

# 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2012 年第 1 号）

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

二〇一二年十一月

## 重要提示

本基金经 2011 年 10 月 13 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧盛世成长分级股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1658 号文）核准，进行募集。本基金基金合同于 2012 年 3 月 29 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，盛世 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；盛世 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。本基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同》和《中欧盛

世成长分级股票型证券投资基金更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日 2012 年 9 月 28 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                        |    |
|------------------------|----|
| 一、基金管理人 .....          | 5  |
| 二、基金托管人 .....          | 8  |
| 三、相关服务机构 .....         | 10 |
| 四、基金的名称 .....          | 24 |
| 五、基金的类型 .....          | 24 |
| 六、基金的投资目标 .....        | 25 |
| 七、基金的投资方向 .....        | 25 |
| 八、基金的投资策略 .....        | 25 |
| 九、基金的业绩比较基准 .....      | 31 |
| 十、基金的风险收益特征 .....      | 31 |
| 十一、基金投资组合报告 .....      | 31 |
| 十二、基金的业绩 .....         | 35 |
| 十三、基金的费用与税收 .....      | 36 |
| 十四、对招募说明书更新部分的说明 ..... | 38 |

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层
3. 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
4. 法定代表人：唐步
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2006年7月19日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：潘霄
13. 客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.2亿元人民币
15. 股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称UBI）出资5,880万元人民币，占公司注册资本的49%；

国都证券有限责任公司出资5,640万元人民币，占公司注册资本的47%；

万盛基业投资有限责任公司出资480万元人民币，占公司注册资本的4%；

上述三个股东共出资12,000万元人民币。

### （二）主要人员情况

#### 1. 基金管理人董事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。21年以上证券从业经验。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理。

Gianluca Trombi先生，中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行国

际业务部主管，意大利籍。曾任摩根士丹利（米兰）投资银行部总监、意大利金融机构小组主管；摩根士丹利（伦敦/米兰）投资银行部执行总监；瑞士联合银行（苏黎世）金融机构小组副总裁；毕马威会计师事务所（咨询业务·米兰）公司/战略金融服务资深经理；毕马威会计师事务所（审计业务·米兰）资深审计师。

Guido Masella 先生，中欧基金管理有限公司董事，意大利意联银行亚太区商务拓展主管，意大利籍。曾任意大利中央银行（罗马）国际研究处、国际金融机构部经济师；意大利驻华大使馆（北京）财务专员；意大利中央银行（布鲁塞尔）本地代表办事处经济师；意大利中央银行（维罗纳）银行和金融系统监管署分析师。

陈金占先生，中欧基金管理有限公司董事，国都证券有限责任公司副总经理，中国籍。历任中共北京市纪律检查委员会/北京市打击经济犯罪办公室成员、北京国际信托投资有限公司金融总部和证券总部副经理/律师。

Barry Livett 先生，中欧基金管理有限公司独立董事，百库国际金融有限公司首席执行官，英国籍，硕士学历。历任伦敦证券交易所高级分析员、国际证券咨询有限公司（International Securities Consultancy Ltd.）咨询师、新加坡联合银行高级经理、Morgan Grenfell 亚洲区经理助理、中银国际助理董事，欧中金融服务合作项目协调员/证券部董事。

刘桓先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，中央财经大学副院长/教授。

肖微先生，中欧基金管理有限公司独立董事，中国籍，美国哥伦比亚大学法学硕士，君合律师事务所主任/合伙人。曾任中国法律事务中心律师。

## 2. 基金管理人监事会成员

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，中国籍，武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。现任上海源泰律师事务所合伙人。

刘中先生，中欧基金管理有限公司监事，国都证券有限责任公司副总裁，中国籍，工学博士。历任中国核仪器设备总公司干部；华夏证券发行部市场营销处处长；南方证券投资银行部副总；国信证券投资银行总部执行副总。

