

第二季度报告

2012 第二季度报告

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	6,406,021.70	1.77
B	采掘业	6,388,900.00	1.76
C	制造业	110,780,535.23	30.59
C0	食品、饮料	42,266,981.12	11.67
C1	纺织、服装、皮毛	4,476,762.60	1.24
C2	木材、家具	38,800.00	0.01
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,495,785.28	2.07
C5	电子	2,543,689.00	0.70
C6	金属、非金属	2,733,000.00	2.00

C2	木材、家具	38,800.00	0.01
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,495,785.28	2.07
C5	电子	2,543,689.00	0.70
C6	金属、非金属	7,233,000.00	2.00
C7	机械、设备、仪表	46,701,997.23	12.89
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	23,520.00	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,149,722.65	3.91
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	11,690.00	0.00
G	信息技术业	23,414,578.95	6.46
H	批发和零售贸易	6,429,935.00	1.78
I	金融、保险业	23,931,641.60	6.61
J	房地产业	16,497,899.20	4.56
K	社会服务业	20,663,158.94	5.71
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
		232,454,022.25	64.04

5.3 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股票投资明细					占基金资产净值比例(%)
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	601318	中国平安	403,840	18,471,641.60	5.10
2	600031	三一重工	1,089,957	15,172,201.44	4.19
3	000157	中联重科	1,298,910	14,341,997.30	3.96
4	002157	正邦科技	1,359,920	14,333,556.80	3.95
5	600570	恒生电子	979,762	13,442,334.64	3.71
6	601117	中国石化	2,211,096	12,758,023.92	3.52
7	000896	张裕A	179,923	12,101,620.98	3.34
8	000024	招商地产	367,454	9,013,646.62	2.49
9	002564	张化机	736,657	8,987,215.40	2.48
10	600021	上海电力	1,400,000	7,700,000.00	2.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合				占基金资产净值比例(%)
序号	债券品种	公允价值(元)		
1	国家债券	--	--	--
2	央行票据	--	--	--
3	金融债券	--	--	--
	其中：政策性金融债	--	--	--



7	待摊费用			
8	其他			
9	合计			92,130,765.13

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	11,654,400.00	3.22
2	113002	工行转债	10,899,000.00	3.01
3	110018	国电转债	3,378,598.80	0.93

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000157	中联重科	14,341,997.30	3.96	召开股东大会

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因中国四舍五入原因,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。

单位:份

本报告期初基金份额总额	114,197,426.22
本报告期基金总申购份额	296,702,706.69
减:本报告期基金总赎回份额	13,366,067.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	397,534,065.37

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件

2.《中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金合同》

3.《中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4.《中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.lcfunds.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇一二年七月十九日

3	000157	中联重工	6,306,743	63,256,632.29	3.99
4	600031	三一重工	4,499,724	62,636,158.08	3.96
5	600570	恒生电子	4,308,203	59,108,545.16	3.73
6	600519	贵州茅台	247,100	59,093,965.00	3.73
7	002293	罗莱家纺	764,395	57,023,867.00	3.60
8	600559	老白干酒	1,887,248	53,862,057.92	3.40
9	600021	上海电力	8,427,747	46,352,608.50	2.93
10	002662	恩华药业	1,949,221	45,397,357.50	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,500,000.00
2	应收证券清算款	104,179,564.63
3	应收股利	58,338.00
4	应收利息	81,800.75
5	应收申购款	55,233.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,874,936.96

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000157	中联重工	63,256,632.29	3.99	召开股东大会

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中国内基金五只原因:投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的各项之和与合计可能存在尾差。

	单位:份
本报告期初基金份额总额	2,061,568,542.79
本报告期基金总申购份额	218,769,718.02
减:本报告期基金总赎回份额	33,543,887.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,246,794,373.01