

# 中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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其更新。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	95
8.6 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	95
8.7 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	95
8.8 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	95
8.9 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	95
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	95

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	96
8.12	投资组合报告附注.....	96
§9	基金份额持有人信息.....	97
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	97
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	98
9.3	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.....	98
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	98
§10	开放式基金份额变动.....	98
§11	重大事件揭示.....	99
11.1	基金份额持有人大会决议.....	99
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	99
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	99
11.4	基金投资策略的改变.....	99
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	99
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	100
11.8	其他重大事件.....	104
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	106
12.1	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.....	106
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	106
§13	备查文件目录.....	106
13.1	备查文件目录.....	106
13.2	存放地点.....	106
13.3	查阅方式.....	107

## § 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01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	1,631,149,346.89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	1,125,931,730.90份	505,217,615.99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	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
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5 5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层		北京市西城区复兴门内大街5 5号
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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8层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2021年		2020年		2019年	
	中欧数据 挖掘混合 A	中欧数据 挖掘混合 C	中欧数据 挖掘混合 A	中欧数据 挖掘混合 C	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	219,143, 080.01	87,955,0 89.11	142,403, 638.43	50,144,0 26.44	33,325,4 23.18	8,249,48 4.96
本期利润	242,570, 572.75	82,600,8 83.76	173,070, 341.50	69,275,0 89.58	42,754,9 01.81	9,430,39 1.23
加权平均基 金份额本期 利润	0.3982	0.2683	0.6516	0.6382	0.4858	0.3657
本期加权平 均净值利润 率	18.12%	12.53%	38.85%	38.82%	47.14%	35.63%
本期基金份 额净值增长 率	22.88%	21.91%	56.92%	55.68%	51.88%	50.44%
<b>3.1.2 期末 数据和指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分 配利润	902,120, 258.61	368,871, 322.82	285,000, 395.06	129,313, 188.01	30,542,1 25.66	7,739,30 0.53
期末可供分 配基金份额 利润	0.8012	0.7301	0.7565	0.7018	0.2277	0.1995
期末基金资 产净值	2,281,14 6,686.54	984,073, 560.91	729,683, 458.73	345,787, 358.17	165,585, 472.32	46,756,9 25.76
期末基金份 额净值	2.0260	1.9478	1.9369	1.8767	1.2343	1.2055
<b>3.1.3 累计 期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累	158.58%	132.28%	110.43%	90.53%	34.10%	22.39%

计净值增长率						
--------	--	--	--	--	--	--

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧数据挖掘混合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
过去三个月	1.81%	0.91%	3.46%	0.72%	-1.65%	0.19%
过去六个月	6.65%	1.11%	7.78%	0.91%	-1.13%	0.20%
过去一年	22.88%	1.19%	14.93%	0.92%	7.95%	0.27%
过去三年	192.86%	1.36%	56.89%	1.23%	135.97%	0.13%
过去五年	134.95%	1.29%	49.95%	1.03%	85.00%	0.26%
自基金合同生效起至今	158.58%	1.24%	52.04%	0.99%	106.54%	0.25%

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
过去三个月	1.60%	0.91%	3.46%	0.72%	-1.86%	0.19%

过去六个月	6.23%	1.11%	7.78%	0.91%	-1.55%	0.20%
过去一年	21.91%	1.19%	14.93%	0.92%	6.98%	0.27%
过去三年	185.53%	1.36%	56.89%	1.23%	128.64%	0.13%
自基金份额 运作日至今	132.28%	1.29%	49.64%	1.04%	82.64%	0.25%

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累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年01月13日-2021年12月31日)



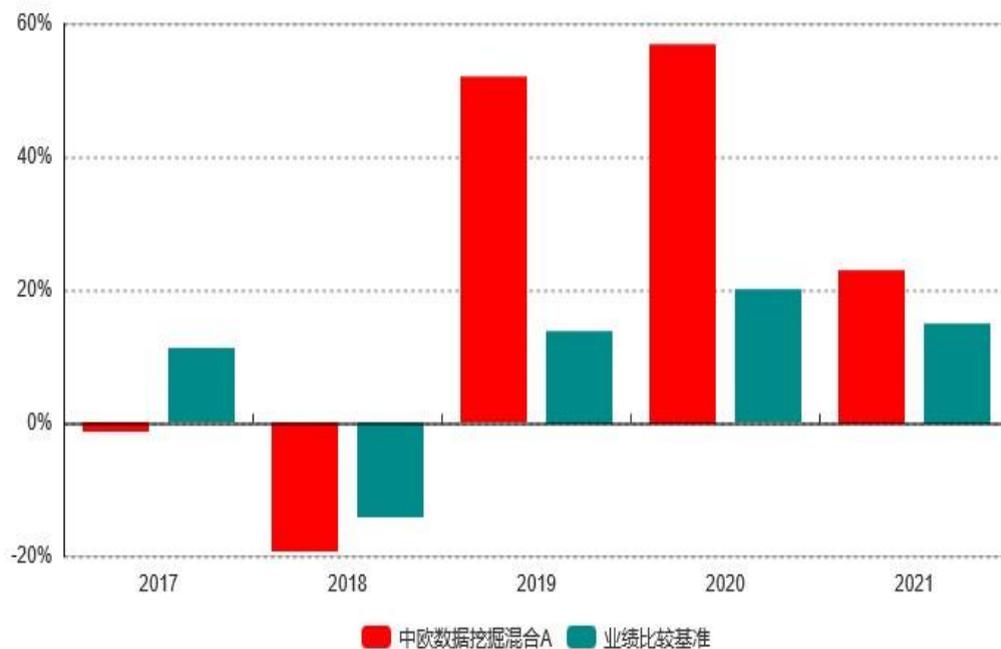
注：2019年4月26日组合业绩比较基准由沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%变更为中证500指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。

