

# 中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 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：二〇一一年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	35
7.7 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.....	35
7.8 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.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36

8 基金份额持有人信息.....	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	37
9 开放式基金份额变动.....	37
10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
11 备查文件目录.....	41
11.1 备查文件目录.....	41
11.2 存放地点.....	41
11.3 查阅方式.....	42

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中欧新蓝筹混合
基金主代码	166002
交易代码	166002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月25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	106,698,074.48份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主要投资于未来持续成长能力强的潜力公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的投资风格以积极的股票选择策略为特点，注重挖掘被低估的未来成长性好的企业。资产配置方面，本基金将会综合评估宏观经济、市场、资金等各方面情况，及时、积极、充分地调整资产配置结构。股票选择层面，本基金将通过综合采用定量分析、定性分析和实地调研等研究方法，自下而上、精选个股，综合衡量股票的投资价值和风险因素，注重买入股票的安全边际，中长期投资成长潜力大的个股，以充分分享中国经济高速成长的成果。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+35%×上证国债指数+5%×一年期定期存款利率
风险收益特征	本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于风险中等，追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。

### 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
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路 66号东亚银行金融大厦8层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路 66号东亚银行金融大厦8层	北京市西城区闹市口大街1 号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		唐步	郭树清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	www.lcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区金融大街27号投 资广场22-23层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	-2,189,871.67
本期利润	-5,308,462.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0519

本期加权平均净值利润率	-5.55%
本期基金份额净值增长率	-5.68%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-8,640,117.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0810
期末基金资产净值	98,057,956.93
期末基金份额净值	0.9190
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	48.81%

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、上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

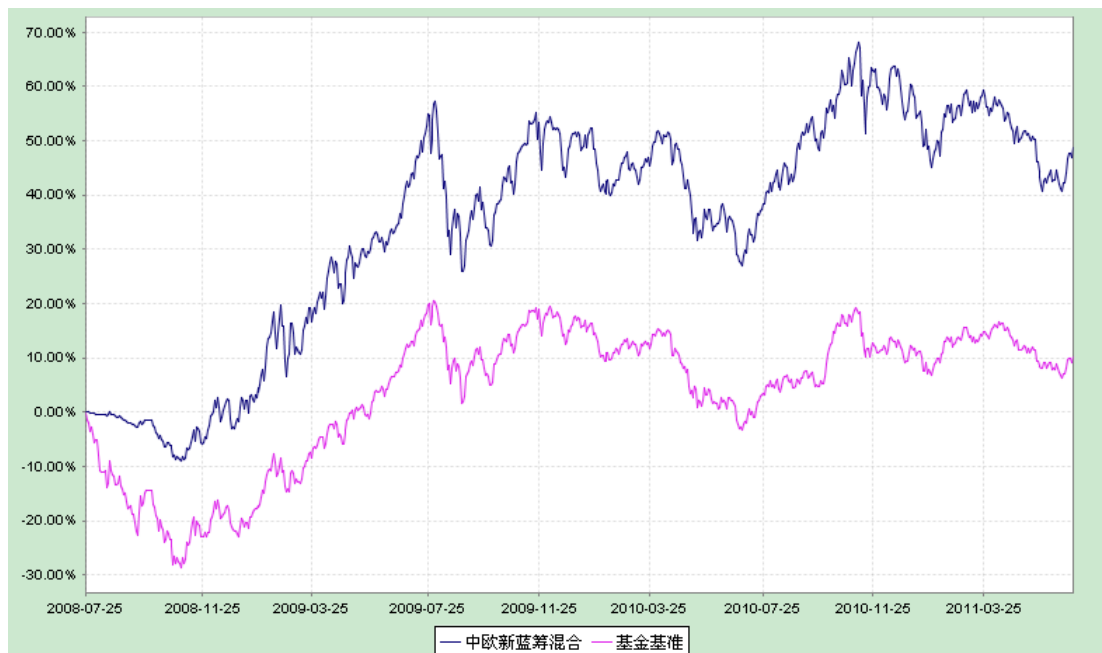
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.49%	0.89%	0.96%	0.72%	3.53%	0.17%
过去三个月	-3.79%	0.88%	-3.00%	0.66%	-0.79%	0.22%
过去六个月	-5.68%	1.03%	-0.72%	0.74%	-4.96%	0.29%
过去一年	15.46%	1.17%	12.55%	0.84%	2.91%	0.33%
自基金合同生效起至今	48.81%	1.32%	10.04%	1.19%	38.77%	0.13%

