

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 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更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中欧数据挖掘混合	
基金主代码	001990	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 13 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	375,472,414.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
下属分级基金的交易代码	001990	004234
报告期末下属分级基金的份额总额	169,908,974.29 份	205,563,439.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，通过定量与定性相结合的方法精选个股，并适当运用股指期货对冲系统性风险，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95588
传真	021-33830351	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	10、16 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
本期已实现收益	-4,290,943.64	-7,194,730.01
本期利润	12,607,871.47	1,435,057.27
加权平均基金份额本期利润	0.0638	0.0082
本期加权平均净值利润率	3.91%	0.53%
本期基金份额净值增长率	4.07%	3.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	54,725,799.80	51,767,811.99
期末可供分配基金份额利润	0.3221	0.2518
期末基金资产净值	273,112,963.60	313,906,666.77
期末基金份额净值	1.6074	1.5271

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	105.15%	82.11%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

中欧数据挖掘混合 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
过去一个月	2.22%	0.91%	-0.76%	0.89%	2.98%	0.02%
过去三个月	-3.02%	0.83%	-5.06%	0.78%	2.04%	0.05%
过去六个月	4.07%	0.79%	2.25%	0.75%	1.82%	0.04%
过去一年	-7.09%	0.96%	-6.60%	0.91%	-0.49%	0.05%
过去三年	18.43%	1.23%	2.58%	1.13%	15.85%	0.10%
自基金合同生效起至今	105.15%	1.23%	25.48%	1.02%	79.67%	0.21%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。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。

中欧数据挖掘混合 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
过去一个月	2.16%	0.91%	-0.76%	0.89%	2.92%	0.02%
过去三个月	-3.21%	0.83%	-5.06%	0.78%	1.85%	0.05%
过去六个月	3.67%	0.79%	2.25%	0.75%	1.42%	0.04%

过去一年	-7.82%	0.96%	-6.60%	0.91%	-1.22%	0.05%
过去三年	15.64%	1.23%	2.58%	1.13%	13.06%	0.10%
自基金份额运作日 至今	82.11%	1.27%	23.49%	1.07%	58.62%	0.20%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。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。

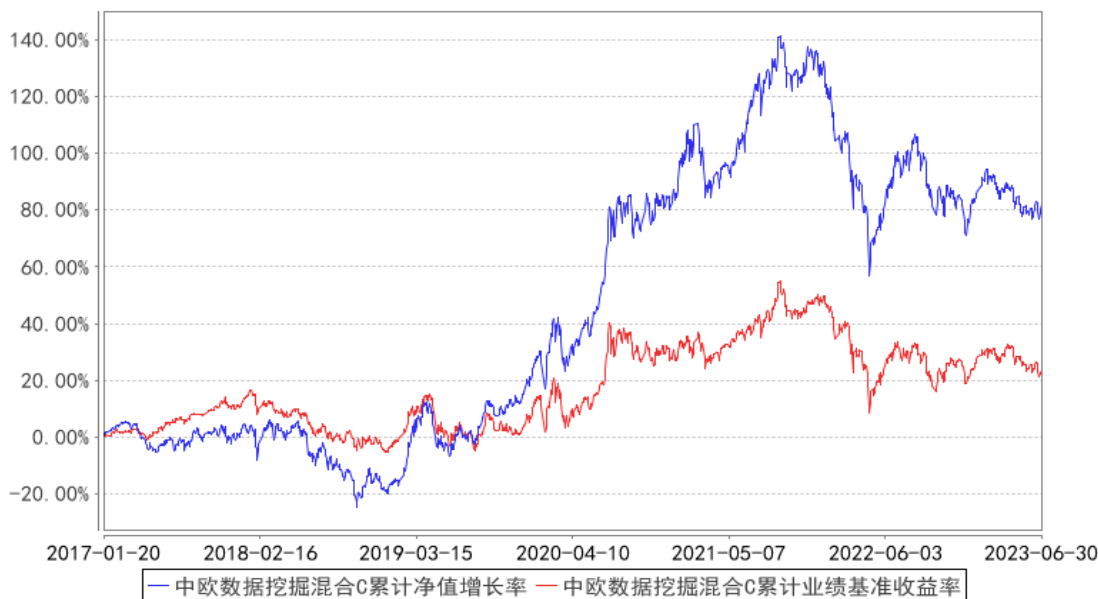
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧数据挖掘混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：“2019 年 4 月 26 日组合业绩比较基准变更为中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。”

中欧数据挖掘混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2019 年 4 月 26 日组合业绩比较基准变更为中证 500 指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。自 2017 年 1 月 19 日起本基金增加 C 类份额，图示日期为 2017 年 1 月 20 日至 2023 年 06 月 30 日。

§ 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 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 150 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
曲径	量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理	2016-01-13	-	16 年	历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
曲径	公募基金	7	6,329,179,335.99	2016年1月13日
	私募资产管理计划	2	245,811,705.77	2021年12月14日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	6,574,991,041.76	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2023-04-21；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0只，离任时间：无；

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、本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

本报告期内，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》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，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。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有69次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

回顾上半年，市场波动加剧，在宏观经济实现恢复性增长的背景下，各行业景气程度较为分化。非制造业 PMI 连续处于荣枯线上方，反映了消费和服务业的景气复苏强于制造业。在我国高质量发展的大原则下，对于传统的刺激政策较为克制，避免了大规模的低效投资，财政政策向战略新兴产业倾斜，彰显了产业结构转型的决心。同时，叠加中美交流加深，国际航线的逐步恢复，以及美联储加息进入尾声，我们认为展望未来，应保持比年初更为乐观的心态，在短期波动中逢低布局权益投资。

在报告期内，本基金以中证 500 指数的行业配置为锚定，保持了均衡的风格和行业配置，对于基准的跟踪误差控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。我们遵循基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式，以企业未来一个季度到一年的业绩为抓手，期待的是业绩持续景气，或者业绩的反转超过了市场预期，而带来的股价上涨的收益。报告期内，我们加深了与产业行业专家的交流，以提高模型对基本判断的前瞻性。未来我们将借鉴优秀的主动投资者的较为长期的投资视角，将他们对行业和行业周期的逻辑纳入量化体系内，推动基本面量化策略向更前瞻性的视角演进。今年很多基本面驱动模型，超额收益都不甚理想。我们必须承认，任何一种寻找 Alpha 方式，都有顺风的市场环境，也会有逆风市场环境。回顾上半年，微盘股，以及传统技术指标，包括反转因子，都体现了更好的超额收益。但我们认为，如果盲目去追求近期强势的风格，往往会切换在了高点。我们最终选择坚持中长期有效的 Alpha 来源，根据自己的禀赋和研究资源，将自己更擅长的基本面逻辑模型更上一层，通过多元量化模型，选择优秀的企业，相信他们的收入和利润增长，会映射到合理的投资回报。

具体操作上，本基金适度高配模型预测的景气行业，个股选择上以跑赢指数为目标，通过基本面驱动和数据赋能的选股方式，力争获取超越基准的超额回报。本基金的整体回报可以理解为中证 500 指数 Beta 收益，叠加个股选择和行业配置的 Alpha 收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 4.07%，同期业绩比较基准收益率为 2.25%；基金 C 类份额净值增长率为 3.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济仍会维持复苏趋势，股债相比，更看好股票的性价比。当前，货币政策较为宽松；财政政策相对稳健，财政工具箱中储备仍多；政策对经济的呵护也愈发明显，逆周期调节在逐步推出。我们认为小盘成长板块和顺周期板块，会有更多投资机会，本基金也将