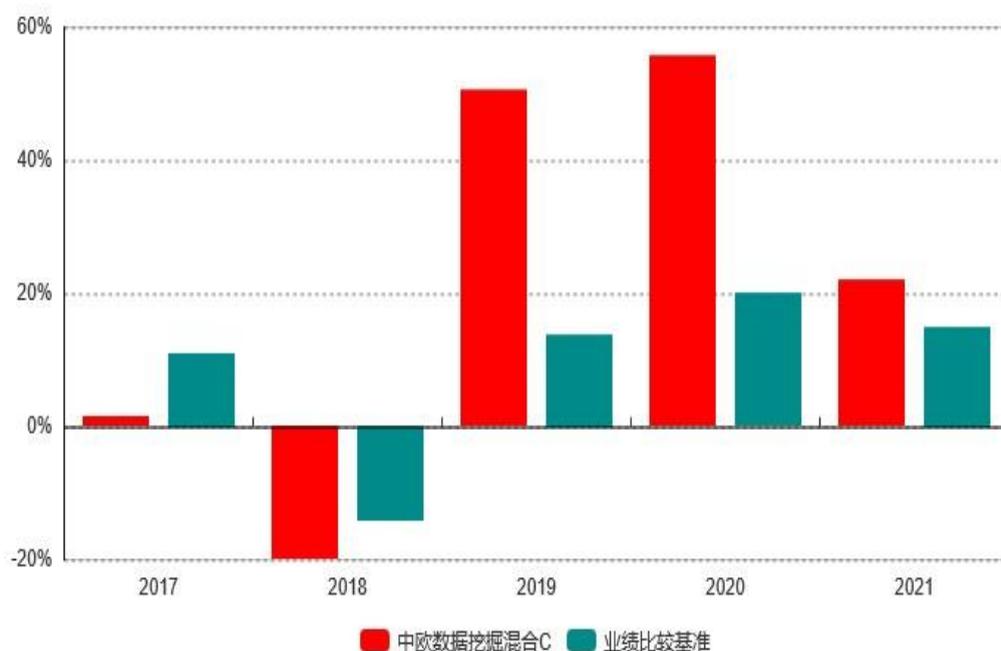
中欧数据挖掘混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年01月20日-2021年12月31日)



注：2019年4月26日组合业绩比较基准由沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%变更为中证500指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：自 2017 年 1 月 19 日起，本基金增加 C 类份额，2017 年度数据为 2017 年 1 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧数据挖掘混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	3.590	289,118,520.77	88,134,286.13	377,252,806.90	-
合计	3.590	289,118,520.77	88,134,286.13	377,252,806.90	-

中欧数据挖掘混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	3.450	78,707,004.30	91,304,571.18	170,011,575.48	-

合计	3.450	78,707,004.30	91,304,571.18	170,011,575.48	-
----	-------	---------------	---------------	----------------	---

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、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）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、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2021年12月31日，本基金管理人共管理106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		
钱亚婷	基金经理助理	2019-04-23	2021-11-03	5年	2016/04/05加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司分析师。
曲径	量化投资总监/基金经理/投资经理	2016-01-13	-	15年	历任千禧年基金量化基金经理，博煊资产管理有限公司量化投资分析师、量化投资经理，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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 3、根据本公司公告，曲径于2021年7月1日至2021年9月29日之间休假，休假期间由张跃鹏代行履职。

#### 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	3	6,243,526,240.47	2015-05-18
	私募资产管理计划	2	485,285,959.53	2021-12-14
	其他组合	-	-	-
	合计	5	6,728,812,200.00	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，离任产品情况：

- 1) 产品类型：公募，离任数量：0只，离任时间：无；
- 2) 产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1只；离任时间：20211208。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

#### 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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等

投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

#### 4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至10个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

#### 4.3.3 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32次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

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2021年，市场风格转换很快，对基本面投资是挑战，对我们基本面与量化结合的投资，同样也是很大的考验。2017年、2018年的价值投资，2019年、2020年的成长赛道投资，如果说那几年对于基本面投资来说是河宽水静，那么2021年可以说是激流湍急。从一月的食品医药引领开门红，到二月市场震荡回调，再到后来周期板块应验全球流动性宽松带来上涨，而临近年底，PPI指数的冲高回落本应给中游制造的成本缓解压力，但数据上看居民消费继续走弱，又在需求上压制了景气。基于以上情况，本基金在过去一年能够提供超越基准的回报，很大程度得益于基本面量化这种行业覆盖较宽的投资方式。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值收益率为22.88%，同期业绩比较基准收益率为14.93%；C类份额净值增长率为21.91%，同期业绩比较基准收益率为14.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以前很少在基金年报中提及我们的基本面和量化结合的方法论，总觉得提到“量化”太复杂，持有人不容易理解，因而我们选择用净值说话，以业绩证明自己。但是，最近两年关注和理解量化的投资人越来越多了，我觉得值得谈谈我们在做什么。简单来说，“基本面量化”就是我们把自己能力范围内能够梳理的、成体系的基本面逻辑，都写进模型里，然后让模型去输出交易信号，形成基金的投资组合。

回顾我自己从业的前10年，都是在做传统多因子模型，浅显易懂的例子是PE-ROE-GROWTH三因子模型，PE是估值，ROE是好公司，GROWTH是具备成长性，简单的说就是具有成长性的又不贵的好公司，其实这也是基本面量化的雏形，是一种极大抽象的选股方式。这种在上个世纪的美国流行起来的投资框架，基于财务报表等公开的信息，以及Oracle等结构化数据库的技术支持。不能否认，这样的投资方式在当时就是“先进生产力”。而站在现在的世界，谁还能说自己有一个Oracle数据库就是先进科技了呢？我们的团队也时常论证自己投资框架的稳健性，意识到危机后摆在我们面前有两个选择，一个是选择以AI等科技应用为基础的中高频交易，另一个是选择下沉到更基础的研究层面——以逻辑驱动的基本面量化，考虑到公募基金的特点和客群，我们最终选择了基本面量化，即在美国被称为“Quantamental”的投资框架，并基于这个框架开拓了数年，最近的业绩效果就是研究结果的呈现。

所谓“Quantamental”，即基本面量化，是一种基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式。投资框架里最重要的是行业底层选股逻辑以及通过技术手段得到的细分数据。在寻找基本面逻辑上，我们下沉一步，寻找行业专家们真正看的东西，用它来建模。举个例子：汽车研究员会去看乘联会和中汽协，每个月的汽车销量批发数据，还会跟踪社会库存，并考虑到购置税减免的周期、乘用车补贴的周期，我们把这些都应用到数学建

模里。数据赋能的层面，我们不仅采用传统因子的报表数据和分析师数据，更把大数据技术获得的各类另类数据作为模型输入。基于这样的建模结果，我们就可以与基本面研究在一个维度上去对话，这才是真的基本面与量化相结合。

当然，我们做量化的必须承认自己的短板，一个数学模型建得再好，也不如最优秀的基本面研究人员对行业和个股钻研那么深入，但是量化的好处大家也都知道，是以宽度对抗深度。我们希望通过多行业覆盖的“雷达扫描”般的投资方式，在更多的板块和个股上，挖掘到投资机会。当然，我们也会因为分散型的投资，业绩很少在短期内非常突出，但长期来看，希望积少成多，累积更好的长期回报。