注：本基金大类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的 40%-80%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-60%，其中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三个大类资产即股票资产的市场表现、债券资产的市场表现和现金收益组合成比较基准表现作为基金业绩的参照。在大类资产表现的代表指数选择上，股票部分我们选择在市场上有广泛认同度十分具有代表性的沪深 300 指数，债券部分我们选择市场上广泛采用的上证国债指数，现金部分采用税后一年期定期存款利率。比较基准中股票和债券类资产的权重分配以基金该类资产可投资比例范围的中值作为基本参考，最终具体比例为股票部分 60%，债券部分 35%，现金部分则以基金现金（类现金）持有比例下限要求的 5%作为权重。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

#### 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

中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金  
 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  
 (2008 年 7 月 25 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2008 年 7 月 25 日，建仓期为 2008 年 7 月 25 日至 2009 年 1 月 24 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 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 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）、中欧增强回报债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）和中欧鼎力分级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		
沈洋	本基金基金经理、中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理	2009-06-24	2011-05-23	7 年	金融管理硕士。历任天相投资顾问有限公司研究员，红塔证券股份有限公司研究员，2006 年 9 月加入中欧基金管理有限公司，任研究员、高级研究员、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、基金经理，中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理。
周蔚文	本基金基金经理，投资总监	2011-05-23	-	11 年	管理学硕士。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理。2011 年 1 月加入中欧基金管理有限公司，任投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陆琪	本基金基金经理助理	2010-09-01	2011-04-29	5 年	管理工程学学士。历任光大保德信基金有限公司产品经理、信诚基金有限公司产品开发经理、瑞银证券有限责任公司投资咨询顾问。2009 年 11 月加入中欧基金管理有限公司，任研究员、中欧新蓝筹灵活配置混合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合规守信情况的说明

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、《中欧新蓝筹灵活配置混合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

2011 年上半年，国内经济呈现 CPI 持续上升、工业增加值增速平稳回落的态势，为抑制通胀，央行持续提高利率和存款准备金率，而房价仍维持高位。从国外来看，希腊再次爆发债务危机，西班牙、意大利等欧洲大国债务也呈恶化趋势，美国主权评级下调引发市场恐慌。报告期内本基金的股票资产配置经历了淘汰高估值且业绩前景不确定的中小股票，增加低估值股票，以及中小股票大跌之后寻找优质成长股的两个阶段，但由于市场呈现普跌趋势特别是中小个股呈现快速回落趋势使得基金业绩仍跑输基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为-5.68%，同期业绩比较基准增长率为-0.72%，基金投资收益低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

展望 2011 年下半年，从国际经济看，由于欧债危机和美国主权评级下调引发市场暴跌，造成了巨大恐慌情绪，预计短期仍将对市场构成冲击，但本次债务危机和 2008 年次贷危机有着显著的区别。目前欧美国家房价在低位，同时企业与家庭也经历了 3 年的去杠杆化，因

此冲击虽急促但对经济的冲击不会有 2008 年那么大。即使这样，欧债问题并未解决，而且有恶化趋势，未来 1-2 年经济复苏的进展将进一步曲折。从国内看，中国经济的核心指标包括 GDP、CPI 等都将保持平稳小幅回落趋势，而房价仍然高企，短期政策不会急剧转向，而海外经济的不确定性也将对外需构成影响，在地方政府融资平台等问题不显著影响国内经济与金融的前提下，国内经济将继续平稳回落。