刘玫女士，中欧基金管理有限公司职工监事，中欧基金管理有限公司财务部总监，加拿大籍，研究生学历。历任北京掌联科技有限公司行政总监、成都市政府外商投资促进中心项目经理、加拿大 DESROSIERS—LOMBARDI—DOLBEC 注册会计师事务所审计师、美国 GENERAL EASTERN TRADING 公司财务经理。

### 3. 公司高级管理人员

唐步先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。北京大学法学硕士，16年以上证券及基金从业经验。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

黄桦先生，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，22年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有限公司分管运营副总经理。

周蔚文先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2011年5月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自2011年8月起至今），中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自2012年3月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，13年以上证券及基金从业经验。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、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自2006年11月起至2011年1月），中欧基金管理有限公司研究部总监。

朱彦先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学经济学学士，23年以上信托、证券及基金从业经验。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工，海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管，海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理，北京国际信托投资公司上海昆明路证券营业部总经理，国都证券有限责任公司上海通北路证券营业部总经理、上海长阳路证券营业部总经理，中欧基金管理有限公司督察长。

#### 4. 本基金基金经理

周蔚文先生，中国籍，北京大学管理科学与工程专业硕士，13年证券从业经验。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、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自2006年11月起至2011年1月），中欧基金管理有限公司研究部总监。现任中欧基金管理有限公司副总经理兼投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2011年5月23日起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自2011年8月16日起至今）、中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自2012年3月29日起至今）。

#### 5. 公司投资决策委员会成员

公司副总经理兼投资总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、总经理助理兼权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、研究部副总监杨坤女士、专户理财部副总监沈洋先生、基金经理王海先生。其中副总经理兼投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1. 基本情况

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

注册日期：1988年7月8日

注册资本：154亿元人民币

基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363号

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

托管部门联系人：成蕾



电话：010—65169618

传真：010—65169555

广发银行股份有限公司成立于1988年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本154亿元。十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2006年，广发银行成功重组，引入了花旗集团、中国人寿、国家电网、中信信托等世界一流的知名企业作为战略投资者。重组后，广发银行紧紧围绕“建设一流商业银行”的战略目标，注重战略规划的执行，坚持“调结构、打基础、抓创新、促发展”，强化风险控制，坚持又好又快可持续发展，取得了良好的经营业绩。

2011年12月末，广发银行资本净额720亿元（人民币，下同），资产总额9190亿元，本外币各项存款余额7425亿元，各项贷款余额5402亿元。根据英国《银行家》杂志对全球1000家大银行排定的位次，广发银行已连续多年入选全球银行500强。

## 2. 主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行团队、监督稽核团队和市场营销团队，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理禄金山先生具有超过二十年的银行从业经历，先后在监管机构和商业银行工作，熟悉我国监管制度和相关行业准则，确保托管业务安全稳健运行。2009年5月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部总经理职务。

## 3. 基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363号。

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1. 内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保

证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## 2. 内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理的工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

## 3. 内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

## 三、相关服务机构

### （一）场内发售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）

## （二）场外发售机构

### 1. 直销机构：

#### （1）中欧基金管理有限公司上海直销中心

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

联系人：潘霄

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：[www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com)

#### （2）中欧基金管理有限公司网上交易系统

网址：[www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com)

### 2. 代销机构（排名不分先后）

#### （1）广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38322256

传真：020-87310955

客服热线：400-830-8003

网址：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

#### （2）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：95533

传真：010-66275654

客服热线：95533

网址：<http://www.ccb.com>

（3）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021-52629999

客服热线：95561

网址：<http://www.cib.com.cn>

（4）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户热线：95568

网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（5）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

（6）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：陈铭铭

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客服热线：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

（7）中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号 A 座 5 层

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-63639709

客服热线：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

（8）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客服热线：95565、4008888111

网址：<http://www.newone.com.cn>

（9）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法人代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

（10）广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河区大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

传真：020-87555305

客服热线：95575 或致电各地营业网点

网址：<http://www.gf.com.cn>

（11）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：4008888108

传真：010-65182261

客服热线：4008888108

网址：<http://www.csc108.com>

（12）国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

客服热线：400-818-8118

网址：<http://www.guodu.com>

(13) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄正大五道口广场 1 号楼 22 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565783

