中欧稳健收益债券型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31日

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:二〇一一年三月三十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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24日	
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	
报告期末基金份额总额	839,904,321.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C
下属分级基金的交易代码	166003	166004
报告期末下属分级基金的份额总额	319,579,932.48份	520,324,389.39份

2.2 基金产品说明

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个券精选,动态优化债券组合,力争实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金将充分发挥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、债券组合久期配置和期限结构配置;同时,综合考量企业债、公司债、短期融资券的信用评级、流动性、供求关系、收益率水平等因素,自下而上地精选个券。本基金也将通过运用久期偏离、息差套利、新股认购等动态增强收益策略提高投资组合收益。
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,属证券投资基金中的中低风险收益品种,其长期平均风险和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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	尹东
	联系电话	021-68609600	010-67595003
	电子邮箱	liyihai@lcfunds.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	010-67595096
传真		021-33830351	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lcfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年		2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C
本期已实现收益	19,527,446.63	21,372,633.06	5,621,015.15	12,832,816.31
本期利润	19,531,482.92	22,037,498.39	7,277,753.39	17,784,088.67
加权平均基金份额本期利润	0.0749	0.0649	0.0441	0.0337
本期基金份额净值增长率	8.81%	8.35%	4.51%	4.18%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末		2009年末	
	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0106	0.0053	0.0016	-0.0006
期末基金资产净值	329,877,070.05	534,327,518.23	71,881,428.29	173,901,770.26
期末基金份额净值	1.0322	1.0269	1.0198	1.0175

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额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 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

中欧稳健收益债券A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.16%	0.23%	-1.77%	0.10%	1.93%	0.13%
过去六个月	2.56%	0.18%	-0.92%	0.08%	3.48%	0.10%
过去一年	8.81%	0.15%	2.00%	0.07%	6.81%	0.08%
自基金合同生效起至今	13.71%	0.14%	2.41%	0.06%	11.30%	0.08%

中欧稳健收益债券C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.06%	0.23%	-1.77%	0.10%	1.83%	0.13%
过去六个月	2.33%	0.18%	-0.92%	0.08%	3.25%	0.10%
过去一年	8.35%	0.15%	2.00%	0.07%	6.35%	0.08%
自基金合同生效起至今	12.88%	0.14%	2.41%	0.06%	10.47%	0.08%

注:本基金大类资产的投资比例为:固定收益类资产(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券,可转换债券(含可分离债)、资产支持证券和货币市场工具等)占基金资产的比例不低于80%,股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于20%,其中权证资产比例占基金净值的比例不高于3%,基金保留的现金以及投资于剩余期限在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。根据本基金的大类资产投资标的及具体比例范围,我们选择将本基金主要投资持有的大类资产即债券资产的市场表现作为基金业绩的参照。在债券资产表现的代表指数选择上,我们选择市场上广泛采用的中信标普全债指数。

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

中欧稳健收益债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

中欧稳健收益债券A

(2009年4月24日至2010年12月31日)

中欧稳健收益债券C

(2009年4月24日至2010年12月31日)

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本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧稳健收益债券型证券投资基金

每年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

中欧稳健收益债券A

中欧稳健收益债券C

注:本基金合同生效日为2009年4月24日。2009年度数据为2009年4月24日至2009年12月31日的数据。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、中欧稳健收益债券A

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0.766	16,440,556.09	4,272,068.65	20,712,624.74	–
2009	0.250	1,851,799.82	169,834.94	2,021,634.76	–
合计	1.016	18,292,355.91	4,441,903.59	22,734,259.50	–

2、中欧稳健收益债券C

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0.750	19,786,780.29	3,906,779.96	23,693,560.25	–
2009	0.240	5,071,482.88	274,749.87	5,346,232.75	–
合计	0.990	24,858,263.17	4,181,529.83	29,039,793.00	–