从市场来看，短期内 CPI 在 7 月创出本轮新高之后能否回落、保障房能否如期在 10 月底之前开工等等各项数据，都将对市场预期产生较大影响；欧债危机和美国主权评级下调虽不影响大的复苏格局但短期冲击持续的时间仍存在变化。因此，宏观经济对股市的趋势性影响在短期内仍充满不确定性，而中期则影响偏小，预计市场短期剧烈震荡后将趋于平稳。本基金将致力于研究和寻找那些符合中国经济发展方向、景气度趋好的行业，并从中优选成长性显著的公司，在估值合理的位置买入其股票，尽力为基金持续创造收益。

#### 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验。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

本基金本报告期内未实施利润分配。截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无需实施利润分配。

### 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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资产:			
银行存款	6.4.7.1	10,771,031.66	25,545,702.97
结算备付金		339,340.90	531,970.58
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	88,813,302.39	69,143,541.61
其中: 股票投资		74,941,262.39	66,827,677.75
基金投资		-	-
债券投资		13,872,040.00	2,315,863.86
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	438,960.94
应收利息	6.4.7.5	23,436.18	11,262.65
应收股利		-	-
应收申购款		11,735.59	273,046.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		100,208,846.72	96,194,485.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		742,668.33	-
应付赎回款		68,938.14	154,740.11
应付管理人报酬		115,230.88	121,393.29
应付托管费		19,205.12	20,232.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	271,137.84	334,704.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	933,709.48	1,120,581.41
负债合计		2,150,889.79	1,751,651.17
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	106,698,074.48	96,932,030.60
未分配利润	6.4.7.10	-8,640,117.55	-2,489,196.05
所有者权益合计		98,057,956.93	94,442,834.55
负债和所有者权益总计		100,208,846.72	96,194,485.72

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9190 元，基金份额总额 106,698,074.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-3,487,775.13</b>	<b>-14,214,441.97</b>
1.利息收入		140,766.80	136,840.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	65,348.66	134,904.98
债券利息收入		64,958.10	1,935.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,460.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-519,072.42	-6,266,600.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,021,538.38	-6,113,812.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	13,242.91	-364,090.97
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	489,223.05	211,303.52
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-3,118,590.49	-8,097,598.84
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	9,120.98	12,917.11
<b>减：二、费用</b>		<b>1,820,687.03</b>	<b>1,945,577.80</b>
1. 管理人报酬		711,373.86	767,177.18
2. 托管费		118,562.34	127,862.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	794,069.45	854,809.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	196,681.38	195,727.95

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-5,308,462.16	-16,160,019.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-5,308,462.16	-16,160,019.77

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	96,932,030.60	-2,489,196.05	94,442,834.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,308,462.16	-5,308,462.16
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)	9,766,043.88	-842,459.34	8,923,584.54
其中：1. 基金申购款	19,350,066.94	-1,268,104.11	18,081,962.83
2. 基金赎回款	-9,584,023.06	425,644.77	-9,158,378.29
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	106,698,074.48	-8,640,117.55	98,057,956.93
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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)	88,654,213.21	20,890,529.74	109,544,742.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,160,019.77	-16,160,019.77
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)	1,004,576.26	-217,144.67	787,431.59

其中：1. 基金申购款	11,903,778.96	1,933,984.11	13,837,763.07
2. 基金赎回款	-10,899,202.70	-2,151,128.78	-13,050,331.48
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	89,658,789.47	4,513,365.30	94,172,154.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(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[2008]第 524 号《关于核准中欧新蓝筹灵活配置混合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《中欧新蓝筹灵活配置混合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 325,072,352.57 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(2008)第 114 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 325,208,837.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 136,484.97 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧新蓝筹灵活配置混合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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 40%-80%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-60%，其中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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+上证国债指数×35%+一年期定期存款利率×5%。

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 8 月 26 日批准报



出。

#### 6.4.2 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》、《中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日半年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	10,771,031.66
定期存款	-
其他存款	-
合计	10,771,031.66