客服热线：95562

网址：<http://www.xyzq.com.cn>

(14) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

传真：010-66045527

客服热线：010-66045678

网址：<http://www.txsec.com>、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(15) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：4008888788，10108998

网址：<http://www.ebscn.com>

（16）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服热线：0591-96326

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

（17）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568990

客服热线：4008-888-888

网址：<http://www.chinastock.com.cn>

（18）齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：<http://www.qlzq.com.cn>

（19）申银万国证券股份有限公司



住所：上海市常熟路 171 号  
办公地址：上海市常熟路 171 号  
法定代表人：丁国荣  
联系人：李清怡  
电话：021-54033888  
传真：021-54038844  
客服热线：95523 或 4008895523  
网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

（20）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号  
办公地址：上海市广东路 689 号  
法定代表人：王开国  
联系人：金芸、李笑鸣  
电话：021-23219000  
传真：021-23219100  
客服热线：95553  
网址：<http://www.htsec.com>

（21）国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
法人代表：凤良志  
联系人：李飞  
电话：0551-2246298  
传真：0551-2272100  
客服热线：95578，4008888777  
网址：<http://www.gyzq.com.cn>

（22）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼  
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391 全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

网址：<http://www.pingan.com>

(23) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服热线：4008888666

网址：<http://www.gtja.com>

(24) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服热线：4008-001-001

网址：<http://www.essences.com.cn>

(25) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服热线：400-800-8899

网址：<http://www.cindasc.com>

（26）华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路90号

办公地址：南京市中山东路90号

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

电话：025-83290979

传真：025-51863323

客服热线：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（27）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767880

客服热线：400-8888-128

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

（28）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客服热线：95558

网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

（29）爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888-25113

传真：021-68728703

客服热线：021-63340678

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

（30）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

客服热线：4008-888-228

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

（31）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服热线：0532-96577

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（32）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：王宜四（代）

联系人：陈诚

电话：023-63786464

客服热线：4008096096

网址：www.swsc.com.cn

（33）中信证券（浙江）有限责任公司

住所：中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼

办公地址：中国浙江省杭州市江南大道588号恒鑫大厦19、20楼

法定代表人：沈强

联系人：周研

电话：0571-86078823

客服热线：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

（34）联讯证券有限责任公司

住所：广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼

办公地址：广东惠州惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心四楼

法定代表人：徐刚

联系人：张悦

电话：0752-2119391

客服热线：400-8888-929

网址：www.lxzq.com.cn

（35）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-4890619

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

（36）国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街8号

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

电话：0510-2833551

传真：0510-2833321

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

（注：中欧基金管理有限公司于2012年10月17日起增加国联证券股份有限公司为旗下部分基金的代销机构并参与其日常申购及定期定额申购费率优惠活动，该事项已于2012年10月17日在三大报及公司网站公告。）

（37）深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系电话：0755-33227953

众禄基金销售网：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（38）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000-766-123

传真：0571-26698533

联系电话：0571-28829790

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（39）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服热线：400-089-1289

传真：021-58788678-8815

联系电话：021-58788678

网址：www.erichfund.com

（40）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服热线：400-1818-188

传真：021-64385308

联系电话：021-54509998-7019

网址：www.1234567.com.cn

（41）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

传真：021-68596916

联系电话：021-58870011

网址：www.ehowbuy.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（三）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法人代表：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

（四）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

（五）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：刘颖

经办会计师：单峰 刘颖

#### 四、基金的名称

中欧盛世成长分级股票型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式



## 六、基金的投资目标

把握中国经济发展主线，在合理估值的基础上，投资于行业成长性优良，个股盈利持续增长的上市公司，严格控制风险，追求基金资产长期稳健增值。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的60%~95%，其中权证资产比例不超过基金资产净值的3%；债券等固定收益类资产以及现金占基金资产的5%~40%，其中现金或者投资于到期日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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

