

## 中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)

## 2012第一季度报告

2012年3月31日

基金管理人:中欧基金管理有限公司  
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一二年四月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及监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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中邮消费金融银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

## §2 基金产品概况

基金名称	中欧中小盘股票(LOF)(场内简称:中欧小盘)
基金代码	166006
交易代码	166006
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金的合同生效日	2009年12月6日
报告期末基金资产总额	291,956,376.61元

投资目标 本基金主要投资于具有良好成长性的中小盘股票,特别是一些处于高速增长期中的行业,在控制风险的前提下,力求为基金份额持有人获得稳健的资本增值。

投资策略 本基金精选在沪深300指数以下的股票配置策略,“个股精选策略”是本基金投资于股票市场的核心策略,通过精选个股,在控制风险的前提下,力求为基金份额持有人获得稳健的资本增值。

业绩比较基准 40%×沪深300指数+60%×大中小股票指数+2%×货币市场基金指数

风险收益特征 本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、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 中国邮政储蓄银行股份有限公司

## §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1月1日-2012年3月31日)	
1.本期已实现收益		-7,470,731.30
2.本期利润		18,171,224.75
3.期初至报告期利润累计金额		0.0620
4.期末基金资产净值		232,075,454.04
5.期末基金份额净值		0.7949

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,计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值是指基金份额净资产除以基金份额的余额。

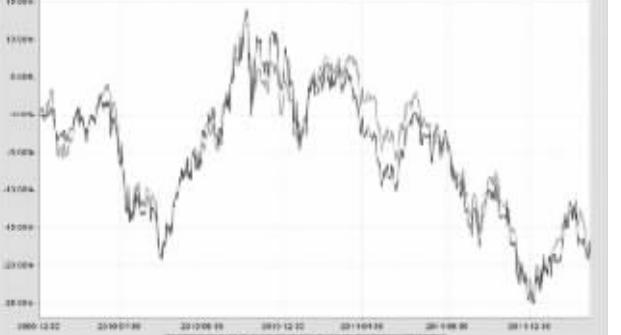
3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率为4.46%,同期业绩比较基准收益率为3.64%。

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长变动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图

2009年12月30日至2012年3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(基金经理小组)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	
				辞职日期	离任日期
沈洋	本基金基金经理	2009-12-30	2012-1-18	8年	
王海	本基金基金经理 中欧基金管理有限公司 中欧基金管理有限公司 中欧基金管理有限公司 中欧基金管理有限公司	2012-1-18	-	9年	

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.证券从业人员的回避从行业协会从业人员及基金管理人从业人员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

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 报告期内基金的经营业绩说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.7 报告期内基金的费用情况说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.8 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》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 报告期内基金的现金流量情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.10 报告期内基金的资产配置情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 报告期内基金的会计政策、会计估计和差错更正的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.12 报告期内基金的估值政策

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.14 报告期内基金的费用调整情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 报告期内基金的关联交易事项

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.16 报告期内基金的内部控制制度

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.18 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.20 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.22 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.24 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.25 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.26 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.27 报告期内基金的年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.28 报告期内基金的半年度报告

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于市场,取信于社会的原则,严格履行基金托管人职责,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人严格遵守有关法规和基金合同的约定,无违法违规行为,不存在损害基金份额持有人利益的行为。