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		75,168,753.59	74,941,262.39	-227,491.20
债券	交易所市场	14,203,780.01	13,872,040.00	-331,740.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	14,203,780.01	13,872,040.00	-331,740.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		89,372,533.60	88,813,302.39	-559,231.21

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有衍生金融资产及负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,435.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	152.70
应收债券利息	20,848.22
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	23,436.18

#### 6.4.7.6 其他资产

截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	270,962.84
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	271,137.84

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	229.78
应付审计费	24,795.19
应付信息披露费	158,684.51
合计	933,709.48

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,932,030.60	96,932,030.60
本期申购	19,350,066.94	19,350,066.94
本期赎回（以“-”号填列）	-9,584,023.06	-9,584,023.06
本期末	106,698,074.48	106,698,074.48

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,535,441.90	-4,024,637.95	-2,489,196.05
本期利润	-2,189,871.67	-3,118,590.49	-5,308,462.16
本期基金份额交易产生的变动数	74,432.29	-916,891.63	-842,459.34
其中：基金申购款	86,346.86	-1,354,450.97	-1,268,104.11
基金赎回款	-11,914.57	437,559.34	425,644.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-579,997.48	-8,060,120.07	-8,640,117.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	61,499.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,847.12
其他	2.46
合计	65,348.66

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	256,411,331.39
减：卖出股票成本总额	257,432,869.77
买卖股票差价收入	-1,021,538.38

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,262,362.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,175,779.79
减：应收利息总额	73,339.91
债券投资收益	13,242.91

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无权证投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	489,223.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	489,223.05

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,118,590.49
——股票投资	-2,756,660.30
——债券投资	-361,930.19
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,118,590.49

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	8,929.88
转换费收入	191.10
合计	9,120.98

注：1、本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	793,369.45
银行间市场交易费用	700.00
合计	794,069.45

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2011年1月1日至2011年6月30日	
审计费用		24,795.19
信息披露费		158,684.51
银行汇划费用		4,201.68
账户维护费用		9,000.00
合计		196,681.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2011 年 6 月 30 日止，本基金无需要在财务报表附注中披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30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	8,050,713.61	1.53%	80,411,802.79	14.39%

6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 债券交易**

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交易。

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	6,541.20	1.50%	6,541.20	2.41%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	65,335.52	14.06%	24,298.21	10.46%

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。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	711,373.86	767,177.18
其中：支付销售机构的客户 维护费	129,402.78	79,135.06

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 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：日管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	118,562.34	127,862.83

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 0.25% 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× 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间本基金不存在与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易的情况。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	30,038,500.00	30,038,500.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,038,500.00	30,038,500.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.15%	33.50%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

##### 6.4.10.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方不存在投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30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	10,771,031.66	61,499.08	44,158,339.66	131,688.96

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。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资目标、投资范围和投资策略决定了本基金属于风险中等，追求长期稳定资本增值的混合型证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过主要投资于未来持续成长能力强的潜力公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部，负责进行风险的实时监控和定期计算，并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 14.15 % (2010 年 12 月 31 日：2.45%)。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于

基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等,其余大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,771,031.66	-	-	-	10,771,031.66
结算备付金	339,340.90	-	-	-	339,340.90
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	4,223,200.00	9,648,840.00	74,941,262.39	88,813,302.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	23,436.18	23,436.18