依据量化模型进行配置。

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总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	35,981,334.98	34,728,136.46
结算备付金		14,846,953.28	8,511,291.91
存出保证金		3,722,527.75	213,415.13
交易性金融资产	6.4.7.2	496,462,338.77	508,209,677.90
其中：股票投资		496,462,338.77	467,401,162.83
基金投资		-	-
债券投资		-	40,808,515.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	19,984,723.29	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		19,373,985.09	-
应收股利		-	-
应收申购款		152,465.33	160,991.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		590,524,328.49	551,823,512.99
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
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		-	-
应付清算款		-	30,558,821.66
应付赎回款		506,529.70	119,585.84
应付管理人报酬		704,917.63	829,590.18
应付托管费		117,486.29	138,265.03
应付销售服务费		196,494.13	89,516.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,979,270.37	1,581,312.93
负债合计		3,504,698.12	33,317,091.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	375,472,414.28	341,756,881.67
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	211,547,216.09	176,749,539.42
净资产合计		587,019,630.37	518,506,421.09
负债和净资产总计		590,524,328.49	551,823,512.99

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 375,472,414.28 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.6074 元，基金份额总额 169,908,974.29 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.5271 元，基金份额总额 205,563,439.99 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,367,233.22	-539,457,937.04
1. 利息收入		400,101.28	365,553.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	166,872.07	365,553.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		233,229.21	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,758,968.27	-517,102,406.91
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,557,612.03	-512,526,802.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	75,758.08	525,274.32
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	37,291.29	-11,265,551.84
股利收益	6.4.7.14	4,685,594.39	6,164,673.21
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	25,528,602.39	-25,429,524.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	197,497.82	2,708,440.91
减：二、营业总支出		6,324,304.48	18,479,602.55
1. 管理人报酬		4,403,746.75	13,957,035.48
2. 托管费		733,957.81	2,326,172.57
3. 销售服务费		1,068,813.40	2,081,921.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,474.03	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,474.03	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,160.54	-
8. 其他费用	6.4.7.18	109,151.95	114,472.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,042,928.74	-557,937,539.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,042,928.74	-557,937,539.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,042,928.74	-557,937,539.59

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	341,756,881.67	-	176,749,539.42	518,506,421.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	341,756,881.67	-	176,749,539.42	518,506,421.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,715,532.61	-	34,797,676.67	68,513,209.28
（一）、综合收益总额	-	-	14,042,928.74	14,042,928.74
（二）、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）	33,715,532.61	-	20,754,747.93	54,470,280.54
其中：1. 基金申购款	192,734,386.69	-	117,937,295.10	310,671,681.79
2. 基金赎回款	-159,018,854.08	-	-97,182,547.17	-256,201,401.25
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	375,472,414.28	-	211,547,216.09	587,019,630.37
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,631,149,346.89	-	1,634,070,900.56	3,265,220,247.45

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,631,149,346.89	-	1,634,070,900.56	3,265,220,247.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,082,790,125.04	-	-1,242,261,281.91	-2,325,051,406.95
（一）、综合收益总额	-	-	-557,937,539.59	-557,937,539.59
（二）、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）	-1,082,790,125.04	-	-684,323,742.32	-1,767,113,867.36
其中：1. 基金申购款	152,167,784.39	-	113,968,353.53	266,136,137.92
2. 基金赎回款	-1,234,957,909.43	-	-798,292,095.85	-2,033,250,005.28
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	548,359,221.85	-	391,809,618.65	940,168,840.50

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：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧数据挖掘多因子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[2015]2423 号文《关于准予中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《中欧数据挖掘多因子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 506,108,438.33 元。经向中国证监会备案，《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 506,409,681.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 301,243.65 基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货、股票期权等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+中债综合指数收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证

券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	35,981,334.98
等于：本金	35,976,984.48
加：应计利息	4,350.50
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	35,981,334.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	493,766,433.93	-	496,462,338.77	2,695,904.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	493,766,433.93	-	496,462,338.77	2,695,904.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	29,264,770.91	-	-	
其中：股指期货投资	29,264,770.91	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	29,264,770.91	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2312	IC2312	8.00	9,478,720.00	-268,130.91
IM2309	IM2309	13.00	16,994,640.00	47,400.00
IM2312	IM2312	2.00	2,591,840.00	21,160.00
合计				-199,570.91
减：可抵销期货 暂收款				-199,570.91
净额				0.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	19,984,723.29	-
银行间市场	-	-
合计	19,984,723.29	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	114.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,879,977.03
其中：交易所市场	1,879,977.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	39,671.58
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	1,979,270.37

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧数据挖掘混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,546,961.64	210,546,961.64
本期申购	47,095,843.91	47,095,843.91
本期赎回（以“-”号填列）	-87,733,831.26	-87,733,831.26
本期末	169,908,974.29	169,908,974.29

中欧数据挖掘混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,209,920.03	131,209,920.03
本期申购	145,638,542.78	145,638,542.78
本期赎回（以“-”号填列）	-71,285,022.82	-71,285,022.82
本期末	205,563,439.99	205,563,439.99

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧数据挖掘混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71,806,129.36	42,863,856.13	114,669,985.49
本期利润	-4,290,943.64	16,898,815.11	12,607,871.47
本期基金份额交易产生的变动数	-12,789,385.92	-11,284,481.73	-24,073,867.65
其中：基金申购款	17,382,493.05	13,034,096.93	30,416,589.98
基金赎回款	-30,171,878.97	-24,318,578.66	-54,490,457.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,725,799.80	48,478,189.51	103,203,989.31

中欧数据挖掘混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,192,384.81	25,887,169.12	62,079,553.93
本期利润	-7,194,730.01	8,629,787.28	1,435,057.27
本期基金份额交易产生的变动数	22,770,157.19	22,058,458.39	44,828,615.58
其中：基金申购款	43,821,945.32	43,698,759.80	87,520,705.12
基金赎回款	-21,051,788.13	-21,640,301.41	-42,692,089.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,767,811.99	56,575,414.79	108,343,226.78

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	88,665.19
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	76,412.40
其他	1,794.48
合计	166,872.07

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	2,011,960,379.97
减：卖出股票成本总额	2,017,291,427.10
减：交易费用	5,226,564.90
买卖股票差价收入	-10,557,612.03

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	17,178.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	58,580.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	75,758.08

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	40,827,193.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,942,720.00
减：应计利息总额	825,693.15
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	58,580.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	37,291.29

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,685,594.39
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,685,594.39

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	25,728,173.30
股票投资	25,785,453.30
债券投资	-57,280.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-199,570.91
权证投资	-
期货投资	-199,570.91
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	25,528,602.39

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	183,155.69
基金转换费收入	14,342.13
合计	197,497.82

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	973.00
账户维护费	9,000.00
合计	109,151.95

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的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，因公司股东发生股权转让，公司关联方变动情况如下：

1、自 2023 年 5 月 11 日起，万盛基业投资有限责任公司不再是我司关联方，新增关联方为上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及 7 名自然人股东。

2、自 2023 年 6 月 1 日起，Unione di Banche Italiane S.p.A. 不再是我司关联方，新增关联方为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）。

3、变更后，与本基金关系为“基金管理人的股东”的关联方名单更新如下：
WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）、19 名自然人股东。

4、除上述变更外，其他关联方报告期内未发生变化。

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（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	132,205,163.14	3.29	566,371,041.56	4.49

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）
国都证券	63,100,000.00	2.91	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

无。

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 2023年1月1日至2023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	96,676.66	3.34	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	414,193.79	4.49	328,958.58	8.65