因为带上了“基本面”三个字，对于我们的这种基本面量化，人们可能会有诸多误解。常被问到的一个问题是：基本面量化是不是量化选股票池，再通过人的主观判断筛一遍？我们在中欧的实践中，选用了另一条路，我称作“基本面逻辑前置”的方式。这种方式是尽量把能想到的各种逻辑和角度都写进模型里，在投资中不采取人工干预，而是相信模型的“理性”优于人的“贪婪和恐惧”。

本基金整体投资锚定中证500指数的行业配置，叠加精选个股的投资策略，个股筛选以跑赢指数为目标。本基金的整体回报可以理解为中证500指数Beta收益，叠加行业配置和个股选择的Alpha收益。未来，我们会继续践行基本面量化的投资理念和方法，努力为持有人创造良好的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

##### （一）落实法律法规，培养合规文化

2021年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

##### （二）完善制度体系，提高运作效率

2021年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程55项，内容涵盖投资研究、合规管理、信息技术、反洗钱等各项内容。

##### （三）加强内部审计，强化风险管理

2021年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

#### 4.7 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、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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金2021年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61362990_B21号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的

	经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于

舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行

	沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露、张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022-03-30

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	259,866,767.39	73,294,640.74
结算备付金		35,834,853.72	22,133,279.69
存出保证金		7,438,198.75	5,292,702.24
交易性金融资产	7.4.7.2	2,981,627,986.64	985,231,691.71
其中：股票投资		2,981,627,986.64	985,051,691.71
基金投资		-	-
债券投资		-	180,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,335,805.65	24,763,820.72
应收利息	7.4.7.5	47,604.01	13,932.72
应收股利		-	-

应收申购款		7,196,309.19	1,220,829.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,300,347,525.35	1,111,950,897.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17,441,907.05	30,158,147.14
应付赎回款		1,467,007.67	1,759,867.97
应付管理人报酬		4,386,109.45	1,334,399.38
应付托管费		731,018.23	222,399.90
应付销售服务费		739,430.26	246,062.02
应付交易费用	7.4.7.7	9,984,504.48	2,543,134.40
应交税费		286,763.93	10,774.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	90,536.83	205,294.44
负债合计		35,127,277.90	36,480,080.11
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,631,149,346.89	560,977,859.55
未分配利润	7.4.7.10	1,634,070,900.56	514,492,957.35
所有者权益合计		3,265,220,247.45	1,075,470,816.90
负债和所有者权益总计		3,300,347,525.35	1,111,950,897.01

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值为人民币2.0018元，基金份额总额为1,631,149,346.89份，其中下属A类基金份额净值为人民币2.0260元，份额总额为

1,125,931,730.90份；下属C类基金份额净值为人民币1.9478元，份额总额为505,217,615.99份。

## 7.2 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		407,624,433.05	266,396,361.16
1. 利息收入		822,936.65	676,484.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	822,038.90	272,390.49
债券利息收入		897.75	258.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	403,835.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		386,845,749.97	215,146,723.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	354,241,555.63	202,099,945.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	214,491.01	273,671.11
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	19,678,260.67	8,893,117.97
股利收益	7.4.7.15	12,711,442.66	3,879,988.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	18,073,287.39	49,797,766.21

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,882,459.04	775,387.60
<b>减：二、费用</b>		82,452,976.54	24,050,930.08
1. 管理人报酬		29,772,046.31	9,196,242.70
2. 托管费		4,962,007.73	1,532,707.16
3. 销售服务费		5,270,935.03	1,399,249.98
4. 交易费用	7.4.7.18	42,147,436.82	11,666,638.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		70,844.48	32,016.13
7. 其他费用	7.4.7.19	229,706.17	224,075.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		325,171,456.51	242,345,431.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		325,171,456.51	242,345,431.08

### 7.3 所有者权益（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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	560,977,859.55	514,492,957.35	1,075,470,816.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利	-	325,171,456.51	325,171,456.51

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,070,171,487.34	1,341,670,869.08	2,411,842,356.42
其中:1.基金申购款	1,941,290,923.18	2,325,371,083.69	4,266,662,006.87
2.基金赎回款	-871,119,435.84	-983,700,214.61	-1,854,819,650.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-547,264,382.38	-547,264,382.38
五、期末所有者权益(基金净值)	1,631,149,346.89	1,634,070,900.56	3,265,220,247.45
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	172,946,148.75	39,396,249.33	212,342,398.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	242,345,431.08	242,345,431.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	388,031,710.80	232,751,276.94	620,782,987.74
其中:1.基金申购款	651,608,507.79	388,813,773.22	1,040,422,281.01

2. 基金赎回款	-263, 576, 796. 99	-156, 062, 496. 28	-419, 639, 293. 27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	560, 977, 859. 55	514, 492, 957. 35	1, 075, 470, 816. 90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%

#### 7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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2号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

#### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票和债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （2） 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### （3） 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （4） 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### （5） 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

#### （6） 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最小层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，A类基金份额、C类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；投资人可对A类基金份额和C类基金份额分别选择分红方式；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日同一类别的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金同一类别的基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	259,866,767.39	73,294,640.74
定期存款	-	-

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	-	-
合计	259,866,767.39	73,294,640.74

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,907,877,155.24	2,981,627,986.64	73,750,831.40
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		2,907,877,155.24	2,981,627,986.64	73,750,831.40
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		928,177,396.18	985,051,691.71	56,874,295.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	180,000.00	180,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	180,000.00	180,000.00	-
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	928,357,396.18	985,231,691.71	56,874,295.53

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	45,115,880.00	-	-	-
—股指期货	45,115,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	45,115,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	35,395,271.52	-	-	-
—股指期货	35,395,271.52	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,395,271.52	-	-	-

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。具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

本期末 2021 年 12 月 31 日					
代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2206	IC2206	33	47,175,480.00	2,059,600.00	套保

上年度末 2020 年 12 月 31 日					
代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2103	IC2103	29	36,258,120.00	862,848.48	套保

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	37,274.57	9,820.28
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	9,916.83	3,994.65
应收债券利息	-	10.65
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	412.61	107.14
合计	47,604.01	13,932.72

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,984,504.48	2,543,134.40
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,984,504.48	2,543,134.40

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	168.54	292.19
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	90,000.00	85,000.00
应付转出费	362.79	2.25
应付转出补差费	5.50	-
预提费用-信息披露费	-	120,000.00
合计	90,536.83	205,294.44

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	376,726,641.51	376,726,641.51
本期申购	1,064,720,775.47	1,064,720,775.47

本期赎回（以“-”号填列）	-315,515,686.08	-315,515,686.08
本期末	1,125,931,730.90	1,125,931,730.90

金额单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	184,251,218.04	184,251,218.04
本期申购	876,570,147.71	876,570,147.71
本期赎回（以“-”号填列）	-555,603,749.76	-555,603,749.76
本期末	505,217,615.99	505,217,615.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 中欧数据挖掘混合A