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,735.59	11,735.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,110,372.56	4,223,200.00	9,648,840.00	75,226,434.16	100,208,846.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	742,668.33	742,668.33
应付赎回款	-	-	-	68,938.14	68,938.14
应付管理人报酬	-	-	-	115,230.88	115,230.88
应付托管费	-	-	-	19,205.12	19,205.12
应付交易费用	-	-	-	271,137.84	271,137.84
其他负债	-	-	-	933,709.48	933,709.48
负债总计	-	-	-	2,150,889.79	2,150,889.79
利率敏感度缺口	11,110,372.56	4,223,200.00	9,648,840.00	73,075,544.37	98,057,956.93
上年度末2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,545,702.97	-	-	-	25,545,702.97
结算备付金	531,970.58	-	-	-	531,970.58
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	2,315,863.86	-	-	66,827,677.75	69,143,541.61
应收证券清算款	-	-	-	438,960.94	438,960.94
应收利息	-	-	-	11,262.65	11,262.65
应收申购款	1,976.28	-	-	271,070.69	273,046.97
资产总计	28,395,513.69	-	-	67,798,972.03	96,194,485.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	154,740.11	154,740.11
应付管理人报酬	-	-	-	121,393.29	121,393.29
应付托管费	-	-	-	20,232.20	20,232.20
应付交易费用	-	-	-	334,704.16	334,704.16
其他负债	-	-	-	1,120,581.41	1,120,581.41
负债总计	-	-	-	1,751,651.17	1,751,651.17
利率敏感度缺口	28,395,513.69	-	-	66,047,320.86	94,442,834.55

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约26	减少约3
	市场利率下降25个基点	增加约27	增加约3

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 40%-80%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-60%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	74,941,262.39	76.43	66,827,677.75	70.76
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	74,941,262.39	76.43	66,827,677.75	70.76

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约627	增加约510
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约627	减少约510

7 投资组合报告

7.1 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	74,941,262.39	74.79
	其中:股票	74,941,262.39	74.79
2	固定收益投资	13,872,040.00	13.84
	其中:债券	13,872,040.00	13.84
	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	11,110,372.56	11.09
6	其他各项资产	285,171.77	0.28
7	合计	100,208,846.72	100.00

7.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	45,047,971.96	45.94
C0	食品、饮料	8,311,754.32	8.48
C1	纺织、服装、皮毛	6,058,646.70	6.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,890,500.00	11.11
C5	电子	2,241,000.00	2.29
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	15,350,070.94	15.65
C8	医药、生物制品	2,196,000.00	2.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	806,000.00	0.82
F	交通运输、仓储业	7,268,913.76	7.41
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	4,652,998.24	4.75
I	金融、保险业	6,063,660.00	6.18
J	房地产业	4,204,200.00	4.29
K	社会服务业	6,897,518.43	7.03
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	74,941,262.39	76.43

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000527	美的电器	250,000	4,597,500.00	4.69
2	601117	中国化学	500,000	4,430,000.00	4.52
3	002146	荣盛发展	429,000	4,204,200.00	4.29
4	002042	华孚色纺	170,000	4,158,200.00	4.24
5	002564	张化机	204,849	4,109,270.94	4.19

6	002001	新 和 成	120,000	3,534,000.00	3.60
7	002142	宁波银行	300,000	3,264,000.00	3.33
8	000422	湖北宜化	155,000	3,244,150.00	3.31
9	000858	五 粮 液	89,902	3,211,299.44	3.27
10	002557	洽洽食品	99,938	2,974,154.88	3.03
11	600280	南京中商	108,494	2,924,998.24	2.98
12	600029	南方航空	369,989	2,900,713.76	2.96
13	601318	中国平安	58,000	2,799,660.00	2.86
14	601333	广深铁路	620,000	2,548,200.00	2.60
15	002006	精功科技	40,000	2,296,400.00	2.34
16	600637	广电信息	180,000	2,241,000.00	2.29
17	300195	长荣股份	55,000	2,231,900.00	2.28
18	002099	海翔药业	100,000	2,196,000.00	2.24
19	600519	贵州茅台	10,000	2,126,300.00	2.17
20	000651	格力电器	90,000	2,115,000.00	2.16
21	300198	纳川股份	75,000	2,070,750.00	2.11
22	002215	诺 普 信	128,000	2,041,600.00	2.08
23	002029	七 匹 狼	59,951	1,900,446.70	1.94
24	601866	中海集运	500,000	1,820,000.00	1.86
25	600693	东百集团	200,000	1,728,000.00	1.76
26	300190	维尔利	30,000	1,380,000.00	1.41
27	002469	三维工程	39,997	1,087,518.43	1.11
28	601668	中国建筑	200,000	806,000.00	0.82