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,403,746.75	13,957,035.48
其中：支付销售机构的客户维护费	892,029.24	1,896,361.14

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	733,957.81	2,326,172.57

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	合计
工商银行	-	2.78	2.78
中欧财富	-	25,985.42	25,985.42
中欧基金	-	663,683.41	663,683.41
合计	-	689,671.61	689,671.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	合计
工商银行	-	-	-
中欧财富	-	-	-
中欧基金	-	648,485.35	648,485.35
合计	-	648,485.35	648,485.35

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日

内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

中欧数据挖掘混合 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	1,450,628.30	0.85%	1,450,628.30	0.69%

份额单位：份

中欧数据挖掘混合 C

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	620.08	0.00%	620.08	0.00%

注：1、截止本报告期末，自然人股东持有本基金 C 类份额实际占比为 0.0003%，截止上年度末，自然人股东持有本基金 C 类份额实际占比为 0.0005%，上述展示系四舍五入的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国工商银行股份有限公司	35,981,334.98	88,665.19	43,765,543.61	274,691.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威	2023年6月	6个月	新股流通	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

	股份	月 28 日		受限							
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-	
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	571	28,550.00	17,535.41	-	
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	983	30,325.55	23,228.29	-	
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-	
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-	
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-	
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-	
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-	
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-	
301293	三博	2023 年 4 月	6 个月	新股流通	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	

	脑科	月 25 日		受限							
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-	
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	637	20,600.58	20,294.82	-	
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-	
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	337	25,881.60	36,379.15	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-	
301337	亚华	2023 年 5 月	6 个月	新股流通	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	

	电子	月 16 日		受限							
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	183	13,441.35	8,535.12	-	
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-	
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	607	14,428.39	26,034.23	-	
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-	
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-	
301395	仁信	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-	

	新材	月 21 日		受限							
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	623	12,453.77	10,528.70	-	
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	3,589	206,941.74	206,941.74	-	
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	399	23,006.34	23,006.34	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	
603172	浙江万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	

688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,777	75,011.22	68,212.62	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	708	16,708.80	45,786.36	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	997	37,766.36	29,401.53	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	6,645	37,810.05	35,949.45	-
688472	阿特斯阳光电力	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,303	25,563.30	39,243.12	-
688479	用友汽车信息科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688512	慧	2023	6个月	新股	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

	智微电子	年5月8日		流通受限							
688523	航天环宇科技	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	403	17,599.01	21,379.15	-	
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	895	18,947.15	21,032.50	-	
688562	航天软件股份	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	704	21,303.04	17,832.32	-	
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	223	30,283.40	26,851.43	-	
688581	安杰思医学	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	638	17,060.12	25,953.84	-	
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	

		日								
688620	安凯微电子	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	158	19,889.04	13,712.82	-
688629	四川华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600530	*ST 交昂	2023年5月4日	重大事项停牌	2.49	2023年7月5日	2.37	329,200	1,108,358.00	819,708.00	-

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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。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，督察长、监察稽核部、风险管理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进行审议和决策。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，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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，本基金所持大部分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。于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

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、外汇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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	35,981,334.98	-	-	-	35,981,334.98
结算备付金	14,846,953.28	-	-	-	14,846,953.28
存出保证金	234,703.75	-	-	3,487,824.00	3,722,527.75
交易性金融资产	-	-	-	496,462,338.77	496,462,338.77
买入返售金融资产	19,984,723.29	-	-	-	19,984,723.29
应收申购款	-	-	-	152,465.33	152,465.33
应收清算款	-	-	-	19,373,985.09	19,373,985.09
资产总计	71,047,715.30	-	-	519,476,613.19	590,524,328.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	506,529.70	506,529.70
应付管理人报酬	-	-	-	704,917.63	704,917.63
应付托管费	-	-	-	117,486.29	117,486.29
应付销售服务费	-	-	-	196,494.13	196,494.13
其他负债	-	-	-	1,979,270.37	1,979,270.37
负债总计	-	-	-	3,504,698.12	3,504,698.12
利率敏感度缺口	71,047,715.30	-	-	515,971,915.07	587,019,630.37
上年度末 2022 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	34,728,136.46	-	-	-	34,728,136.46
结算备付金	8,511,291.91	-	-	-	8,511,291.91
存出保证金	213,415.13	-	-	-	213,415.13
交易性金融资产	40,808,515.07	-	-	467,401,162.83	508,209,677.90
应收申购款	-	-	-	160,991.59	160,991.59
资产总计	84,261,358.57	-	-	467,562,154.42	551,823,512.99
负债					
应付清算款	-	-	-	30,558,821.66	30,558,821.66
应付赎回款	-	-	-	119,585.84	119,585.84
应付管理人报酬	-	-	-	829,590.18	829,590.18
应付托管费	-	-	-	138,265.03	138,265.03
应付销售服务费	-	-	-	89,516.26	89,516.26
其他负债	-	-	-	1,581,312.93	1,581,312.93
负债总计	-	-	-	33,317,091.90	33,317,091.90
利率敏感度缺口	84,261,358.57	-	-	434,245,062.52	518,506,421.09

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者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：7.87%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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和外汇汇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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	496,462,338.77	84.57	467,401,162.83	90.14
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	496,462,338.77	84.57	467,401,162.83	90.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	28,868,490.44	25,536,756.05
	业绩比较基准下降5%	-28,868,490.44	-25,536,756.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	493,832,816.39	463,360,573.68
第二层次	1,560,664.06	40,808,515.07
第三层次	1,068,858.32	4,040,589.15
合计	496,462,338.77	508,209,677.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。本财务报表已于 2023 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	496,462,338.77	84.07
	其中：股票	496,462,338.77	84.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	19,984,723.29	3.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	50,828,288.26	8.61
8	其他各项资产	23,248,978.17	3.94
9	合计	590,524,328.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	12,572,870.63	2.14
B	采矿业	11,289,165.00	1.92
C	制造业	346,797,920.15	59.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,952,581.00	1.87
E	建筑业	5,932,384.50	1.01

F	批发和零售业	20,382,133.25	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	4,002,682.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,298,141.68	6.86
J	金融业	12,242,907.00	2.09
K	房地产业	2,966,364.00	0.51
L	租赁和商务服务业	7,900,757.80	1.35
M	科学研究和技术服务业	5,195,276.13	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	11,521,163.17	1.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	797,342.60	0.14
Q	卫生和社会工作	1,522,444.86	0.26
R	文化、体育和娱乐业	1,398,775.00	0.24
S	综合	689,430.00	0.12
	合计	496,462,338.77	84.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002714	牧原股份	126,600	5,336,190.00	0.91
2	002518	科士达	112,100	4,485,121.00	0.76
3	603477	巨星农牧	122,200	4,075,370.00	0.69
4	002536	飞龙股份	270,900	4,063,500.00	0.69
5	600483	福能股份	331,100	3,824,205.00	0.65
6	601633	长城汽车	151,300	3,808,221.00	0.65
7	002885	京泉华	163,800	3,577,392.00	0.61
8	600353	旭光电子	423,160	3,469,912.00	0.59
9	000860	顺鑫农业	100,200	3,375,738.00	0.58
10	601699	潞安环能	206,600	3,371,712.00	0.57
11	605168	三人行	37,120	3,190,092.80	0.54
12	300811	铂科新材	53,460	3,177,662.40	0.54
13	002234	民和股份	173,603	3,161,310.63	0.54
14	300592	华凯易佰	115,800	3,152,076.00	0.54
15	000409	云鼎科技	315,100	3,147,849.00	0.54
16	002371	北方华创	9,500	3,017,675.00	0.51
17	601208	东材科技	233,000	2,959,100.00	0.50
18	002728	特一药业	193,020	2,943,555.00	0.50
19	002356	赫美集团	672,600	2,932,536.00	0.50
20	002179	中航光电	64,290	2,915,551.50	0.50