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会《证监基字[2006]102号文》批准,于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券有限责任公司、平顶山煤业(集团)有限责任公司,注册资本为1.2亿元人民币。截至2010年12月31日,本基金管理人共管理7只开放式基金,即中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧价值发现股票型证券投资基金、中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)、中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)和中欧增强回报债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林钟斌	本基金基金经理,中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,研究部总监	2009-12-15	–	11年	世界经济学硕士。历任招商证券研究发展中心研究员、行业研究主管,融通基金管理有限公司研究策划部总监助理。2009年6月加入中欧基金管理有限公司,任研究部副总监、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、研究部总监、中欧沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。
聂曙光	本基金基金经理,中欧增强回报债券型证券投资基金基金经理	2010-05-10	–	6年	企业管理硕士。历任南京银行债券分析师,兴业银行上海分行债券投资经理。2009年9月加入中欧基金管理有限公司,任债券研究员、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理(2009年9月21日至2010年5月9日)、基金经理、中欧增强回报债券型证券投资基金基金经理。
赖海英	本基金基金经理助理、中欧增强回报债券型证券投资基金基金经理助理	2010-09-30	–	6年	应用数学专业硕士。历任平安资产管理公司债券交割清算、汇丰晋信基金管理有限公司交易员、金盛人寿保险有限公司投资经理。2010年9月加入中欧基金管理有限公司,任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理,中欧增强回报债券型证券投资基金基金经理助理。

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职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从研究分析、投资决策、交易执行等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至报告期末,本基金管理人旗下暂无与本基金投资风格相似的其他投资组合,因此无法进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年1季度宏观经济回升,信贷高速增长,通胀预期出现波动。但1月和2月份CPI低于预期,市场再度调低通胀预期,带动收益率曲线下滑。二季度市场对于经济增长的担忧明显增加,投资者风险偏好降低,权益类资产被市场抛弃,而固定收益资产受到追捧。三季度中国经济探底回升,股票和转债市场出现明显上涨。四季度在加息及流动性收缩的影响下,债券市场收益率大幅上行。上半年我们在债券投资上采取了积极的策略,提高久期,并增加信用债配置,并及时降低了可转债的持仓比例。下半年我们在债券投资上采取了相对谨慎的策略,逐步降低组合久期,权益类仓位有所上升,但在基金规模快速上升期,权益仓位未能及时增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中欧稳健收益A类份额净值增长率为8.81%,C类份额净值增长率为8.35%,同期业绩比较基准增长率为2%,基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年发达经济体复苏趋势进一步确立,但中国经济在调控压力下,增速有所回落,预计9%左右,同时通胀现实压力显现,预计全年通胀水平升至4%以上。货币政策将逐步由去年的过度宽松向中性回归,预计全年加息3次左右。在通胀压力下,预计上半年债券收益率曲线将上升50-75个基点左右,但随着发行利率上升,高票息债券将逐步体现较好的保护作用和配置价值。如果上半年政策力度偏大,通胀得到控制,债券市场将在下半年迎来重大投资机遇。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定,有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理,成员包括总经理、督察长、投资总监,基金运营部总监,监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:基金日常估值由基金管理人进行,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以XBRL形式报给基金托管人,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金向A类份额持有人进行收益分配,权益登记日及除权日为2010年1月18日,每10份基金份额派发红利0.016元,合计发放红利261,236.87元,其中现金分红为250,419.94元,红利再投资为10,816.93元。

本基金向全体份额持有人进行利润分配,权益登记日及除权日为2010年6月29日。本基金A类每10份基金份额派发红利0.400元,合计发放红利8,494,509.61元,其中现金分红为6,237,852.87元,红利再投资为2,256,656.74元。C类每10份派发红利0.400元,合计发放红利5,970,688.60元,其中现金分红为5,135,173.39元,红利再投资为835,515.21元。

本基金向全体份额持有人进行利润分配,权益登记日及除权日为2010年12月20日。本基金A类每10份基金份额派发红利0.350元,合计发放红利11,956,878.26元,其中现金分红为9,952,283.28元,红利再投资为2,004,594.98元。C类每10份派发红利0.350元,合计发放红利17,722,871.65元,其中现金分红为14,651,606.90元,红利再投资为3,071,264.75元。