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600795	国电电力	9,956,000.00	10.54
2	000778	新兴铸管	7,029,236.81	7.44
3	601117	中国化学	5,858,077.00	6.20
4	600029	南方航空	5,689,063.43	6.02
5	002146	荣盛发展	5,373,349.68	5.69
6	000629	攀钢钒钛	5,062,712.11	5.36
7	601006	大秦铁路	4,991,519.00	5.29
8	000527	美的电器	4,867,311.20	5.15
9	600537	海通集团	4,318,305.23	4.57
10	000157	中联重科	4,249,922.10	4.50

11	002142	宁波银行	4,140,000.00	4.38
12	002042	华孚色纺	4,055,754.80	4.29
13	002006	精工科技	3,847,444.17	4.07
14	002038	双鹭药业	3,812,951.57	4.04
15	002564	张化机	3,762,876.47	3.98
16	600031	三一重工	3,745,390.21	3.97
17	000935	四川双马	3,736,916.16	3.96
18	000759	中百集团	3,603,640.90	3.82
19	002001	新 和 成	3,524,554.76	3.73
20	000651	格力电器	3,522,870.30	3.73
21	002099	海翔药业	3,503,846.46	3.71
22	000540	中天城投	3,305,678.63	3.50
23	300111	向日葵	3,199,457.74	3.39
24	000858	五 粮 液	3,116,921.14	3.30
25	000422	湖北宣化	3,107,661.54	3.29
26	600815	厦工股份	3,068,844.00	3.25
27	601299	中国北车	3,036,000.00	3.21
28	002033	丽江旅游	3,031,616.06	3.21
29	000600	建投能源	3,009,924.00	3.19
30	601318	中国平安	3,009,064.00	3.19
31	300195	长荣股份	2,956,759.72	3.13
32	002458	益生股份	2,953,769.61	3.13
33	601668	中国建筑	2,951,100.00	3.12
34	601111	中国国航	2,915,100.00	3.09
35	600350	山东高速	2,907,415.96	3.08
36	601088	中国神华	2,842,332.00	3.01
37	600280	南京中商	2,825,572.10	2.99
38	002039	黔源电力	2,804,228.67	2.97
39	002557	洽洽食品	2,797,975.09	2.96
40	000707	双环科技	2,796,306.46	2.96
41	601333	广深铁路	2,607,352.36	2.76
42	002139	拓邦股份	2,548,213.29	2.70
43	600104	上海汽车	2,502,991.09	2.65
44	000589	黔轮胎 A	2,362,149.51	2.50
45	600458	时代新材	2,351,865.00	2.49
46	600805	悦达投资	2,281,370.95	2.42
47	000932	华菱钢铁	2,277,147.92	2.41
48	002299	圣农发展	2,267,340.00	2.40
49	000876	新 希 望	2,209,687.00	2.34
50	600298	安琪酵母	2,170,897.60	2.30
51	600637	广电信息	2,164,416.00	2.29



52	000401	冀东水泥	2,140,222.66	2.27
53	600881	亚泰集团	2,138,000.00	2.26
54	300198	纳川股份	2,070,682.00	2.19
55	601866	中海集运	2,047,246.00	2.17
56	600693	东百集团	2,019,337.33	2.14
57	000597	东北制药	2,017,142.00	2.14
58	601566	九牧王	1,993,214.40	2.11
59	600720	祁连山	1,980,896.50	2.10
60	002029	七匹狼	1,972,350.92	2.09
61	600188	兖州煤业	1,965,088.00	2.08
62	000729	燕京啤酒	1,956,664.57	2.07
63	002215	诺普信	1,935,847.00	2.05
64	600723	西单商场	1,935,357.78	2.05
65	000698	沈阳化工	1,913,919.00	2.03
66	600362	江西铜业	1,908,634.00	2.02
67	600585	海螺水泥	1,891,751.18	2.00