21	601636	旗滨集团	335,300	2,890,286.00	0.49
22	002779	中坚科技	104,900	2,759,919.00	0.47
23	300638	广和通	116,360	2,639,044.80	0.45
24	300613	富瀚微	46,500	2,638,410.00	0.45
25	603529	爱玛科技	81,646	2,630,634.12	0.45
26	000733	振华科技	27,200	2,607,120.00	0.44
27	688687	北京凯因科技	88,316	2,605,322.00	0.44
28	603757	大元泵业	86,068	2,568,269.12	0.44
29	688078	龙软科技	49,745	2,564,354.75	0.44
30	002056	横店东磁	139,600	2,542,116.00	0.43
31	301030	仕净科技	36,600	2,529,060.00	0.43
32	000778	新兴铸管	607,700	2,479,416.00	0.42
33	603338	浙江鼎力	43,600	2,442,036.00	0.42
34	000739	普洛药业	137,300	2,435,702.00	0.41
35	002311	海大集团	51,400	2,407,576.00	0.41
36	300103	达刚控股	384,400	2,360,216.00	0.40
37	000663	永安林业	189,600	2,309,328.00	0.39
38	000661	长春高新	16,500	2,248,950.00	0.38
39	603300	华铁应急	412,040	2,245,618.00	0.38
40	300411	金盾股份	339,800	2,225,690.00	0.38
41	300419	浩丰科技	355,500	2,225,430.00	0.38
42	000811	冰轮环境	141,100	2,223,736.00	0.38
43	002463	沪电股份	105,600	2,211,264.00	0.38
44	688186	张家港广大特材	67,068	2,181,722.04	0.37
45	300034	钢研高纳	54,700	2,154,633.00	0.37
46	600426	华鲁恒升	70,100	2,147,163.00	0.37
47	603611	诺力股份	81,500	2,146,710.00	0.37
48	002334	英威腾	166,100	2,116,114.00	0.36
49	300838	浙江力诺	115,300	2,106,531.00	0.36
50	600488	津药药业	374,800	2,106,376.00	0.36
51	600004	白云机场	143,100	2,052,054.00	0.35
52	688658	悦康药业	98,125	2,041,981.25	0.35
53	000568	泸州老窖	9,600	2,011,872.00	0.34
54	605077	华康股份	74,700	1,978,056.00	0.34
55	300779	惠城环保	37,000	1,971,730.00	0.34
56	688529	大连豪森股份	75,484	1,971,642.08	0.34
57	601318	中国平安	41,800	1,939,520.00	0.33
58	300521	爱司凯	151,700	1,937,209.00	0.33
59	000683	远兴能源	268,500	1,930,515.00	0.33
60	000962	东方钨业	157,000	1,923,250.00	0.33
61	300387	富邦股份	263,300	1,916,824.00	0.33
62	002833	弘亚数控	97,400	1,914,884.00	0.33
63	603059	倍加洁	84,000	1,910,160.00	0.33

64	002469	三维化学	307,900	1,893,585.00	0.32
65	603602	纵横通信	153,900	1,891,431.00	0.32
66	601899	紫金矿业	165,800	1,885,146.00	0.32
67	002616	长青集团	366,100	1,874,432.00	0.32
68	002370	亚太药业	458,200	1,869,456.00	0.32
69	000554	泰山石油	327,100	1,841,573.00	0.31
70	688276	长春百克生物科技	29,400	1,840,440.00	0.31
71	603215	比依股份	101,400	1,819,116.00	0.31
72	002887	绿茵生态	195,900	1,780,731.00	0.30
73	600857	宁波中百	179,300	1,775,070.00	0.30
74	688569	铁科轨道	41,973	1,765,804.11	0.30
75	603551	奥普家居	136,400	1,763,652.00	0.30
76	601336	新华保险	47,900	1,761,283.00	0.30
77	000820	神雾节能	468,500	1,747,505.00	0.30
78	300389	艾比森	85,100	1,733,487.00	0.30
79	300385	雪浪环境	282,700	1,730,124.00	0.29
80	002141	贤丰控股	524,100	1,724,289.00	0.29
81	601168	西部矿业	163,700	1,720,487.00	0.29
82	600276	恒瑞医药	35,900	1,719,610.00	0.29
83	603421	鼎信通讯	163,300	1,706,485.00	0.29
84	300333	兆日科技	256,600	1,701,258.00	0.29
85	300771	智莱科技	154,500	1,682,505.00	0.29
86	300546	雄帝科技	91,100	1,678,973.00	0.29
87	601600	中国铝业	303,500	1,666,215.00	0.28
88	300417	南华仪器	155,100	1,665,774.00	0.28
89	603105	芯能科技	98,100	1,656,909.00	0.28
90	600807	济南高新	558,000	1,646,100.00	0.28
91	002212	天融信	168,900	1,638,330.00	0.28
92	000915	华特达因	45,700	1,612,753.00	0.27
93	603811	诚意药业	126,840	1,576,621.20	0.27
94	000626	远大控股	211,600	1,576,420.00	0.27
95	603669	灵康药业	338,800	1,575,420.00	0.27
96	603810	丰山集团	113,600	1,564,272.00	0.27
97	603909	建发合诚	117,100	1,560,943.00	0.27
98	300004	南风股份	286,500	1,547,100.00	0.26
99	600129	太极集团	26,000	1,546,740.00	0.26
100	000888	峨眉山 A	134,600	1,542,516.00	0.26
101	603328	依顿电子	185,200	1,533,456.00	0.26
102	000516	国际医学	178,200	1,498,662.00	0.26
103	688697	纽威数控装备	57,900	1,495,557.00	0.25
104	688026	洁特生物股份	81,405	1,487,269.35	0.25
105	300126	锐奇股份	227,900	1,479,071.00	0.25
106	300161	华中数控	27,300	1,461,096.00	0.25