### （一）投资策略

本基金在资产配置方面，“自上而下”地调整股票和债券等各类资产的配置比例；在权益类资产投资方面，以“自上而下”的行业配置策略为基础，精选优质行业中的优质个股来确定具有投资价值的证券品种。

#### 1. 资产配置策略

本基金的资产配置以记分卡体系为基础。本基金在记分卡体系中设定影响证券市场前景的相关方面，包括宏观经济趋势、上市公司盈利能力、股票市场估值水平、市场情绪等四个方面。本基金定期对上述四个方面进行评估和评分，评估结果分为非常正面、正面、中性、负面、非常负面等并有量化评分相对应。加总

上述四个方面的量化评分即可得到资产配置加总评分。本基金据此调整股票资产配置策略。

## 2. 行业配置策略

### （1）经济周期与行业分析

各行业变动时，往往呈现出较为明显的、可预测的增长或衰退的格局。这些变动与国民经济总体的周期变动是有关系的，但关系密切的程度又不一样。据此，可以将行业分为三类。

#### ① 增长型行业

增长型行业的运行状态与经济活动总水平的周期及其振幅并不紧密相关。这些行业收入增长的速率并不总是随着经济周期的变动而出现同步变动，因为它们主要依靠技术的进步、新产品推出及更优质的服务，从而使其经常呈现出增长形态。

本基金将重点投资于增长型行业，因为这些高增长的行业受到国民经济的周期波动的影响较小。在经济高涨时，高增长行业的发展速度通常高于平均水平；在经济衰退时期，其所受影响较小甚至仍能保持一定的增长。

#### ② 周期型行业

周期型行业的运行状态与经济周期紧密相关。当经济处于上升时期，这些行业会紧随其扩张；当经济衰退时，这些行业也相应衰落，且该类型行业收益的变化幅度往往会在一定程度上夸大经济的周期性。该类型行业的产品需求收入弹性一般较高。

本基金将根据对宏观经济景气周期和金融货币政策变化的研判，运用“投资时钟理论”，适度投资于不同经济周期阶段处于景气复苏以及景气上升阶段的行业。在经济复苏时，适度增加周期型的成长投资；在经济过热期，适度增加周期型的价值投资。

#### ③ 防守型行业

防守型行业的经营状况在经济周期的上升和下降阶段都很稳定。该类型行业的产品需求相对稳定，需求弹性小；经济周期处于衰退阶段对这种行业的影响也比较小；甚至有些防守型行业在经济衰退时期还会有一定的实际增长。

本基金将结合对经济周期的研判和投资组合在稳健收益和资本利得两类资本

增值方式之间中长期的合理配比而适度投资于防守型行业。在经济衰退期，适度增加防守型的成长投资；在经济滞胀期，适度增加防守型的价值投资。

#### ④ 行业类型的识别

本基金分析某行业是否属于增长型行业或者是否属于周期型行业，主要利用该行业的历年统计资料与国民经济综合指标进行对比，具体而言是将某行业历年的营业收入等经营指标与同期国内生产总值等指标进行比较：如果大多数年份行业增长率都高于国民经济综合指标的增长率，说明这一行业是增长型行业；如果行业的营业收入与国民经济综合指标同向变化，说明这一行业很可能是周期型行业；如果行业的营业收入在国民经济综合指标呈现不同方向和不同幅度变化时都保持相对稳定，说明该行业是防守型行业。

### （2）增长型行业的具体识别

#### ① 行业生命周期

通常，每个行业都要经历一个由成长到衰退的发展演变过程。这个过程便称为行业的生命周期。一般来说，行业的生命周期可分为幼稚期、成长期、成熟期和衰退期。

处于幼稚期行业的上市公司因其较高的产品成本和价格和较小的市场需求之间的矛盾，往往面临较大的市场风险，而且还可能因为财务困难而引发破产风险。因此本基金原则上不投资于幼稚期行业。

