

## 中欧中小盘股票型证券投资基金 LOF)

## [2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十二日

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中欧基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告  
中的财务指标、净值表现和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基金基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12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:338,979,901.58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,特别是处于加速成长期的中小型企业,在  
控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增长。

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,重点投资于沪深两市成长期行业中具有持续成长  
潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业。同时,结合盈  
利预测动态调整策略和定量策略,动态调整股票持仓结构。

业绩比较基准:40%×沪深300指数收益率+40%×天相小盘指数收益+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,属证券投资基金中的高风险、高收益  
品种,其预期平均风险和预期收益率高于混合型基金、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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 3,302,598.02

2.本期利润 63,021,139.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0005

4.期末基金份额净值 321,302,573.56

5.期末基金份额净值 0.9479

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① (%) 净值增长  
率② (%) 业绩比较基  
准收益率③ (%) 收益率差标准差④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 25.58% 5.24% 1.07% 20.34% 0.45%

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如图  
2009年12月30日至2012年12月31日

注:本基金合同生效日为2009年12月30日,建仓期为2009年12月30日至2010年6月29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

4.1 基金经理或基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

王海 本基金基  
金经理 2012-1-18 - 10年 工商管理学硕士,历任通用技术  
集团投资管理有限公司(原上海  
中技投资顾问有限公司)项目经理  
、高级研究员、投资部副总经  
理,中海基金管理有限公司专  
户投资经理助理、专户投资经理。  
2009年3月加入中欧基金管理  
有限公司,历任行业研究员、股票  
投资经理助理、中欧医药主题灵活  
配置混合型证券投资基金  
(LOF)基金经理,现任中欧中  
小盘股票型证券投资基金  
(LOF)  
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,任职日期为基金合同生效之日。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遵守信守情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,并以其最  
诚信、勤勉尽责的态度,履行了诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的义务,实现了基金资产的保  
值增值,并不存在损害基金持有人利益的行为,基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规  
定,未违法、违规、违纪。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,并以其最  
诚信、勤勉尽责的态度,履行了诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的义务,实现了基金资产的保  
值增值,并不存在损害基金持有人利益的行为,基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规  
定,未违法、违规、违纪。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,并以其最  
诚信、勤勉尽责的态度,履行了诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的义务,实现了基金资产的保  
值增值,并不存在损害基金持有人利益的行为,基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规  
定,未违法、违规、违纪。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略及运作分析

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,并以其最  
诚信、勤勉尽责的态度,履行了诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的义务,实现了基金资产的保  
值增值,并不存在损害基金持有人利益的行为,基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规  
定,未违法、违规、违纪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本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基金基  
金的招募说明书。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简单展望

对于宏观经济而言,在不考虑政策调整的前提下,本基金对2013年的经济趋势没有市场那么乐观。

4.6 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

## 中欧稳健收益债券型证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十二日

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中欧基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月18日复核了本报告中的  
财务指标、净值表现和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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

## § 3 投资组合报告

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 4 基金资产组合情况

## § 5 投资组合报告

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 6 开放式基金份额变动

## § 7 备查文件目录

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 8 备查文件

## § 9 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 10 备查文件

## § 11 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 12 备查文件

## § 13 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 14 备查文件

## § 15 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 16 备查文件

## § 17 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

A股市场而言,预期在2013年全年可能走出大震荡格局,尤其是前三季度。预期各种投资机会很多。

本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基  
金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 18 备查文件

## § 19 投资组合报告附注

当次,从次次最终结果来看,为了保持经济稳定发展,政府可能会有很多政策调整措施推出。在考虑了  
这些措施后,我国经济总体保持平稳发展的可能性很大,尤其是前三季度。预期各种