本基金本年度收益分配满足法律法规的规定及基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,中欧稳健收益债券A实施利润分配的金额为20,712,624.74元。

报告期内,中欧稳健收益债券C实施利润分配的金额为23,693,560.25元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中欧稳健收益债券型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:		
银行存款	120,185,353.67	5,974,888.56
结算备付金	17,664,663.02	1,125,620.43
存出保证金	–	152,082.25
交易性金融资产	803,132,036.85	278,191,667.54
其中:股票投资	96,362,160.71	19,725,741.54
基金投资	–	–
债券投资	706,769,876.14	258,465,926.00
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	3,329,500.00	6,319,470.58
应收利息	11,999,187.02	2,034,133.13
应收股利	–	–
应收申购款	4,793,101.15	4,108,465.57
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	961,103,841.71	297,906,328.06
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	80,000,000.00	50,000,000.00
应付证券清算款	9,969,594.51	–
应付赎回款	3,605,061.76	1,233,711.18
应付管理人报酬	456,323.75	141,266.97
应付托管费	152,107.92	47,089.01
应付销售服务费	183,905.15	68,277.42
应付交易费用	170,611.01	4,059.66
应交税费	2,005,478.87	296,505.60
应付利息	–	6,291.66
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	356,170.46	325,928.01
负债合计	96,899,253.43	52,123,129.51
所有者权益:		
实收基金	839,904,321.87	241,402,837.31
未分配利润	24,300,266.41	4,380,361.24
所有者权益合计	864,204,588.28	245,783,198.55
负债和所有者权益总计	961,103,841.71	297,906,328.06

注:1、报告截止日2010年12月31日,A类基金份额净值1.0322元,基金份额总额319,579,932.48份;C类基金份额净值1.0269元,基金份额总额520,324,389.39份。

2、比较财务报表的实际编制期间为2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:中欧稳健收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日
一、收入	52,532,810.44	30,981,997.59
1.利息收入	23,097,611.48	8,591,159.91
其中:存款利息收入	919,699.52	2,446,202.65
债券利息收入	21,844,519.46	5,850,683.16
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	333,392.50	294,274.10
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	28,588,144.67	15,687,569.23
其中:股票投资收益	16,551,916.21	142,158.99
基金投资收益	–	–
债券投资收益	12,015,692.21	15,124,687.11
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	344,970.60
股利收益	20,536.25	75,752.53
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	668,901.62	6,608,010.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	178,152.67	95,257.85
减:二、费用	10,963,829.13	5,920,155.53
1.管理人报酬	3,842,972.64	2,906,402.12
2.托管费	1,280,990.95	968,800.78
3.销售服务费	1,460,710.75	1,478,313.47
4.交易费用	516,831.98	21,273.23
5.利息支出	3,428,541.36	178,662.50
其中:卖出回购金融资产支出	3,428,541.36	178,662.50
6.其他费用	433,781.45	366,703.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	41,568,981.31	25,061,842.06
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列	41,568,981.31	25,061,842.06

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中欧稳健收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	241,402,837.31	4,380,361.24	245,783,198.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	41,568,981.31	41,568,981.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	598,501,484.56	22,757,108.85	621,258,593.41
其中:1.基金申购款	3,208,158,569.44	192,322,509.27	3,400,481,078.71
2.基金赎回款	-2,609,657,084.88	-169,565,400.42	-2,779,222,485.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-44,406,184.99	-44,406,184.99
五、期末所有者权益(基金净值)	839,904,321.87	24,300,266.41	864,204,588.28
项目	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,152,411,566.06	–	2,152,411,566.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	25,061,842.06	25,061,842.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,911,008,728.75	-13,313,613.31	-1,924,322,342.06
其中:1.基金申购款	74,440,951.47	1,085,749.77	75,526,701.24
2.基金赎回款	-1,985,449,680.22	-14,399,363.08	-1,999,849,043.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-7,367,867.51	-7,367,867.51
五、期末所有者权益(基金净值)	241,402,837.31	4,380,361.24	245,783,198.55

报表附注为财务报表的组成部分

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:刘建平,主管会计工作负责人:黄桦,会计机构负责人:丁驿雯