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	285,000,395.06	67,956,422.16	352,956,817.22
本期利润	219,143,080.01	23,427,492.74	242,570,572.75
本期基金份额交易产生的变动数	775,229,590.44	161,710,782.13	936,940,372.57
其中：基金申购款	1,083,517,037.18	229,642,429.70	1,313,159,466.88
基金赎回款	-308,287,446.74	-67,931,647.57	-376,219,094.31
本期已分配利润	-377,252,806.90	-	-377,252,806.90
本期末	902,120,258.61	253,094,697.03	1,155,214,955.64

##### 7.4.7.10.2 中欧数据挖掘混合C

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-------------------	-------	-------	---------

上年度末	129,313,188.01	32,222,952.12	161,536,140.13
本期利润	87,955,089.11	-5,354,205.35	82,600,883.76
本期基金份额交易产生的变动数	321,614,621.18	83,115,875.33	404,730,496.51
其中：基金申购款	828,044,667.01	184,166,949.80	1,012,211,616.81
基金赎回款	-506,430,045.83	-101,051,074.47	-607,481,120.30
本期已分配利润	-170,011,575.48	-	-170,011,575.48
本期末	368,871,322.82	109,984,622.10	478,855,944.92

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	645,554.61	202,784.39
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	169,664.33	65,012.41
其他	6,819.96	4,593.69
合计	822,038.90	272,390.49

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	13,454,337,683.87	3,626,479,052.90
减：卖出股票成本总额	13,100,096,128.24	3,424,379,107.01
买卖股票差价收入	354,241,555.63	202,099,945.89

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	214,491.01	273,671.11
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	214,491.01	273,671.11

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	1,163,422.32	1,367,726.39
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	948,000.00	1,093,800.00
减：应收利息总额	931.31	255.28
买卖债券差价收入	214,491.01	273,671.11

## 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.14.2 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 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间收益 金额 2020年01月01日至2020年12月31日
期货投资	20,268,608.48	9,159,911.52
减：期货投资差价收入增值税抵减	590,347.81	266,793.55
合计	19,678,260.67	8,893,117.97

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,711,442.66	3,879,988.32
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	12,711,442.66	3,879,988.32

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	16,876,535.87	48,934,917.73
——股票投资	16,876,535.87	48,934,917.73
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2. 衍生工具	1,196,751.52	862,848.48
——权证投资	-	-
——期货投资	1,196,751.52	862,848.48
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	18,073,287.39	49,797,766.21

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	1,825,164.72	740,034.08
其他	8,792.00	-
转换费收入	48,502.32	35,353.52
合计	1,882,459.04	775,387.60

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	42,048,126.37	11,632,257.01
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	99,310.45	34,381.81
合计	42,147,436.82	11,666,638.82

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	90,000.00	85,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,706.17	1,075.29
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	229,706.17	224,075.29

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册 登记机构
中国工商银行股份有限公司	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
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意 联银行”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海 睦亿合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资 管”）	基金管理人的全资子公司
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
中欧基金国际有限公司（“中欧国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会批准，公司原股东北京百骏投资有限公司将其持有的公司 20%股权转让给自然人股东窦玉明先生，本次股权变更的工商变更登记手续已于 2021年7月27日办理完毕。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国都证券	12,779,449,176.46	44.83%	118,727,925.56	1.53%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国都证券	960,751.52	82.58%	-	-

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	11,901,552.22	45.84%	3,288,897.49	32.94%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	110,571.56	1.53%	110,571.56	4.35%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	29,772,046.31	9,196,242.70
其中：支付销售机构的客户维护费	2,727,916.80	994,748.97

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,962,007.73	1,532,707.16

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。

#### 7.4.10.2.3 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 2021年01月01日至2021年12月31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
国都证券	0.00	0.43	0.43
中欧基金	0.00	2,817,046.32	2,817,046.32
合计	0.00	2,817,046.75	2,817,046.75
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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
国都证券	0.00	0.08	0.08
中欧基金	0.00	741,204.33	741,204.33
合计	0.00	741,204.41	741,204.41

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

中欧数据挖掘混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中欧数据挖掘混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	152,284.26
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	152,284.26
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。  
2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 7.4.10.5.2 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 2021年12月31日		上年度末 2020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	0.13%	1,017,119.98	0.27%

## 中欧数据挖掘混合C

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	1,196.36	0.00%	916.49	0.00%

注：1、截止本报告期末，自然人股东持有本基金C类份额的实际占比为0.0002%，上表展示系四舍五入的结果；截止上报告期末，自然人股东持有本基金C类份额的实际占比为0.0005%，上表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。

## 7.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	259,866,767.39	645,554.61	73,294,640.74	202,784.39

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

中欧数据挖掘混合A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-1 2-15	2021-12- 15	3.590	289,118, 520.77	88,134,28 6.13	377,252, 806.90	-
合计			3.590	289,118, 520.77	88,134,28 6.13	377,252, 806.90	-

中欧数据挖掘混合C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2021-1 2-15	2021-12- 15	3.450	78,707,0 04.30	91,304,57 1.18	170,011, 575.48	-
合计			3.450	78,707,0 04.30	91,304,57 1.18	170,011, 575.48	-

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
6887 79	长远 锂科	2021 -08- 03	2022 -02- 11	新股 流通 受限	5.65	22.8 6	43,086	243, 435. 90	984, 945. 96	-
6881 76	亚虹 医药	2021 -12- 29	2022 -01- 07	新股 未上 市	22.9 8	22.9 8	37,990	873, 010. 20	873, 010. 20	-
6887 28	格科 微	2021 -08- 11	2022 -02- 18	新股 流通 受限	14.3 8	29.3 1	23,033	331, 214. 54	675, 097. 23	-
6881 05	诺唯 赞	2021 -11- 05	2022 -05- 05	新股 流通 受限	55.0 0	93.2 9	6,180	339, 900.	576, 532.	-

		05	16	受限				00	20	
688110	东芯股份	2021-12-03	2022-06-10	新股流通受限	30.18	40.37	14,044	423,847.92	566,956.28	-
688385	复旦微电	2021-07-27	2022-02-07	新股流通受限	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	新股流通受限	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-
688296	和达科技	2021-07-19	2022-01-27	新股流通受限	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301035	润丰股份	2021-07-	2022-01-	新股流通	22.04	56.28	644	14,193.7	36,244.3	-