107	002072	凯瑞德	233,100	1,459,206.00	0.25
108	002174	游族网络	86,100	1,446,480.00	0.25
109	300908	仲景食品	31,700	1,437,595.00	0.24
110	600729	重庆百货	45,500	1,430,520.00	0.24
111	605009	豪悦护理	29,447	1,413,456.00	0.24
112	002533	金杯电工	172,400	1,406,784.00	0.24
113	300795	米奥会展	33,400	1,393,114.00	0.24
114	688458	美芯晟科技	14,300	1,375,231.00	0.23
115	300443	金雷股份	38,700	1,371,915.00	0.23
116	002737	葵花药业	55,800	1,358,172.00	0.23
117	300405	科隆股份	247,000	1,351,090.00	0.23
118	688550	瑞联新材料	34,020	1,347,192.00	0.23
119	600053	九鼎投资	107,600	1,331,012.00	0.23
120	300262	巴安水务	495,900	1,319,094.00	0.22
121	600323	瀚蓝环境	69,100	1,308,063.00	0.22
122	300540	蜀道装备	47,800	1,294,424.00	0.22
123	300729	乐歌股份	72,300	1,289,832.00	0.22
124	600098	广州发展	208,500	1,288,530.00	0.22
125	300265	通光线缆	121,800	1,264,284.00	0.22
126	002733	雄韬股份	73,000	1,262,170.00	0.22
127	603778	乾景园林	232,900	1,257,660.00	0.21
128	002555	三七互娱	35,900	1,252,192.00	0.21
129	603083	剑桥科技	19,900	1,251,511.00	0.21
130	300037	新宙邦	24,100	1,250,549.00	0.21
131	000928	中钢国际	129,100	1,245,815.00	0.21
132	002937	兴瑞科技	49,900	1,227,540.00	0.21
133	300281	金明精机	227,000	1,216,720.00	0.21
134	002966	苏州银行	185,500	1,215,025.00	0.21
135	603081	大丰实业	65,100	1,196,538.00	0.20
136	300812	易天股份	47,800	1,195,000.00	0.20
137	603659	璞泰来	31,265	1,194,948.30	0.20
138	600519	贵州茅台	700	1,183,700.00	0.20
139	300807	天迈科技	40,400	1,181,700.00	0.20
140	003000	劲仔食品	93,300	1,174,647.00	0.20
141	000922	佳电股份	88,400	1,163,344.00	0.20
142	600725	云维股份	432,300	1,162,887.00	0.20
143	002517	恺英网络	73,600	1,158,464.00	0.20
144	000729	燕京啤酒	92,400	1,152,228.00	0.20
145	002459	晶澳科技	27,100	1,130,070.00	0.19
146	003006	百亚股份	65,000	1,123,200.00	0.19
147	600886	国投电力	87,600	1,108,140.00	0.19
148	300718	长盛轴承	49,300	1,096,925.00	0.19
149	300622	博士眼镜	46,100	1,087,960.00	0.19

150	002877	智能自控	105,700	1,071,798.00	0.18
151	301004	嘉益股份	27,600	1,070,880.00	0.18
152	603889	新澳股份	141,700	1,064,167.00	0.18
153	600845	宝信软件	20,905	1,062,183.05	0.18
154	688676	海南金盘智能科技	34,900	1,057,121.00	0.18
155	002917	金奥博	85,500	1,056,780.00	0.18
156	300502	新易盛	15,400	1,046,738.00	0.18
157	002130	沃尔核材	128,900	1,046,668.00	0.18
158	605598	上海港湾	19,800	1,042,668.00	0.18
159	300593	新雷能	45,500	1,042,405.00	0.18
160	603713	密尔克卫	11,600	1,033,444.00	0.18
161	300532	今天国际	50,000	1,028,000.00	0.18
162	002338	奥普光电	24,300	1,024,245.00	0.17
163	000066	中国长城	74,000	1,023,420.00	0.17
164	603516	淳中科技	46,400	1,023,120.00	0.17
165	002731	萃华珠宝	71,400	1,018,878.00	0.17
166	003008	开普检测	34,800	999,804.00	0.17
167	002129	TCL 中环	30,000	996,000.00	0.17
168	603266	天龙股份	71,600	995,956.00	0.17
169	002633	申科股份	94,200	987,216.00	0.17
170	603676	卫信康	71,300	985,366.00	0.17
171	603444	吉比特	2,000	982,220.00	0.17
172	688670	金迪克生物	20,860	982,088.80	0.17
173	002709	天赐材料	23,800	980,322.00	0.17
174	600847	万里股份	80,100	978,021.00	0.17
175	003036	泰坦股份	72,500	977,300.00	0.17
176	002605	姚记科技	21,000	975,030.00	0.17
177	000977	浪潮信息	20,000	970,000.00	0.17
178	300950	德固特	45,700	968,840.00	0.17
179	688590	新致软件	42,500	966,025.00	0.16
180	603158	腾龙股份	125,800	963,628.00	0.16
181	002039	黔源电力	68,300	960,981.00	0.16
182	600101	明星电力	100,900	959,559.00	0.16
183	002161	远望谷	184,000	958,640.00	0.16
184	002057	中钢天源	91,100	956,550.00	0.16
185	002105	信隆健康	160,600	955,570.00	0.16
186	688981	中芯国际	18,900	954,828.00	0.16
187	300157	恒泰艾普	296,300	954,086.00	0.16
188	002629	仁智股份	261,300	953,745.00	0.16
189	003017	大洋生物	28,200	948,930.00	0.16
190	603787	新日股份	56,300	946,403.00	0.16
191	600232	金鹰股份	173,300	946,218.00	0.16
192	688305	科德数控	9,400	942,444.00	0.16

193	300689	澄天伟业	39,800	930,126.00	0.16
194	301076	新瀚新材	47,300	928,026.00	0.16
195	002850	科达利	7,000	925,750.00	0.16
196	600626	申达股份	268,200	925,290.00	0.16
197	600815	厦工股份	342,700	925,290.00	0.16
198	002282	博深股份	121,400	921,426.00	0.16
199	002682	龙洲股份	224,800	917,184.00	0.16
200	600356	恒丰纸业	116,700	913,761.00	0.16
201	002256	兆新股份	419,000	913,420.00	0.16
202	300462	华铭智能	77,200	906,328.00	0.15
203	603667	五洲新春	60,800	904,704.00	0.15
204	002136	安纳达	79,100	900,158.00	0.15
205	600250	南纺股份	143,700	892,377.00	0.15
206	603856	东宏股份	67,500	890,325.00	0.15
207	600663	陆家嘴	90,200	890,274.00	0.15
208	603707	健友股份	65,930	890,055.00	0.15
209	002495	佳隆股份	363,000	885,720.00	0.15
210	600965	福成股份	139,900	885,567.00	0.15
211	601233	桐昆股份	66,600	882,450.00	0.15
212	300117	嘉寓股份	283,800	879,780.00	0.15
213	300413	芒果超媒	25,700	879,197.00	0.15
214	002046	国机精工	68,900	879,164.00	0.15
215	600379	宝光股份	85,900	876,180.00	0.15
216	301106	骏成科技	24,500	872,690.00	0.15
217	002643	万润股份	50,100	872,241.00	0.15
218	000534	万泽股份	51,900	870,363.00	0.15
219	300270	中威电子	113,100	865,215.00	0.15
220	301286	侨源股份	29,200	861,400.00	0.15
221	301162	国能日新	10,900	859,792.00	0.15
222	600076	康欣新材	333,900	858,123.00	0.15
223	600984	建设机械	189,700	857,444.00	0.15
224	300491	通合科技	29,800	855,260.00	0.15
225	600036	招商银行	26,000	851,760.00	0.15
226	300408	三环集团	29,000	851,150.00	0.14
227	603040	新坐标	32,000	850,880.00	0.14
228	300711	广哈通信	56,840	850,326.40	0.14
229	601628	中国人寿	24,300	849,528.00	0.14
230	300315	掌趣科技	108,700	847,860.00	0.14
231	300418	昆仑万维	21,000	845,880.00	0.14
232	688793	倍轻松科技	15,600	840,840.00	0.14
233	600419	天润乳业	51,800	840,196.00	0.14
234	601601	中国太保	32,200	836,556.00	0.14
235	603896	寿仙谷	18,800	832,840.00	0.14