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧稳健收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]第208号《关于核准中欧稳健收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,151,799,709.57元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第078号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》于2009年4月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,152,411,566.06份基金份额,其中认购资金利息折合611,856.49份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和《中欧稳健收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据基金手续费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申(认)购、赎回时收取申(认)购、赎回费用的,称为A类;不收取申(认)购、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,各类别基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:固定收益类资产(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券,可转换债券(含可分离债)、资产支持证券和货币市场工具等)占基金资产的比例不低于80%,股票、权证等非固定收益类资产占基金资产的比例不高于20%,其中权证资产占基金资产净值的比例不高于3%。基金保留的现金以及投资于剩余期限在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。其中股票仅指新股,包括IPO和增发新股;权证指认购分离交易可转债所获得的权证。本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2011年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
国都证券有限责任公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利意联银行股份合作公司(Unione di Banche Italiane S.c.p.a.,简称UBI)	基金管理人的股东
平顶山煤业(集团)有限责任公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	12,941,777.30	5.68%	201,936.31	73.53%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国都证券	151,762,030.59	9.02%	–	–

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	10,515.38	5.46%	2,065.97	1.26%
关联方名称	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	164.09	73.04%	164.09	73.04%

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,842,972.64	2,906,402.12
其中:支付销售机构的客户维护费	503,068.05	529,268.57

注:支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,280,990.95	968,800.78

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C	合计
中欧基金	–	174,101.00	174,101.00
中国建设银行	–	514,567.30	514,567.30
国都证券	–	4,379.16	4,379.16
合计	–	693,047.46	693,047.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C	合计
中欧基金	–	163,778.10	163,778.10
中国建设银行	–	1,124,331.03	1,124,331.03
国都证券	–	56,608.10	56,608.10
合计	–	1,344,717.23	1,344,717.23

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中欧基金管理有限公司,再由中欧基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.4 % / 当年天数。

本基金A类基金份额不收取销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	20,515,402.74	–	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人不存在运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末以及上年度末本基金管理人之外的其他关联方不存在投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	120,185,353.67	818,866.12	5,974,888.56	2,440,589.46

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日				
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
国都证券	1080039	10临沂城投债	银行间	100,000	10,000,000.00
国都证券	1080034	10合肥高新债	银行间	200,000	20,000,000.00
国都证券	122918	10阜阳债	上交所	100,000	10,000,000.00
国都证券	1080009	10泰州债	银行间	200,000	20,000,000.00
关联方名称	上年度可比期间 2009年4月24日(基金合同生效日)至2009年12月31日				
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
–	–	–	–	–	–

7.4.9 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-01-07	新股网上申购	5.99	5.99	4,000	23,960.00	23,960.00	–
002535	林州重机	2010-12-31	2011-01-11	新股网上申购	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	–
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	新股网下申购	18.00	27.90	51,501	927,018.00	1,436,877.90	–
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	新股网下申购	35.00	47.19	46,540	1,628,900.00	2,196,222.60	–

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因上市公司未能按交易所要求按时披露重要信息、公布的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额80,000,000.00元,于2011年1月4日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为431,087,036.85元,属于第二层级的余额为372,045,000.00元,无属于第三层级的余额(2009年12月31日:第一层级145,643,402.54元,第二层级132,548,265.00元,无第三层级)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	96,362,160.71	10.03
	其中:股票	96,362,160.71	10.03
2	固定收益投资	706,769,876.14	73.54
	其中:债券	706,769,876.14	73.54
	资产支持证券	–	–
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	137,850,016.69	14.34
6	其他各项资产	20,121,788.17	2.09
7	合计	961,103,841.71	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	23,960.00	0.00
B	采掘业	–	–
C	制造业	34,770,523.07	4.02
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	823,500.00	0.10
C5	电子	17,876,196.20	2.07
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	12,379,726.87	1.43
C8	医药、生物制品	3,691,100.00	0.43
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,039,000.00	3.94
E	建筑业	905,999.64	0.10
F	交通运输、仓储业	23,258,508.00	2.69
G	信息技术业	960,300.00	0.11
H	批发和零售贸易	45,630.00	0.01
I	金融、保险业	18,240.00	0.00
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	2,340,000.00	0.27
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	96,362,160.71	11.15