		21	28	受限				6	2	
3012 11	亨迪 药业	2021 -12- 14	2022 -06- 22	新股 流通 受限	25.8 0	33.6 5	967	24,9 48.6 0	32,5 39.5 5	-
3010 39	中集 车辆	2021 -07- 01	2022 -01- 10	新股 流通 受限	6.96	12.5 1	2,064	14,3 65.4 4	25,8 20.6 4	-
3010 96	百诚 医药	2021 -12- 13	2022 -06- 20	新股 流通 受限	79.6 0	78.5 3	272	21,6 51.2 0	21,3 60.1 6	-
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	新股 流通 受限	58.0 8	49.8 5	409	23,7 54.7 2	20,3 88.6 5	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	新股 流通 受限	8.29	26.0 6	782	6,48 2.78	20,3 78.9 2	-
3011 49	隆华 新材	2021 -11- 03	2022 -05- 10	新股 流通 受限	10.0 7	16.7 6	1,214	12,2 24.9 8	20,3 46.6 4	-
3010 82	久盛 电气	2021 -10- 14	2022 -04- 27	新股 流通 受限	15.4 8	21.5 3	915	14,1 64.2 0	19,6 99.9 5	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	新股 流通 受限	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010 88	戎美 股份	2021 -10- 19	2022 -04- 28	新股 流通 受限	33.1 6	24.6 7	704	23,3 44.6 4	17,3 67.6 8	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	新股 流通 受限	39.0 8	52.1 3	329	12,8 57.3 2	17,1 50.7 7	-
3011 90	善水 科技	2021 -12- -	2022 -06- -	新股 流通	27.8 5	27.4 6	575	16,0 13.7	15,7 89.5	-

		17	24	受限				5	0	
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.60	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301185	鸥玛软件	2021-11-	2022-05-	新股流通	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.4	-

		11	19	受限					8	
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 流通 受限	9.46	41.4 3	290	2,74 3.40	12,0 14.7 0	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	新股 流通 受限	36.3 1	35.5 2	323	11,7 28.1 3	11,4 72.9 6	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	新股 流通 受限	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3010 45	天禄 科技	2021 -08- 06	2022 -02- 17	新股 流通 受限	15.8 1	28.3 7	335	5,29 6.35	9,50 3.95	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	新股 流通 受限	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	新股 流通 受限	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	新股 流通 受限	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 66	万事 利	2021 -09- 13	2022 -03- 22	新股 流通 受限	5.24	22.8 4	344	1,80 2.56	7,85 6.96	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	新股 流通 受限	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3011 33	金钟 股份	2021 -11- 19	2022 -05- 26	新股 流通 受限	14.3 3	26.9 5	286	4,09 8.38	7,70 7.70	-
3011 98	喜悦 智行	2021 -11- -	2022 -06- -	新股 流通	21.7 6	29.2 0	262	5,70 1.12	7,65 0.40	-

		25	02	受限						
3010 30	仕净 科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	新股 流通 受限	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3010 81	严牌 股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	新股 流通 受限	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-
3010 33	迈普 医学	2021 -07- 15	2022 -01- 26	新股 流通 受限	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-
3010 49	超越 科技	2021 -08- 17	2022 -02- 24	新股 流通 受限	19.3 4	32.9 2	196	3,79 0.64	6,45 2.32	-
3010 32	新柴 股份	2021 -07- 15	2022 -01- 24	新股 流通 受限	4.97	12.5 1	513	2,54 9.61	6,41 7.63	-
3010 36	双乐 股份	2021 -07- 21	2022 -02- 16	新股 流通 受限	23.3 8	29.9 3	205	4,79 2.90	6,13 5.65	-
3010 41	金百 泽	2021 -08- 02	2022 -02- 11	新股 流通 受限	7.31	28.2 1	215	1,57 1.65	6,06 5.15	-
3010 72	中捷 精工	2021 -09- 22	2022 -03- 29	新股 流通 受限	7.46	33.4 1	181	1,35 0.26	6,04 7.21	-
3010 83	百胜 智能	2021 -10- 13	2022 -04- 21	新股 流通 受限	9.08	14.2 1	416	3,77 7.28	5,91 1.36	-
0012 34	泰慕 士	2021 -12- 31	2022 -01- 11	新股 未上 市	16.5 3	16.5 3	333	5,50 4.49	5,50 4.49	-
3010 38	深水 规院	2021 -07- 15	2022 -02- 24	新股 流通	6.68	20.2 3	266	1,77 6.88	5,38 1.18	-

		22	07	受限						
3010 27	华蓝 集团	2021 -07- 08	2022 -01- 19	新股 流通 受限	11.4 5	16.6 5	286	3,27 4.70	4,76 1.90	-
3010 37	保立 佳	2021 -07- 21	2022 -02- 07	新股 流通 受限	14.8 2	24.2 6	193	2,86 0.26	4,68 2.18	-
3010 73	君亭 酒店	2021 -09- 22	2022 -03- 30	新股 流通 受限	12.2 4	32.0 0	144	1,76 2.56	4,60 8.00	-
3010 53	远信 工业	2021 -08- 25	2022 -03- 01	新股 流通 受限	11.8 7	28.7 8	155	1,83 9.85	4,46 0.90	-
3010 68	大地 海洋	2021 -09- 16	2022 -03- 28	新股 流通 受限	13.9 8	28.3 8	144	2,01 3.12	4,08 6.72	-
3010 79	邵阳 液压	2021 -10- 11	2022 -04- 19	新股 流通 受限	11.9 2	24.8 2	140	1,66 8.80	3,47 4.80	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。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。

##### 7.4.13.2 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同责任，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。

##### 7.4.13.3 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制的投资品种比例等。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7.4.12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2021年12月31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。

#### 7.4.13.3.1 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银行存款，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的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7.4.12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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	259,866,767.39	-	-	-	259,866,767.39
结算备付金	20,033,945.57	-	-	15,800,908.15	35,834,853.72
存出保证金	833,631.55	-	-	6,604,567.20	7,438,198.75
交易性金融资产	-	-	-	2,981,627,986.64	2,981,627,986.64
应收证券清算款	-	-	-	8,335,805.65	8,335,805.65
应收利息	-	-	-	47,604.01	47,604.01
应收申购款	-	-	-	7,196,309.19	7,196,309.19
资产总计	280,734,344.51	-	-	3,019,613,180.84	3,300,347,525.35
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,441,907.05	17,441,907.05
应付赎回款	-	-	-	1,467,007.67	1,467,007.67
应付管理人报酬	-	-	-	4,386,109.45	4,386,109.45
应付托管费	-	-	-	731,018.23	731,018.23
应付销售服务费	-	-	-	739,430.26	739,430.26
应付交易费用	-	-	-	9,984,504.48	9,984,504.48
应交税费	-	-	-	286,763.93	286,763.93