处于成长期的行业的上市公司增长非常迅猛，部分优势企业能够脱颖而出，企业的投资者往往也能获得极高的投资回报。本基金将积极挖掘处于成长期的优质上市公司进行投资。

处于成熟期行业的上市公司，行业增长速度降到一个适度水平，行业的发展可能难以与国民生产总值同步增长。但由于技术创新、产业政策、经济全球化等各种原因，某些行业可能会在进入成熟期之后迎来新的增长。本基金将根据投资组合在稳健收益和资本利得两类资本增值方式之间中长期的合理配比适度投资于成熟期行业的上市公司。

处于衰退期行业的上市公司面临市场需求减少，收入利润增长停滞甚至不断下降的局面。因此本基金原则上不投资于衰退期行业。

#### ② 行业成长能力的考察

本基金主要从以下六个方面考察行业的成长能力：

A. 需求弹性。一般而言，需求弹性较高的行业成长能力也较强。

B. 生产技术。技术进步快的行业，创新能力强，生产率上升快，容易保持优势地位，其成长能力也强。

C. 产业关联度。产业关联度是指产业与产业之间通过产品供需而形成的互相关联、互为存在前提条件的内在联系。产业关联度强的行业，成长能力也强。

D. 市场容量与潜力。市场容量与市场潜力大的行业，其成长空间也大。

E. 行业在空间的转移活动。行业在空间转移活动停止，一般可以说明行业成长达到市场需求边界，成长期也就进入尾声。

F. 产业组织变化活动。在行业成长过程中，一般伴随着行业中企业组织不断向集团化、大型化方向发展。

### ③ 影响行业兴衰的主要因素

一个行业的兴衰会受到技术进步、产业政策、产业组织创新、社会习惯改变和经济全球化等因素的影响而发生变化，这些因素都会对行业在其生命周期上的发展轨迹构成影响。基金管理人将密切关注可能影响各行业兴衰发展变化的因素，及时发现并积极投资于处于高速增长期的行业。

## 3. 个股投资策略

个股投资策略是对于行业配置策略的具体落实。本基金将在行业配置策略的框架下，精选优质股票构建投资组合，在获取股票行业配置收益的同时，最大化个股投资收益。

### （1）备选股票库

备选股票库由公司投资研究团队负责建立和维护。投资研究团队通过分析上市公司公告信息、上市公司所处行业考察、上市公司实地调研等，预测上市公司未来盈利成长前景，并据此申请将股票纳入备选股票库，履行股票入库审批程序；同时，根据行业和上市公司基本面的变化对备选股票库进行动态维护和更新。

### （2）个股的选择

在完成行业配置的基础上，本基金将以“优中选优”的思路选择优质行业中的优质公司进行投资。以上市公司的历史成长性和未来两年的预期成长性为核心，通过对上市公司所在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状

况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行分解评估，选择那些短期内利润增长速度高于同行业平均水平，并有可能在中长期保持较高增长势头的企业进行投资。

在个股选择过程中，本基金将挑选出符合基金投资规模和流动性需要的股票。本基金将根据各个行业的不同行业特征，选择合适的股票估值方法，包括PE、PB、PEG、EV/EBITDA等，与国内外同行业类似公司进行比较，排除股价被大幅高估的股票，主要投资估值处于合理水平或被低估的公司。

#### 4. 固定收益类证券投资策略

本基金根据对利率走势的预判，对固定收益类资产组合的久期进行积极管理。当预期利率下降时，增加组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；当预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

本基金在确定固定收益类资产组合久期后，针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构，包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整。

#### 5. 权证及其他品种投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

## （二）投资决策

### 1. 投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

### 2. 投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

### 3. 投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，主要负责评价并

批准基金的资产配置提案；协同风险控制委员会，审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险，并在必要时做出修改。

投资总监全面负责公司基金投资管理业务，协调所有基金的投资活动，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理负责通过与研究部的通力合作，拟定资产配置提案提交投资决策委员会；并负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

