.19 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.20 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.21 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.22 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.23 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.24 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.25 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.26 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.27 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.28 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.29 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.30 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.31 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.32 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.33 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.34 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.35 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.36 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.37 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.38 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.39 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.40 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.41 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.42 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.43 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.44 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.45 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.46 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.47 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.48 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.49 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.50 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.51 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.52 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.53 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.54 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.55 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.56 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.57 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.58 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.59 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.60 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.61 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.62 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.63 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.64 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.65 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.66 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.67 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.68 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.69 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.70 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.71 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.72 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.73 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.74 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.75 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.76 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.77 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.78 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.79 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.80 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.81 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.82 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.83 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。

4.4.84 任本基金基金经理期间,如果基金合同生效日起即任职,则任日期即为基金合同生效日。