其他负债	-	-	-	90,536.83	90,536.83
负债总计	-	-	-	35,127,277.90	35,127,277.90
利率敏感度缺口	280,734,344.51	-	-	2,984,485,902.94	3,265,220,247.45
上年度末 2020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	73,294,640.74	-	-	-	73,294,640.74
结算备付金	8,069,990.69	-	-	14,063,289.00	22,133,279.69
存出保证金	216,565.44	-	-	5,076,136.80	5,292,702.24
交易性金融资产	-	-	180,000.00	985,051,691.71	985,231,691.71
应收证券清算款	-	-	-	24,763,820.72	24,763,820.72
应收利息	-	-	-	13,932.72	13,932.72
应收申购款	-	-	-	1,220,829.19	1,220,829.19
资产总计	81,581,196.87	-	180,000.00	1,030,189,700.14	1,111,950,897.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,158,147.14	30,158,147.14
应付赎回款	-	-	-	1,759,867.97	1,759,867.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,334,399.38	1,334,399.38
应付托管费	-	-	-	222,399.90	222,399.90
应付销售服务费	-	-	-	246,062.02	246,062.02
应付交	-	-	-	2,543,134.40	2,543,134.40

易费用					
应交税费	-	-	-	10,774.86	10,774.86
其他负债	-	-	-	205,294.44	205,294.44
负债总计	-	-	-	36,480,080.11	36,480,080.11
利率敏感度缺口	81,581,196.87	-	180,000.00	993,709,620.03	1,075,470,816.90

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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% (2020年12月31日:0.02%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020年12月31日: 同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020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	2,981,627,986.64	91.31	985,051,691.71	91.59
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	2,981,627,986.64	91.31	985,051,691.71	91.59

#### 7.4.13.4.3.2 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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	181,055,466.61	53,634,113.29
	2. 业绩比较基准下降5%	-181,055,466.61	-53,634,113.29

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### 1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币2,975,649,480.52元，属于第二层次的余额为人民币1,253,239.55元，属于第三层次的余额为人民币4,725,266.57元。(2020年12月31日：本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币981,957,970.28元，属于第二层次的余额为人民币3,273,721.43元，无划分为第三层次的余额)。

#### 1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值期末余额为人民币4,725,266.57元，期初无划分为属于第三层次的余额，本期增加人民币4,725,266.57元。

#### 2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 3. 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 4. 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月30日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,981,627,986.64	90.34

	其中：股票	2,981,627,986.64	90.34
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	-	-
	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	295,701,621.11	8.96
8	其他各项资产	23,017,917.60	0.70
9	合计	3,300,347,525.35	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	19,791,920.00	0.61
B	采矿业	45,299,020.00	1.39
C	制造业	2,311,127,566.08	70.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,278,670.52	0.90
E	建筑业	15,827,232.80	0.48
F	批发和零售业	55,876,068.30	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	41,036,521.25	1.26
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,610,455.44	5.72
J	金融业	120,740,950.78	3.70
K	房地产业	49,470,019.00	1.52
L	租赁和商务服务业	10,243,671.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	73,391,304.38	2.25

N	水利、环境和公共设施管理业	21,176,728.45	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	1,744,836.00	0.05
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,981,627,986.64	91.31

### 8.2.2 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股票。

### 8.3 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	000733	振华科技	269,600	33,505,888.00	1.03
2	603986	兆易创新	189,020	33,239,167.00	1.02
3	300751	迈为股份	44,500	28,582,350.00	0.88
4	300073	当升科技	320,800	27,867,896.00	0.85
5	300755	华致酒行	542,000	27,143,360.00	0.83
6	300059	东方财富	730,198	27,097,647.78	0.83
7	300709	精研科技	445,875	26,730,206.25	0.82
8	000657	中钨高新	1,613,400	25,943,472.00	0.79
9	688017	绿的谐波	141,498	24,699,890.88	0.76
10	688357	建龙微纳	128,302	24,626,285.88	0.75
11	000977	浪潮信息	671,400	24,056,262.00	0.74
12	300887	谱尼测试	350,061	23,699,129.70	0.73
13	002472	双环传动	827,600	22,825,208.00	0.70
14	300672	国科微	122,400	22,705,200.00	0.70
15	688598	金博股份	63,901	22,687,411.04	0.69
16	002876	三利谱	348,600	21,780,528.00	0.67

17	002756	永兴材料	145,400	21,522,108.00	0.66
18	688356	键凯科技	63,618	21,447,536.34	0.66
19	601677	明泰铝业	486,300	21,440,967.00	0.66
20	300037	新宙邦	186,757	21,103,541.00	0.65
21	300772	运达股份	464,900	20,446,302.00	0.63
22	603198	迎驾贡酒	288,311	20,023,198.95	0.61
23	300305	裕兴股份	1,060,500	19,894,980.00	0.61
24	603707	健友股份	473,300	19,878,600.00	0.61
25	600183	生益科技	836,100	19,690,155.00	0.60
26	688135	利扬芯片	464,449	19,409,323.71	0.59
27	002648	卫星化学	483,100	19,338,493.00	0.59
28	300573	兴齐眼药	137,400	18,796,320.00	0.58
29	002274	华昌化工	1,468,300	18,603,361.00	0.57
30	002318	久立特材	1,000,025	17,880,447.00	0.55
31	000768	中航西飞	488,100	17,815,650.00	0.55
32	600487	亨通光电	1,172,200	17,723,664.00	0.54
33	300769	德方纳米	35,700	17,534,412.00	0.54
34	300725	药石科技	122,000	17,344,740.00	0.53
35	600030	中信证券	633,900	16,741,299.00	0.51
36	688233	神工股份	183,345	16,171,029.00	0.50
37	603568	伟明环保	440,271	16,083,099.63	0.49
38	300327	中颖电子	235,600	15,997,240.00	0.49
39	603885	吉祥航空	899,819	15,971,787.25	0.49
40	600690	海尔智家	520,200	15,548,778.00	0.48
41	002850	科达利	96,800	15,520,912.00	0.48
42	002643	万润股份	644,835	15,243,899.40	0.47
43	688200	华峰测控	29,499	15,100,538.10	0.46
44	002352	顺丰控股	219,100	15,100,372.00	0.46
45	688561	奇安信	171,400	15,069,488.00	0.46
46	300035	中科电气	496,900	15,031,225.00	0.46
47	603260	合盛硅业	111,900	14,767,443.00	0.45