注：1、西单商场（600723）于 2011 年 7 月 25 日更名为首商股份。

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

#### 7.4.2 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	600795	国电电力	9,650,852.73	10.22
2	000778	新兴铸管	6,954,621.30	7.36
3	600031	三一重工	4,805,615.00	5.09
4	000629	攀钢钒钛	4,775,370.00	5.06
5	601006	大秦铁路	4,734,699.50	5.01
6	000157	中联重科	4,347,350.00	4.60
7	600537	海通集团	4,232,937.37	4.48
8	601699	潞安环能	4,173,416.77	4.42
9	002038	双鹭药业	3,722,820.23	3.94
10	002006	精功科技	3,689,454.41	3.91
11	000540	中天城投	3,655,637.28	3.87
12	600805	悦达投资	3,542,312.50	3.75
13	000759	中百集团	3,468,290.15	3.67
14	000935	四川双马	3,306,821.79	3.50
15	300111	向日葵	3,167,888.35	3.35
16	002039	黔源电力	3,045,505.40	3.22
17	601169	北京银行	3,023,200.00	3.20
18	000600	建投能源	2,992,896.60	3.17

19	600036	招商银行	2,957,913.20	3.13
20	600029	南方航空	2,919,778.00	3.09
21	601111	中国国航	2,879,866.00	3.05
22	600104	上海汽车	2,865,401.00	3.03
23	600350	山东高速	2,830,371.72	3.00
24	000707	双环科技	2,830,145.66	3.00
25	601088	中国神华	2,796,919.48	2.96
26	601299	中国北车	2,766,500.00	2.93
27	002458	益生股份	2,719,650.50	2.88
28	600252	中恒集团	2,693,874.68	2.85
29	002139	拓邦股份	2,656,602.11	2.81
30	002501	利源铝业	2,551,958.47	2.70
31	600348	国阳新能	2,537,289.00	2.69
32	000401	冀东水泥	2,484,676.00	2.63
33	002033	丽江旅游	2,451,180.40	2.60
34	601668	中国建筑	2,414,000.00	2.56
35	600815	厦工股份	2,384,640.98	2.52
36	000932	华菱钢铁	2,333,696.05	2.47
37	600881	亚泰集团	2,323,648.81	2.46
38	600742	一汽富维	2,275,892.00	2.41
39	600458	时代新材	2,247,475.97	2.38
40	000589	黔轮胎 A	2,238,705.13	2.37
41	002081	金螳螂	2,233,232.96	2.36
42	600720	祁连山	2,164,005.00	2.29
43	600738	兰州民百	2,159,717.18	2.29
44	002299	圣农发展	2,155,784.41	2.28
45	600723	西单商场	2,141,242.13	2.27
46	000597	东北制药	2,124,565.86	2.25
47	600172	黄河旋风	2,106,657.00	2.23
48	600298	安琪酵母	2,093,849.00	2.22
49	601117	中国化学	2,039,000.00	2.16
50	600188	兖州煤业	2,033,650.00	2.15
51	601566	九牧王	1,962,367.00	2.08
52	300065	海兰信	1,950,689.50	2.07
53	002146	荣盛发展	1,942,852.12	2.06
54	000729	燕京啤酒	1,941,378.00	2.06
55	600750	江中药业	1,931,974.13	2.05
56	000635	英力特	1,917,470.70	2.03

注：1、国阳新能（600348）于 2011 年 7 月 15 日更名为阳泉煤业。

2、西单商场（600723）于 2011 年 7 月 25 日更名为首商股份。

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

#### 7.4.3 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	268,303,114.71
卖出股票的收入（成交）总额	256,411,331.39

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。

### 7.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,872,040.00	14.15
8	其他	-	-
9	合计	13,872,040.00	14.15

### 7.6 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	113002	工行转债	40,000	4,738,800.00	4.83
2	113001	中行转债	40,000	4,223,200.00	4.31
3	110016	川投转债	24,000	2,753,040.00	2.81
4	110015	石化转债	20,000	2,157,000.00	2.20
5	-	-	-	-	-