#### 4. 投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

#### 5. 风险分析与绩效评估

数量分析师负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

#### 6. 组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

## 九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 × 75% + 中证全债指数收益率 × 25%

## 十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人广发银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2012 年第 3 季度报告，所载数据截至 2012 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 158,477,450.10 | 62.90        |
|    | 其中：股票             | 158,477,450.10 | 62.90        |
| 2  | 固定收益投资            | 106,430.00     | 0.04         |
|    | 其中：债券             | 106,430.00     | 0.04         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 4  | 买入返售金融资产          | 25,000,000.00  | 9.92         |
|    | 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 | 68,301,964.70  | 27.11  |
| 6 | 其他各项资产       | 64,471.80      | 0.03   |
| 7 | 合计           | 251,950,316.60 | 100.00 |

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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       | -             | -            |
| B   | 采掘业            | 3,195,840.20  | 1.29         |
| C   | 制造业            | 85,104,866.98 | 34.22        |
| C0  | 食品、饮料          | 19,725,577.20 | 7.93         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 4,666,272.84  | 1.88         |
| C2  | 木材、家具          | -             | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | -             | -            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 5,818,339.49  | 2.34         |
| C5  | 电子             | 15,246,741.80 | 6.13         |
| C6  | 金属、非金属         | 17,419,833.94 | 7.00         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 5,894,988.21  | 2.37         |
| C8  | 医药、生物制品        | 16,333,113.50 | 6.57         |
| C99 | 其他制造业          | -             | -            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 11,916,140.20 | 4.79         |
| E   | 建筑业            | -             | -            |
| F   | 交通运输、仓储业       | 10,980,000.00 | 4.42         |



|   |         |                |       |
|---|---------|----------------|-------|
| G | 信息技术业   | 21,632,652.16  | 8.70  |
| H | 批发和零售贸易 | -              | -     |
| I | 金融、保险业  | 4,808,780.16   | 1.93  |
| J | 房地产业    | 16,014,710.40  | 6.44  |
| K | 社会服务业   | 4,809,000.00   | 1.93  |
| L | 传播与文化产业 | 15,460.00      | 0.01  |
| M | 综合类     | -              | -     |
|   | 合计      | 158,477,450.10 | 63.72 |

### 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名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值(元)       | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 66,934    | 16,452,377.20 | 6.62                 |
| 2  | 000024 | 招商地产 | 769,938   | 16,014,710.40 | 6.44                 |
| 3  | 601006 | 大秦铁路 | 1,800,000 | 10,980,000.00 | 4.42                 |
| 4  | 600570 | 恒生电子 | 799,969   | 10,063,610.02 | 4.05                 |
| 5  | 600021 | 上海电力 | 1,546,987 | 7,116,140.20  | 2.86                 |
| 6  | 002671 | 龙泉股份 | 251,266   | 6,208,782.86  | 2.50                 |
| 7  | 002564 | 张化机  | 499,999   | 5,894,988.21  | 2.37                 |
| 8  | 300079 | 数码视讯 | 399,940   | 5,887,116.80  | 2.37                 |
| 9  | 300267 | 尔康制药 | 309,841   | 5,756,845.78  | 2.31                 |
| 10 | 002501 | 利源铝业 | 299,818   | 5,714,531.08  | 2.30                 |

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|------|---------|------------------|
|----|------|---------|------------------|

|   |           |            |      |
|---|-----------|------------|------|
| 1 | 国家债券      | 106,430.00 | 0.04 |
| 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       | -          | -    |
| 8 | 其他        | -          | -    |
| 9 | 合计        | 106,430.00 | 0.04 |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量<br>(张) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|-----------|------------|--------------|
| 1  | 010107 | 21国债(7) | 1,000     | 106,430.00 | 0.04         |
| 2  | -      | -       | -         | -          | -            |
| 3  | -      | -       | -         | -          | -            |
| 4  | -      | -       | -         | -          | -            |
| 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。