48	600116	三峡水利	1,263,700	14,734,742.00	0.45
49	688518	联赢激光	294,100	14,490,307.00	0.44
50	600176	中国巨石	795,800	14,483,560.00	0.44
51	603613	国联股份	133,400	14,340,500.00	0.44
52	300487	蓝晓科技	145,000	14,260,750.00	0.44
53	002881	美格智能	329,800	14,141,824.00	0.43
54	002025	航天电器	166,800	14,002,860.00	0.43
55	600456	宝钛股份	193,766	13,908,523.48	0.43
56	600765	中航重机	272,300	13,748,427.00	0.42
57	002013	中航机电	755,100	13,727,718.00	0.42
58	603456	九洲药业	243,400	13,693,684.00	0.42
59	300260	新莱应材	288,000	13,584,960.00	0.42
60	688099	晶晨股份	104,305	13,580,511.00	0.42
61	002929	润建股份	369,100	13,339,274.00	0.41
62	002410	广联达	208,300	13,327,034.00	0.41
63	002153	石基信息	463,000	13,306,620.00	0.41
64	002311	海大集团	180,600	13,237,980.00	0.41
65	300761	立华股份	348,500	13,176,785.00	0.40
66	603444	吉比特	31,000	13,077,350.00	0.40
67	688301	奕瑞科技	26,200	13,018,780.00	0.40
68	688388	嘉元科技	103,600	13,006,980.00	0.40
69	002128	电投能源	875,600	13,002,660.00	0.40
70	300294	博雅生物	336,900	12,920,115.00	0.40
71	300604	长川科技	223,600	12,857,000.00	0.39
72	300054	鼎龙股份	521,100	12,683,574.00	0.39
73	600584	长电科技	408,700	12,677,874.00	0.39
74	002465	海格通信	1,155,400	12,616,968.00	0.39
75	600703	三安光电	334,300	12,556,308.00	0.38
76	600460	士兰微	231,500	12,547,300.00	0.38
77	002745	木林森	826,500	12,504,945.00	0.38
78	002258	利尔化学	369,300	12,456,489.00	0.38

79	000423	东阿阿胶	251,100	12,241,125.00	0.37
80	600702	舍得酒业	52,600	11,955,980.00	0.37
81	600110	诺德股份	737,100	11,756,745.00	0.36
82	600779	水井坊	97,700	11,723,023.00	0.36
83	000988	华工科技	414,300	11,542,398.00	0.35
84	002386	天原股份	894,200	11,383,166.00	0.35
85	002402	和而泰	412,600	11,317,618.00	0.35
86	600380	健康元	850,700	10,922,988.00	0.33
87	300951	博硕科技	121,300	10,910,935.00	0.33
88	000519	中兵红箭	409,100	10,910,697.00	0.33
89	000661	长春高新	40,000	10,856,000.00	0.33
90	002939	长城证券	834,800	10,810,660.00	0.33
91	002555	三七互娱	398,500	10,767,470.00	0.33
92	002961	瑞达期货	434,900	10,715,936.00	0.33
93	002043	兔宝宝	879,100	10,619,528.00	0.33
94	603599	广信股份	270,400	10,545,600.00	0.32
95	688385	复旦微电	208,785	10,494,421.54	0.32
96	000776	广发证券	424,800	10,445,832.00	0.32
97	600516	方大炭素	953,118	10,312,736.76	0.32
98	688558	国盛智科	228,001	10,305,645.20	0.32
99	600383	金地集团	790,400	10,251,488.00	0.31
100	688621	阳光诺和	83,948	10,208,076.80	0.31
101	601699	潞安环能	900,000	10,179,000.00	0.31
102	300613	富瀚微	62,200	10,141,710.00	0.31
103	000968	蓝焰控股	1,071,300	10,016,655.00	0.31
104	600366	宁波韵升	757,000	9,999,970.00	0.31
105	600132	重庆啤酒	66,000	9,987,120.00	0.31
106	002129	中环股份	236,400	9,869,700.00	0.30
107	605399	晨光新材	248,100	9,852,051.00	0.30
108	605180	华生科技	272,200	9,608,660.00	0.29
109	300450	先导智能	129,200	9,608,604.00	0.29

110	300296	利亚德	931,900	9,551,975.00	0.29
111	688536	思瑞浦	12,400	9,523,200.00	0.29
112	300416	苏试试验	279,600	9,492,420.00	0.29
113	601012	隆基股份	110,100	9,490,620.00	0.29
114	003022	联泓新科	253,235	9,227,883.40	0.28
115	300776	帝尔激光	35,800	9,161,220.00	0.28
116	688030	山石网科	308,705	9,156,190.30	0.28
117	600141	兴发集团	240,560	9,112,412.80	0.28
118	603612	索通发展	440,900	9,047,268.00	0.28
119	605166	聚合顺	554,500	8,827,640.00	0.27
120	000537	广宇发展	361,700	8,716,970.00	0.27
121	002158	汉钟精机	324,300	8,636,109.00	0.26
122	688360	德马科技	256,100	8,348,860.00	0.26
123	688005	容百科技	72,200	8,344,876.00	0.26
124	688131	皓元医药	33,000	8,206,440.00	0.25
125	600499	科达制造	330,100	8,193,082.00	0.25
126	000893	亚钾国际	306,000	8,154,900.00	0.25
127	600809	山西汾酒	25,300	7,989,234.00	0.24
128	688596	正帆科技	308,631	7,978,111.35	0.24
129	688186	广大特材	178,100	7,945,041.00	0.24
130	002709	天赐材料	69,100	7,922,315.00	0.24
131	000568	泸州老窖	31,000	7,869,970.00	0.24
132	300122	智飞生物	63,000	7,849,800.00	0.24
133	688050	爱博医疗	37,225	7,825,811.75	0.24
134	002015	协鑫能科	469,862	7,733,928.52	0.24
135	600989	宝丰能源	437,200	7,589,792.00	0.23
136	600519	贵州茅台	3,700	7,585,000.00	0.23
137	000858	五粮液	34,000	7,570,440.00	0.23
138	002345	潮宏基	1,356,900	7,476,519.00	0.23
139	601155	新城控股	247,200	7,200,936.00	0.22
140	603589	口子窖	101,600	7,200,392.00	0.22