### 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

但本基金投资的前十名股票中包括上市公司宜宾五粮液股份有限公司(五粮液,代码:000858),该公司于2011年5月27日发布公告称:“今日本公司接到中国证券监督管理委员会行政处罚决定书,其主要内容如下:一、五粮液关于四川省宜宾五粮液投资(咨询)有限责任公司对成都智溢塑胶制品有限公司在亚洲证券有限责任公司的证券投资款的《澄清公告》存在重大遗漏;二、五粮液在中国科技证券有限责任公司的证券投资信息披露不及时、不完整;三、五粮液2007年年度报告存在录入差错未及时更正;四、五粮液未及时披露董事被司法羁押事项。”

本基金有关该股票的投资决策程序,符合法律法规和公司规章制度的规定。本基金投研团队认为,五粮液作为白酒行业的龙头企业之一,长期以来业绩成长性良好、生产稳健、产品畅销。针对上述事项,五粮液已经明确表示将接受证监会的行政处罚,不申请行政复议和提起行政诉讼,同时深刻汲取教训,不断完善公司治理,依法、合规经营,真实、准确、完整、及时、公平披露信息,以更加积极的态度做好各方面工作,维护公司和股东的利益。同时,公司公告称已经对有关事项进行了认真整改,整改取得明显实效,公司没有受到任何经济损失,未来将牢固树立积极维护投资者利益的意识,运作更加规范,治理结构更加完善,从而提升其投资价值。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,436.18
5	应收申购款	11,735.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,171.77

### 7.9.4 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	113002	工行转债	4,738,800.00	4.83
2	113001	中行转债	4,223,200.00	4.31

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.9.6 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。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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
21,869	4,878.96	50,877,171.34	47.68%	55,820,903.14	52.32%

**8.2 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	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	37,611.90	0.0353%

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2008年7月25日)基金份额总额	325,208,837.54
本报告期期初基金份额总额	96,932,030.60
本报告期基金总申购份额	19,350,066.94
减：本报告期基金总赎回份额	9,584,023.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	106,698,074.48

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2011 年 1 月 22 日发布公告，马文胜先生自 2011 年 1 月 19 日起不再担任中欧基金管理有限公司督察长职务，由朱彦先生担任该职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

本报告期内，基金管理人于 2011 年 5 月 25 日发布公告，经中欧基金管理有限公司研究决定，沈洋先生不再担任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理职务，由周蔚文先生接替其担任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

本报告期内，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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
安信证券	1	177,017,911.14	33.75%	143,828.78	33.02%	-
兴业证券	1	166,040,574.28	31.65%	141,134.45	32.40%	-
高华证券	1	90,293,541.28	17.21%	73,364.51	16.84%	-
海通证券	1	49,425,163.67	9.42%	42,011.09	9.65%	-
平安证券	1	33,726,662.12	6.43%	28,667.24	6.58%	-
国都证券	1	8,050,713.61	1.53%	6,541.20	1.50%	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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。

#### 10.7.2 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

安信证券	111,675.30	0.39%	-	-	-	-
兴业证券	13,232,890.90	46.77%	5,000,000.00	100.00%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	4,737,301.10	16.74%	-	-	-	-
平安证券	10,212,140.00	36.09%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司旗下基金2010年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	公司网站	2011-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-01-22
3	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金2010年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于新增英大证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-02-23
5	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在英大证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-02-23
6	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2011年第1号）	公司网站	2011-03-10
7	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2011年第1号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-03-10
8	中欧基金管理有限公司关于新增中信证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-03-15
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-03-15
10	中欧基金管理有限公司关于注册登记（分TA）系统升级的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-03-18



11	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2010年年度报告	公司网站	2011-03-30
12	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2010年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-03-30
13	中欧基金管理有限公司关于新增爱建证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-04-15
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-04-15
15	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券有限责任公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-04-15
16	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2011年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-04-20
17	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-04-29
18	中欧基金管理有限公司关于中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-05-25
19	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的基金网上申购费率优惠活动延期的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2011-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 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

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.lcfunds.com](http://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免费查阅。

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  
二〇一一年八月二十六日