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600795	国电电力	10,000,000	30,600,000.00	3.54
2	601018	宁波港	7,454,650	23,258,508.00	2.69
3	002475	立讯精密	100,000	5,597,000.00	0.65
4	300124	汇川技术	33,149	4,636,882.12	0.54
5	300118	东方日升	60,000	3,642,000.00	0.42
6	002479	富春环保	100,000	3,439,000.00	0.40
7	002484	江海股份	77,951	2,393,095.70	0.28
8	002469	三维工程	30,000	2,340,000.00	0.27
9	300128	锦富新材	46,540	2,196,222.60	0.25
10	300119	瑞普生物	30,000	2,115,900.00	0.24

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	163,872,218.07	66.67
2	600795	国电电力	31,900,000.00	12.98
3	601018	宁波港	27,582,205.00	11.22
4	600859	王府井	10,869,371.10	4.42
5	300118	东方日升	3,364,578.00	1.37
6	002479	富春环保	2,978,816.40	1.21
7	002475	立讯精密	2,959,372.80	1.20
8	300124	汇川技术	2,382,750.12	0.97
9	002422	科伦药业	2,269,309.28	0.92
10	300119	瑞普生物	2,161,320.00	0.88
11	300115	长盈精密	1,633,355.00	0.66
12	300128	锦富新材	1,628,900.00	0.66
13	002399	海普瑞	1,625,336.00	0.66
14	002484	江海股份	1,597,995.50	0.65
15	002117	东港股份	1,483,597.50	0.60
16	002480	新筑股份	1,445,634.00	0.59
17	002472	双环传动	1,250,928.00	0.51
18	300102	乾照光电	1,216,755.00	0.50
19	002469	三维工程	1,170,754.65	0.48
20	002367	康力电梯	1,085,707.30	0.44

注:买入金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	167,788,790.51	68.27
2	600859	王府井	10,900,631.32	4.44
3	601668	中国建筑	6,776,571.95	2.76
4	601107	四川成渝	3,055,610.00	1.24
5	300102	乾照光电	2,425,357.52	0.99
6	002422	科伦药业	2,257,094.15	0.92
7	002117	东港股份	1,744,562.20	0.71
8	002466	天齐锂业	1,720,921.19	0.70
9	601788	光大证券	1,689,921.90	0.69
10	002340	格林美	1,406,978.90	0.57
11	002399	海普瑞	1,405,696.00	0.57
12	002353	杰瑞股份	1,317,451.50	0.54
13	002328	新朋股份	1,274,790.39	0.52
14	300118	东方日升	1,217,132.30	0.50
15	300114	中航电测	1,088,557.00	0.44
16	002367	康力电梯	948,399.04	0.39
17	002460	赣锋锂业	933,309.65	0.38
18	002278	神开股份	908,114.00	0.37
19	002314	雅致股份	861,296.99	0.35
20	300048	合康变频	765,057.45	0.31

注:卖出金额均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	283,644,520.42
卖出股票的收入(成交)总额	227,968,620.99

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	19,686,000.00	2.28
	其中:政策性金融债	19,686,000.00	2.28
4	企业债券	391,027,958.30	45.25
5	企业短期融资券	209,669,000.00	24.26
6	可转债	86,386,917.84	10.00
7	其他	–	–
8	合计	706,769,876.14	81.78

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	098043	09盐国资债	500,000	50,745,000.00	5.87
2	1081329	10丝绸CP01	500,000	49,830,000.00	5.77
3	1080019	10贵投债	400,000	40,944,000.00	4.74
4	1081427	10本营钢CP02	400,000	39,976,000.00	4.63
5	1081334	10苏恒力CP01	400,000	39,804,000.00	4.61

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	3,329,500.00
3	应收股利	–
4	应收利息	11,999,187.02
5	应收申购款	4,793,101.15
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	20,121,788.17