236	003011	海象新材	25,700	828,825.00	0.14
237	002957	科瑞技术	40,800	827,016.00	0.14
238	688120	华海清科	3,278	826,219.90	0.14
239	002560	通达股份	86,600	824,432.00	0.14
240	002624	完美世界	48,800	824,232.00	0.14
241	600458	时代新材	68,600	822,514.00	0.14
242	300105	龙源技术	122,400	821,304.00	0.14
243	300580	贝斯特	33,750	819,787.50	0.14
244	600530	交大昂立	329,200	819,708.00	0.14
245	000423	东阿阿胶	15,200	812,440.00	0.14
246	002959	小熊电器	9,700	809,950.00	0.14
247	688085	三友医疗	30,600	803,556.00	0.14
248	002852	道道全	62,100	802,953.00	0.14
249	688601	力芯微股份	17,032	802,207.20	0.14
250	301328	维峰电子	14,028	798,754.32	0.14
251	605098	行动教育	20,140	797,342.60	0.14
252	002439	启明星辰	26,700	794,592.00	0.14
253	300349	金卡智能	57,200	793,936.00	0.14
254	300275	梅安森	56,960	791,744.00	0.13
255	301085	亚康股份	11,200	790,048.00	0.13
256	301391	卡莱特	6,700	785,039.00	0.13
257	300832	新产业	13,300	784,700.00	0.13
258	300747	锐科激光	25,700	783,336.00	0.13
259	002880	卫光生物	20,700	780,390.00	0.13
260	600686	金龙汽车	95,600	778,184.00	0.13
261	301068	大地海洋	23,000	773,030.00	0.13
262	688668	鼎通科技	7,900	772,620.00	0.13
263	603217	元利科技	30,000	772,500.00	0.13
264	003012	东鹏控股	94,000	760,460.00	0.13
265	300280	紫天科技	15,900	759,543.00	0.13
266	301092	争光股份	28,800	753,984.00	0.13
267	300033	同花顺	4,300	753,704.00	0.13
268	002602	世纪华通	99,200	752,928.00	0.13
269	605377	华旺科技	41,400	747,270.00	0.13
270	603163	圣晖系统集成集团	16,250	744,737.50	0.13
271	000913	钱江摩托	40,800	743,784.00	0.13
272	600066	宇通客车	50,300	741,422.00	0.13
273	301256	华融化学	83,500	739,810.00	0.13
274	601138	工业富联	29,200	735,840.00	0.13
275	603000	人民网	25,000	730,000.00	0.12
276	688019	安集科技	4,420	728,548.60	0.12
277	600089	特变电工	32,500	724,425.00	0.12
278	605218	伟时电子	46,700	723,850.00	0.12

279	002270	华明装备	66,100	723,795.00	0.12
280	002422	科伦药业	24,300	721,224.00	0.12
281	002142	宁波银行	28,500	721,050.00	0.12
282	600861	北京人力	30,300	702,960.00	0.12
283	002595	豪迈科技	20,000	702,600.00	0.12
284	603369	今世缘	13,300	702,240.00	0.12
285	600452	涪陵电力	32,900	700,112.00	0.12
286	603090	宏盛股份	31,100	691,975.00	0.12
287	600212	绿能慧充	73,500	689,430.00	0.12
288	603076	乐惠国际	14,400	688,464.00	0.12
289	600785	新华百货	50,300	683,577.00	0.12
290	301367	怡和嘉业	4,600	682,364.00	0.12
291	688156	路德环境	23,800	682,346.00	0.12
292	300124	汇川技术	10,600	680,626.00	0.12
293	002230	科大讯飞	10,000	679,600.00	0.12
294	300107	建新股份	137,800	673,842.00	0.11
295	000063	中兴通讯	14,700	669,438.00	0.11
296	301376	致欧科技	28,220	668,314.20	0.11
297	688291	金橙子科技	21,089	667,677.74	0.11
298	601689	拓普集团	8,200	661,740.00	0.11
299	300951	博硕科技	12,100	661,023.00	0.11
300	601939	建设银行	105,000	657,300.00	0.11
301	600761	安徽合力	32,900	655,697.00	0.11
302	601288	农业银行	184,800	652,344.00	0.11
303	000425	徐工机械	96,300	651,951.00	0.11
304	000338	潍柴动力	52,200	650,412.00	0.11
305	603187	海容冷链	32,350	646,676.50	0.11
306	002389	航天彩虹	29,000	644,090.00	0.11
307	002767	先锋电子	46,100	644,017.00	0.11
308	300407	凯发电气	70,500	643,665.00	0.11
309	002648	卫星化学	42,900	641,784.00	0.11
310	300490	华自科技	37,300	640,068.00	0.11
311	002262	恩华药业	20,700	638,181.00	0.11
312	600346	恒力石化	44,200	633,386.00	0.11
313	300624	万兴科技	5,400	632,610.00	0.11
314	300403	汉宇集团	57,300	629,727.00	0.11
315	300695	兆丰股份	13,500	628,830.00	0.11
316	600660	福耀玻璃	17,500	627,375.00	0.11
317	300130	新国都	22,000	623,260.00	0.11
318	002631	德尔未来	115,400	623,160.00	0.11
319	001216	华瓷股份	47,100	619,836.00	0.11
320	002003	伟星股份	66,000	617,760.00	0.11
321	300777	中简科技	13,000	614,380.00	0.10

322	688335	复洁环保科技	24,900	611,046.00	0.10
323	600085	同仁堂	10,600	610,136.00	0.10
324	688551	科威尔股份	9,300	609,894.00	0.10
325	300757	罗博特科	6,900	607,269.00	0.10
326	600971	恒源煤电	77,900	606,841.00	0.10
327	002979	雷赛智能	25,500	605,880.00	0.10
328	600116	三峡水利	66,700	605,636.00	0.10
329	600835	上海机电	35,000	601,300.00	0.10
330	688722	同益中新材料	32,321	599,231.34	0.10
331	603357	设计总院	56,640	594,720.00	0.10
332	600566	济川药业	20,400	592,416.00	0.10
333	600509	天富能源	75,800	591,998.00	0.10
334	002777	久远银海	16,500	585,255.00	0.10
335	002353	杰瑞股份	23,200	583,016.00	0.10
336	600547	山东黄金	24,700	579,956.00	0.10
337	688097	博众精工科技	19,100	579,876.00	0.10
338	002920	德赛西威	3,700	576,497.00	0.10
339	301188	力诺特玻	33,700	575,596.00	0.10
340	688516	奥特维科技	3,000	565,200.00	0.10
341	688126	上海硅产业集团	27,000	564,300.00	0.10
342	300384	三联虹普	32,500	552,175.00	0.09
343	002867	周大生	30,800	547,624.00	0.09
344	300314	戴维医疗	25,500	539,070.00	0.09
345	001255	博菲电气	14,000	533,680.00	0.09
346	300700	岱勒新材	27,900	531,495.00	0.09
347	002730	电光科技	55,400	530,732.00	0.09
348	300510	金冠股份	75,600	527,688.00	0.09
349	603867	新化股份	12,900	522,450.00	0.09
350	603998	方盛制药	41,400	522,054.00	0.09
351	601339	百隆东方	92,800	519,680.00	0.09
352	002066	瑞泰科技	42,800	511,460.00	0.09
353	002271	东方雨虹	18,700	509,762.00	0.09
354	300819	聚杰微纤	36,700	503,157.00	0.09
355	600287	江苏舜天	97,500	498,225.00	0.08
356	300539	横河精密	33,500	496,135.00	0.08
357	605196	华通线缆	69,100	491,992.00	0.08
358	002790	瑞尔特	50,900	488,640.00	0.08
359	002821	凯莱英	4,100	483,226.00	0.08
360	000333	美的集团	8,200	483,144.00	0.08
361	688350	富淼科技	28,300	480,817.00	0.08
362	002783	凯龙股份	57,600	480,384.00	0.08
363	600128	弘业股份	58,300	479,226.00	0.08
364	688121	卓然技术	12,500	467,500.00	0.08