#### 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。

## 8 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 28,288.72 |
| 5  | 应收申购款   | 11,363.55 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | 24,819.53 |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 64,471.80 |

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5 报告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。

8.6 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。

## 十二、基金的业绩

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。

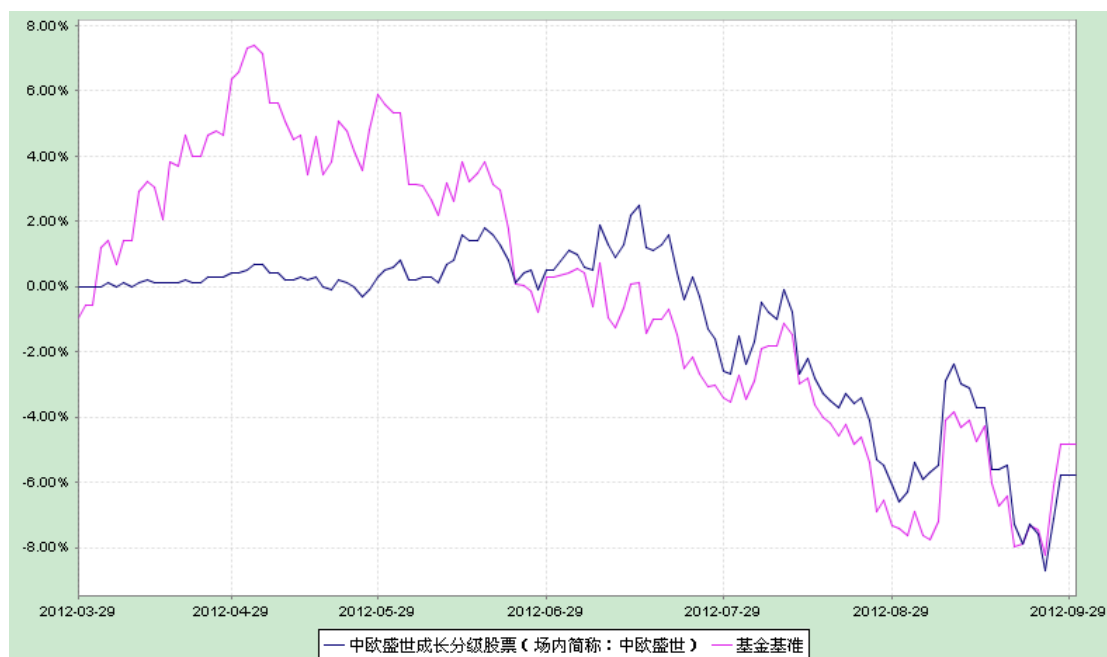
本基金合同生效日 2012 年 3 月 29 日，基金业绩截止日 2012 年 9 月 30 日。

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    |
|---------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2012.3.29-2012.9.30 | -5.80% | 0.65%     | -4.85%     | 0.86%         | -0.95% | -0.21% |

数据来源：中欧基金，wind

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2012 年 3 月 29 日。建仓期为 2012 年 3 月 29 日至 2012 年 9 月 28 日，目前本基金仍处于建仓期；截至本报告期末，基金合同生效不满一年。

### 十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；

3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市费；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费、托管费外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### （五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务，基金托管人不承担代扣代缴义务。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2012 年 2 月 11 日刊登的《中欧盛世成长分级股票型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