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	19,774,800.00	2.29
2	125709	唐钢转债	10,952,000.00	1.27
3	110003	新钢转债	10,370,700.00	1.20
4	110007	博汇转债	9,467,476.80	1.10
5	110009	双良转债	4,451,042.00	0.52
6	110078	澄星转债	3,616,589.20	0.42
7	125731	美丰转债	1,122,954.84	0.13

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300128	锦富新材	2,196,222.60	0.25	新股网下申购

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因,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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧稳健收益债券A	2,795	114,339.87	198,825,994.47	62.21%	120,753,938.01	37.79%
中欧稳健收益债券C	5,561	93,566.69	124,157,621.86	23.86%	396,166,767.53	76.14%
合计	8,356	100,515.12	322,983,616.33	38.45%	516,920,705.54	61.55%

2.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	中欧稳健收益债券A	925.69	0.0003%
	中欧稳健收益债券C	18,459.35	0.0035%
	合计	19,385.04	0.0023%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中欧稳健收益债券A	中欧稳健收益债券C
基金合同生效日(2009年4月24日)基金份额总额	270,793,844.22	1,881,617,721.84
本报告期期初基金份额总额	70,488,767.48	170,914,069.83
本报告期基金总申购份额	776,346,631.96	2,431,811,937.48
减:本报告期基金总赎回份额	527,255,466.96	2,082,401,617.92
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	319,579,932.48	520,324,389.39

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人于2010年3月3日发布公告,经中欧基金管理有限公司董事会审议通过,同意陈鹏先生因个人原因辞去公司副总经理职务,陈鹏先生于2010年3月1日起不再担任公司副总经理。

本报告期内,基金管理人于2010年4月24日发布公告,经中欧基金管理有限公司董事会审议通过,同意常喆先生因国都证券有限责任公司工作安排原因辞去公司董事长职务,常喆先生自2010年4月26日起,不再担任公司董事长职务;自2010年4月26日起至公司新任董事长到任止,由公司总经理刘建平先生代为履行公司董事长职责,代为履行职责的时间不超过90日。

本报告期内,基金管理人于2010年5月11日发布公告,经中欧基金管理有限公司研究决定,聘任聂曙光先生为中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理,与现任基金经理林钟斌先生共同管理该基金。

本报告期内,基金管理人于2010年7月28日发布公告,经中欧基金管理有限公司董事会审议通过,选举唐步先生为公司董事长。唐步先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2010]977号文)。

本报告期内,基金管理人于2010年8月5日发布公告,经中欧基金管理有限公司董事会审议通过,同意聘任徐红光先生为公司副总经理。徐红光先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2010]1031号文)。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

截至本报告披露日,本基金托管人的专门托管部门的重大人事变动如下:

本基金托管人2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2011]115号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人2011年1月31日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度支付给所聘任的会计师事务所55,800.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	183,572,824.93	80.53%	156,034.71	81.08%	–
安信证券	1	22,523,406.81	9.88%	18,300.38	9.51%	–
国都证券	1	12,941,777.30	5.68%	10,515.38	5.46%	–
中邮证券	1	8,930,611.95	3.92%	7,590.96	3.94%	–

注:1、根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2、本报告期内,本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	349,571,354.65	20.77%	6,164,900,000.00	53.77%	–	–
安信证券	336,342,136.77	19.98%	–	–	–	–
国都证券	151,762,030.59	9.02%	–	–	–	–
中邮证券	845,551,557.36	50.23%	5,300,900,000.00	46.23%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2010年1月29日,本基金托管人发布第二届董事会第二十八次会议决议公告,决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2、2010年5月13日,本基金托管人发布关于高级管理人员辞任的公告,范一飞先生已提出辞呈,辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

3、2010年6月21日,本基金托管人发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

4、2010年7月1日,本基金托管人发布2009年度A股分红派息实施公告,每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

5、2010年9月15日,本基金托管人发布公告,张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长,谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

6、2010年11月2日,本基金托管人发布2010年度A股配股发行公告。

中欧基金管理有限公司
二〇一一年三月三十日