365	002949	华阳国际	32,700	464,994.00	0.08
366	603177	德创环保	37,200	464,256.00	0.08
367	002278	神开股份	87,100	464,243.00	0.08
368	002508	老板电器	18,200	460,278.00	0.08
369	603800	道森股份	16,900	459,680.00	0.08
370	688217	上海睿昂基因	11,400	457,710.00	0.08
371	002372	伟星新材	22,200	455,988.00	0.08
372	300918	南山智尚	33,200	455,836.00	0.08
373	603021	山东华鹏	88,800	453,768.00	0.08
374	300796	贝斯美	37,600	452,328.00	0.08
375	300900	广联航空	15,700	452,317.00	0.08
376	688310	迈得医疗	13,700	448,949.00	0.08
377	603214	爱婴室	27,400	445,798.00	0.08
378	002870	香山股份	13,400	444,478.00	0.08
379	002572	索菲亚	25,300	440,726.00	0.08
380	600522	中天科技	27,700	440,707.00	0.08
381	688300	联瑞新材	9,372	438,141.00	0.07
382	688566	吉贝尔药业	11,200	436,912.00	0.07
383	001979	招商蛇口	33,000	429,990.00	0.07
384	600433	冠豪高新	125,500	427,955.00	0.07
385	300517	海波重科	30,900	427,656.00	0.07
386	603165	荣晟环保	26,500	425,060.00	0.07
387	002940	昂利康	22,000	422,620.00	0.07
388	000923	河钢资源	30,700	414,450.00	0.07
389	603590	康辰药业	12,400	411,680.00	0.07
390	600941	中国移动	4,300	401,190.00	0.07
391	300586	美联新材	31,000	400,210.00	0.07
392	600490	鹏欣资源	107,900	397,072.00	0.07
393	600309	万华化学	4,500	395,280.00	0.07
394	600570	恒生电子	8,900	394,181.00	0.07
395	001215	千味央厨	5,900	392,291.00	0.07
396	000521	长虹美菱	51,300	391,932.00	0.07
397	000703	恒逸石化	57,500	389,850.00	0.07
398	300009	安科生物	38,900	389,000.00	0.07
399	300274	阳光电源	3,300	384,879.00	0.07
400	301257	普蕊斯	6,700	376,540.00	0.06
401	600546	山煤国际	25,600	370,432.00	0.06
402	600746	江苏索普	56,700	370,251.00	0.06
403	300316	晶盛机电	5,200	368,680.00	0.06
404	300750	宁德时代	1,600	366,064.00	0.06
405	688588	凌志软件	23,100	359,205.00	0.06
406	603737	三棵树	5,460	357,193.20	0.06
407	000533	顺钠股份	83,200	353,600.00	0.06

408	002647	仁东控股	62,500	351,875.00	0.06
409	603429	集友股份	38,900	344,654.00	0.06
410	603121	华培动力	38,300	341,253.00	0.06
411	300129	泰胜风能	35,500	340,445.00	0.06
412	002126	银轮股份	19,000	336,300.00	0.06
413	601668	中国建筑	58,200	334,068.00	0.06
414	301058	中粮科工	23,800	332,010.00	0.06
415	605016	百龙创园	13,300	329,308.00	0.06
416	300235	方直科技	26,300	327,435.00	0.06
417	600963	岳阳林纸	44,200	325,754.00	0.06
418	600926	杭州银行	27,400	321,950.00	0.05
419	600584	长电科技	10,200	317,934.00	0.05
420	002918	蒙娜丽莎	20,300	313,432.00	0.05
421	603023	威帝股份	76,700	312,936.00	0.05
422	300688	创业黑马	9,000	312,390.00	0.05
423	300926	博俊科技	13,600	310,624.00	0.05
424	688158	优刻得科技	16,200	305,856.00	0.05
425	300717	华信新材	17,900	305,195.00	0.05
426	688376	美埃科技	7,600	300,124.00	0.05
427	603368	柳药集团	12,000	296,520.00	0.05
428	300308	中际旭创	2,000	294,900.00	0.05
429	688582	芯动联科	6,374	294,685.44	0.05
430	600327	大东方	62,700	291,555.00	0.05
431	603169	兰石重装	38,600	287,184.00	0.05
432	002408	齐翔腾达	44,600	284,102.00	0.05
433	605167	利柏特	28,600	276,848.00	0.05
434	300654	世纪天鸿	21,100	276,832.00	0.05
435	603179	新泉股份	6,300	276,507.00	0.05
436	600285	羚锐制药	17,200	276,232.00	0.05
437	002315	焦点科技	6,900	276,000.00	0.05
438	688127	蓝特光学	15,600	275,028.00	0.05
439	002891	中宠股份	11,300	272,782.00	0.05
440	603486	科沃斯	3,400	264,418.00	0.05
441	600315	上海家化	9,100	263,991.00	0.04
442	002092	中泰化学	39,700	256,065.00	0.04
443	688072	拓荆科技	600	255,582.00	0.04
444	603225	新风鸣	22,600	249,730.00	0.04
445	603129	春风动力	1,500	242,850.00	0.04
446	600272	开开实业	26,400	238,392.00	0.04
447	301486	致尚科技	3,988	229,948.08	0.04
448	002221	东华能源	24,700	213,655.00	0.04
449	600871	石化油服	105,800	209,484.00	0.04
450	688015	交控科技	11,100	193,917.00	0.03

451	002123	梦网科技	14,500	192,705.00	0.03
452	688012	中微半导体设备	1,200	187,740.00	0.03
453	601865	福莱特	4,700	180,997.00	0.03
454	002674	兴业科技	14,400	177,840.00	0.03
455	600339	中油工程	43,000	175,010.00	0.03
456	000938	紫光股份	5,100	162,435.00	0.03
457	600968	海油发展	52,700	161,789.00	0.03
458	603267	鸿远电子	2,400	156,720.00	0.03
459	002153	石基信息	10,920	152,880.00	0.03
460	002155	湖南黄金	12,300	150,060.00	0.03
461	688472	阿特斯阳光电力	8,273	148,852.32	0.03
462	002544	普天科技	6,400	146,560.00	0.02
463	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
464	002151	北斗星通	4,000	140,640.00	0.02
465	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
466	688037	芯源微电子	740	126,503.00	0.02
467	000681	视觉中国	6,800	125,052.00	0.02
468	603639	海利尔	6,900	123,648.00	0.02
469	688220	翱捷科技	1,600	120,624.00	0.02
470	600572	康恩贝	17,500	119,875.00	0.02
471	300133	华策影视	16,600	117,694.00	0.02
472	002275	桂林三金	6,500	117,065.00	0.02
473	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
474	300664	鹏鹞环保	19,900	112,634.00	0.02
475	600557	康缘药业	4,100	112,586.00	0.02
476	000657	中钨高新	11,600	112,404.00	0.02
477	001311	多利科技	1,900	109,117.00	0.02
478	688103	国力股份	1,800	107,838.00	0.02
479	600489	中金黄金	10,300	106,399.00	0.02
480	688255	凯尔达机器人	3,082	104,356.52	0.02
481	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
482	601137	博威合金	6,600	102,696.00	0.02
483	688007	光峰科技	4,900	102,165.00	0.02
484	300672	国科微	1,200	100,020.00	0.02
485	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
486	600549	厦门钨业	4,800	91,344.00	0.02
487	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
488	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
489	688249	晶合集成	3,777	68,212.62	0.01
490	688485	九州一轨环科	3,580	54,308.60	0.01
491	688361	中科飞测	708	45,786.36	0.01
492	301325	曼恩斯特	337	36,379.15	0.01