#### （一）“重要提示”部分

更新了本更新招募说明书所载内容的截止时间。

#### （二）“释义”部分

更新了《销售管理办法》的释义。

#### （三）“三、基金管理人”部分

1、更新了“（一）基金管理人概况”。

2、更新了“（二）主要人员情况”中董事长从业年限信息、高级管理人员信息、基金经理信息及公司投资决策委员会成员的基本信息。

#### （四）“四、基金托管人”部分

更新了“（一）基金托管人情况”中基金托管人的基本情况。

#### （五）“五、相关服务机构”部分

1、更新了直销机构的信息；

2、更新了代销机构的信息；

3、更新了会计师事务所和经办注册会计师的信息。

（六）“七、基金的募集”部分

- 1、增加了基金的募集信息。
- 2、删除了涉及募集期的描述。

（七）“八、基金合同的生效”部分

- 1、增加了基金合同的生效日期。
- 2、删除了涉及基金合同生效条件及基金募集失败的描述。

（八）“九、基金份额的上市交易”部分

增加了基金上市交易的时间。

（九）“十、基金份额的场外申购、转换与赎回”部分

增加了基金场外申购、赎回的时间。

（十）“十一、基金份额的场内申购和赎回”部分

增加了基金场内申购、赎回的时间。

（十一）“十三、基金的投资”部分

增加了“（十）基金投资组合报告”的内容，数据截至2012年9月30日。

（十二）“十四、基金的业绩”部分

增加了整章的信息，包括“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”和“基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至2012年9月30日。

（十三）“二十七、其他应披露事项”

增加了自2012年3月29日至2012年9月28日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自2012年3月29日至2012年9月28日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

| 序号 | 事项名称  | 披露日期      |
|----|---|-----------|
| 1  | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金合同生效公告                   | 2012.3.30 |
| 2  | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告 | 2012.4.24 |
| 3  | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之盛世A份额与盛世B份额上市交易公告书        | 2012.4.24 |
| 4  | 中欧基金管理有限公司关于中欧盛世成长分级股票型证券投资基金开通份额配对转换的公告    | 2012.4.24 |
| 5  | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金之盛世A份额与盛世B份额上市交易提示性公告      | 2012.4.27 |

|    |   |           |
|----|---|-----------|
| 6  | 关于中欧盛世成长分级股票型证券投资基金参与部分代销机构开展的电子渠道申购费率优惠活动的公告                 | 2012.4.27 |
| 7  | 关于中欧盛世成长分级股票型证券投资基金参与部分代销银行开展的基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告             | 2012.4.27 |
| 8  | 中欧基金管理有限公司关于成立北京分公司的公告  | 2012.5.17 |
| 9  | 中欧基金管理有限公司关于新任副总经理的公告   | 2012.6.1  |
| 10 | 中欧基金管理有限公司关于副总经理离任的公告   | 2012.6.2  |
| 11 | 中欧基金管理有限公司旗下基金2012年6月29日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告              | 2012.6.30 |
| 12 | 中欧基金管理有限公司旗下基金2012年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告              | 2012.7.1  |
| 13 | 中欧基金管理有限公司关于新增联讯证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告                        | 2012.7.2  |
| 14 | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在联讯证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告                    | 2012.7.2  |
| 15 | 中欧基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告                        | 2012.7.5  |
| 16 | 中欧基金管理有限公司关于新增深圳众禄基金销售有限公司为旗下基金代销机构并实施费率优惠的公告                 | 2012.7.13 |
| 17 | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳众禄基金销售有限公司开通基金转换业务的公告                    | 2012.7.13 |
| 18 | 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳众禄基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 2012.7.13 |
| 19 | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金2012年第2季度报告                                  | 2012.7.19 |
| 20 | 中欧基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告               | 2012.7.19 |
| 21 | 中欧基金管理有限公司关于新增华龙证券有限责任公司为旗下基金代销机构并同时开通定期定额投资业务的公告             | 2012.8.16 |
| 22 | 中欧盛世成长分级股票型证券投资基金2012年半年度报告                                   | 2012.8.24 |
| 23 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告           | 2012.8.27 |
| 24 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告               | 2012.8.29 |
| 25 | 中欧基金管理有限公司关于新增上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构并参与费率优惠活动的公告               | 2012.8.30 |
| 26 | 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网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告               | 2012.9.19 |
| 27 | 中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告  | 2012.9.22 |
| 28 | 中欧基金管理有限公司关于网上直销平台新增上海银联广发银行借记卡支付业务的公告                        | 2012.9.27 |



中欧基金管理有限公司

2012 年 11 月 12 日