493	688469	中芯集成	6,645	35,949.45	0.01
494	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
495	688443	智翔金泰	997	29,401.53	0.01
496	688576	西山科技	223	26,851.43	0.00
497	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
498	301358	湖南裕能	607	26,034.23	0.00
499	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
500	301260	格力博	983	23,228.29	0.00
501	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
502	688543	国科军工	403	21,379.15	0.00
503	688552	航天南湖	895	21,032.50	0.00
504	301307	美利信	637	20,294.82	0.00
505	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
506	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
507	688570	天玛智控	704	17,832.32	0.00
508	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
509	301246	宏源药业	571	17,535.41	0.00
510	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
511	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
512	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
513	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
514	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
515	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
516	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
517	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
518	688512	慧智微电子	721	13,814.36	0.00
519	688623	二元科技	158	13,712.82	0.00
520	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
521	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
522	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
523	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
524	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
525	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
526	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
527	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
528	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
529	301439	泓淋电力	623	10,528.70	0.00
530	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
531	688479	用友汽车信息 科技	332	9,790.68	0.00
532	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
533	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
534	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
535	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00

536	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
537	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
538	301345	涛涛车业	183	8,535.12	0.00
539	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
540	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
541	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
542	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
543	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
544	688155	先惠技术	127	6,891.02	0.00
545	688358	祥生医疗科技	134	6,834.00	0.00
546	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
547	688478	晶升股份	94	4,465.94	0.00
548	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
549	688356	键凯科技	31	3,303.05	0.00
550	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
551	603172	浙江万丰股份	122	1,967.86	0.00
552	688363	XD 华熙生物	22	1,961.52	0.00
553	603282	亚光科技股份	40	1,380.40	0.00

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	601702	华峰铝业	18,976,428.00	3.66
2	603477	巨星农牧	14,008,335.00	2.70
3	002371	北方华创	12,629,909.60	2.44
4	002389	航天彩虹	12,506,973.00	2.41
5	601318	中国平安	11,770,558.00	2.27
6	601699	潞安环能	11,718,122.00	2.26
7	688186	张家港广大特材	11,394,678.22	2.20
8	002459	晶澳科技	11,380,195.40	2.19
9	300034	钢研高纳	11,156,859.00	2.15
10	002517	恺英网络	11,138,388.50	2.15
11	002179	中航光电	10,630,208.00	2.05
12	300059	东方财富	10,335,725.86	1.99
13	300491	通合科技	9,956,152.00	1.92
14	600276	恒瑞医药	9,897,930.94	1.91
15	002518	科士达	9,623,190.00	1.86
16	000661	长春高新	8,930,363.68	1.72
17	603659	璞泰来	8,635,826.00	1.67
18	000516	国际医学	8,488,631.00	1.64
19	600039	四川路桥	8,261,038.00	1.59

20	601601	中国太保	8,049,930.00	1.55
----	--------	------	--------------	------

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。

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	601702	华峰铝业	19,200,074.00	3.70
2	601318	中国平安	12,814,531.00	2.47
3	002371	北方华创	12,389,023.00	2.39
4	002389	航天彩虹	12,364,339.00	2.38
5	600276	恒瑞医药	11,913,491.30	2.30
6	002517	恺英网络	11,520,414.17	2.22
7	002459	晶澳科技	11,421,829.24	2.20
8	601601	中国太保	10,744,981.00	2.07
9	300015	爱尔眼科	10,338,326.30	1.99
10	603876	鼎胜新材	9,995,239.92	1.93
11	300491	通合科技	9,949,305.00	1.92
12	603477	巨星农牧	9,823,120.00	1.89
13	600039	四川路桥	9,616,981.00	1.85
14	688186	张家港广大特材	9,462,389.68	1.82
15	603659	璞泰来	9,432,681.85	1.82
16	300059	东方财富	9,279,876.40	1.79
17	002179	中航光电	8,898,040.00	1.72
18	601628	中国人寿	8,611,389.00	1.66
19	601699	潞安环能	8,317,685.00	1.60
20	300575	中旗股份	8,266,337.70	1.59

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。

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

买入股票成本（成交）总额	2,020,567,149.74
卖出股票收入（成交）总额	2,011,960,379.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以及适当对冲系统性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,722,527.75
2	应收清算款	19,373,985.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	152,465.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,248,978.17

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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

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
中欧数据挖掘混合 A	32,117	5,290.31	57,384,430.26	33.77%	112,524,544.03	66.23%
中欧数据挖掘混合 C	66,127	3,108.62	151,010,989.21	73.46%	54,552,450.78	26.54%
合计	98,244	3,821.84	208,395,419.47	55.50%	167,076,994.81	44.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘混合 A	2,028,921.14	1.19%
	中欧数据挖掘混合 C	9,618.25	0.00%
	合计	2,038,539.39	0.54%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员持有本基金 C 类份额的实际比例为 0.0047%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合 A	0
	中欧数据挖掘混合 C	—
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合 A	10~50
	中欧数据挖掘混合 C	—

	合计	10~50
--	----	-------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
基金合同生效日 (2016 年 1 月 13 日) 基金份额总额	506,409,681.98	-
本报告期期初基金份 额总额	210,546,961.64	131,209,920.03
本报告期基金总申购 份额	47,095,843.91	145,638,542.78
减：本报告期基金总 赎回份额	87,733,831.26	71,285,022.82
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	169,908,974.29	205,563,439.99

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

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，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
浙商证券	1	732,649,740.70	18.22	535,782.83	18.49	-
中信建投	2	662,634,263.59	16.47	484,592.53	16.73	-
财通证券	1	437,254,047.07	10.87	319,764.89	11.04	-
德邦证券	2	409,999,641.75	10.19	277,962.36	9.60	-
东北证券	2	244,421,481.02	6.08	178,748.22	6.17	-
光大证券	1	181,336,309.00	4.51	132,610.91	4.58	-
东方财富	1	153,255,367.05	3.81	112,074.48	3.87	-
中泰证券	2	143,911,804.83	3.58	105,244.14	3.63	-
兴业证券	1	141,286,924.92	3.51	103,317.94	3.57	-
中金公司	1	136,084,225.41	3.38	99,515.01	3.44	-
西南证券	1	136,039,003.04	3.38	99,488.05	3.43	-
国都证券	3	132,205,163.	3.29	96,676.66	3.34	-

		14				
国泰君安	1	126,736,256.43	3.15	92,683.56	3.20	-
申万宏源证券	1	112,939,159.55	2.81	60,005.33	2.07	-
国金证券	1	93,404,780.28	2.32	68,307.39	2.36	-
民生证券	2	89,904,338.78	2.24	65,749.30	2.27	-
天风证券	1	88,096,400.68	2.19	64,421.61	2.22	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

注：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。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券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 (%)
浙商证	-	-	1,415,360,00	65.27	-	-

券			0.00			
中信建投	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	308,000,000.00	14.20	-	-
德邦证券	-	-	94,000,000.00	4.33	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	72,000,000.00	3.32	-	-
中金公司	-	-	83,999,000.00	3.87	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	63,100,000.00	2.91	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	72,000,000.00	3.32	-	-
天风证券	-	-	60,000,000.00	2.77	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证	-	-	-	-	-	-

券						
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

注：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。

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部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
2	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2023-01-20
3	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2023-02-17
4	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告	中国证监会指定媒介	2023-03-31
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
7	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2023-04-22
8	中欧基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证监会指定媒介	2023-06-03
9	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2023-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 02 月 15 日;2023 年 03 月 06 日至 2023 年 06 月 30 日	70,111,236.26	120,859,440.81	54,611,236.26	136,359,440.81	36.32%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧数据挖掘多因子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媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理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

2023 年 8 月 31 日