141	300009	安科生物	549,800	7,196,882.00	0.22
142	002906	华阳集团	129,400	7,111,824.00	0.22
143	600048	保利发展	453,400	7,086,642.00	0.22
144	600057	厦门象屿	832,600	7,068,774.00	0.22
145	688016	心脉医疗	28,399	7,063,967.26	0.22
146	300896	爱美客	13,000	6,969,430.00	0.21
147	000002	万科A	351,700	6,949,592.00	0.21
148	300748	金力永磁	154,400	6,931,016.00	0.21
149	002841	视源股份	84,500	6,878,300.00	0.21
150	601872	招商轮船	1,670,760	6,850,116.00	0.21
151	603939	益丰药房	124,000	6,833,640.00	0.21
152	688378	奥来德	85,199	6,824,439.90	0.21
153	603225	新凤鸣	458,600	6,810,210.00	0.21
154	600900	长江电力	300,000	6,810,000.00	0.21
155	002003	伟星股份	527,200	6,758,704.00	0.21
156	688122	西部超导	69,493	6,736,651.42	0.21
157	300832	新产业	152,580	6,721,149.00	0.21
158	601233	桐昆股份	316,600	6,705,588.00	0.21
159	002041	登海种业	256,500	6,615,135.00	0.20
160	300601	康泰生物	66,800	6,582,472.00	0.20
161	601166	兴业银行	344,900	6,566,896.00	0.20
162	600436	片仔癀	15,000	6,557,250.00	0.20
163	600256	广汇能源	999,800	6,538,692.00	0.20
164	000063	中兴通讯	195,000	6,532,500.00	0.20
165	600276	恒瑞医药	127,903	6,485,961.13	0.20
166	603259	药明康德	54,000	6,403,320.00	0.20
167	600036	招商银行	130,700	6,366,397.00	0.19
168	600873	梅花生物	828,800	6,356,896.00	0.19
169	601965	中国汽研	341,300	6,351,593.00	0.19
170	000066	中国长城	447,500	6,336,600.00	0.19
171	000725	京东方A	1,241,300	6,268,565.00	0.19

172	688595	芯海科技	50,199	6,247,265.55	0.19
173	002706	良信股份	350,523	6,246,319.86	0.19
174	600875	东方电气	291,400	6,241,788.00	0.19
175	688665	四方光电	34,739	6,225,923.58	0.19
176	300171	东富龙	122,800	6,206,312.00	0.19
177	002064	华峰化学	594,200	6,203,448.00	0.19
178	002009	天奇股份	256,500	6,197,040.00	0.19
179	300833	浩洋股份	76,000	6,158,280.00	0.19
180	002416	爱施德	537,200	6,113,336.00	0.19
181	600522	中天科技	356,100	6,039,456.00	0.18
182	002752	昇兴股份	885,700	5,978,475.00	0.18
183	300274	阳光电源	40,900	5,963,220.00	0.18
184	002821	凯莱英	13,700	5,959,500.00	0.18
185	600596	新安股份	236,200	5,902,638.00	0.18
186	002918	蒙娜丽莎	206,000	5,897,780.00	0.18
187	300750	宁德时代	10,000	5,880,000.00	0.18
188	002371	北方华创	16,900	5,864,638.00	0.18
189	002142	宁波银行	152,100	5,822,388.00	0.18
190	603659	璞泰来	36,200	5,814,082.00	0.18
191	688019	安集科技	21,200	5,791,840.00	0.18
192	300408	三环集团	128,300	5,722,180.00	0.18
193	688668	鼎通科技	80,932	5,704,087.36	0.17
194	601388	怡球资源	1,275,000	5,673,750.00	0.17
195	002466	天齐锂业	53,000	5,671,000.00	0.17
196	600745	闻泰科技	43,500	5,624,550.00	0.17
197	601865	福莱特	96,888	5,613,690.72	0.17
198	300799	左江科技	59,100	5,555,400.00	0.17
199	002185	华天科技	436,500	5,547,915.00	0.17
200	300620	光库科技	106,300	5,475,513.00	0.17
201	688257	新锐股份	82,700	5,474,740.00	0.17
202	002497	雅化集团	190,300	5,453,998.00	0.17

203	300347	泰格医药	42,500	5,431,500.00	0.17
204	300821	东岳硅材	296,100	5,412,708.00	0.17
205	605358	立昂微	44,900	5,388,449.00	0.17
206	688092	爱科科技	142,300	5,384,632.00	0.16
207	300587	天铁股份	269,400	5,379,918.00	0.16
208	300316	晶盛机电	77,300	5,372,350.00	0.16
209	002815	崇达技术	318,300	5,363,355.00	0.16
210	300661	圣邦股份	16,850	5,206,650.00	0.16
211	601882	海天精工	209,863	5,198,306.51	0.16
212	600884	杉杉股份	157,700	5,167,829.00	0.16
213	002149	西部材料	278,200	5,152,264.00	0.16
214	003043	华亚智能	64,200	5,150,124.00	0.16
215	300531	优博讯	251,663	5,141,475.09	0.16
216	688689	银河微电	122,400	5,117,544.00	0.16
217	688312	燕麦科技	189,229	5,109,183.00	0.16
218	002765	蓝黛科技	607,000	5,098,800.00	0.16
219	688314	康拓医疗	77,271	5,098,340.58	0.16
220	003026	中晶科技	68,600	5,079,830.00	0.16
221	002167	东方锆业	640,100	5,056,790.00	0.15
222	603517	绝味食品	73,838	5,045,350.54	0.15
223	000567	海德股份	282,400	5,040,840.00	0.15
224	603129	春风动力	29,100	5,034,300.00	0.15
225	002988	豪美新材	244,000	5,028,840.00	0.15
226	603055	台华新材	312,300	5,018,661.00	0.15
227	300014	亿纬锂能	42,400	5,010,832.00	0.15
228	603938	三孚股份	136,100	5,007,119.00	0.15
229	300582	英飞特	230,800	4,992,204.00	0.15
230	002870	香山股份	131,400	4,987,944.00	0.15
231	688670	金迪克	65,900	4,987,312.00	0.15
232	603507	振江股份	121,700	4,977,530.00	0.15
233	300451	创业慧康	443,700	4,960,566.00	0.15

234	688766	普冉股份	13,922	4,936,880.42	0.15
235	603610	麒盛科技	190,700	4,931,502.00	0.15
236	603822	嘉澳环保	118,118	4,912,527.62	0.15
237	688608	恒玄科技	15,971	4,871,155.00	0.15
238	688601	力芯微	32,000	4,857,600.00	0.15
239	603386	广东骏亚	230,900	4,839,664.00	0.15
240	600919	江苏银行	826,700	4,819,661.00	0.15
241	601615	明阳智能	184,000	4,802,400.00	0.15
242	600529	山东药玻	107,800	4,732,420.00	0.14
243	603028	赛福天	353,000	4,723,140.00	0.14
244	688568	中科星图	59,300	4,683,514.00	0.14
245	600570	恒生电子	74,460	4,627,689.00	0.14
246	601101	昊华能源	619,600	4,585,040.00	0.14
247	300682	朗新科技	121,200	4,488,036.00	0.14
248	603516	淳中科技	219,320	4,447,809.60	0.14
249	002241	歌尔股份	82,100	4,441,610.00	0.14
250	688690	纳微科技	55,600	4,437,992.00	0.14
251	002968	新大正	124,500	4,411,035.00	0.14
252	002832	比音勒芬	171,400	4,362,130.00	0.13
253	300088	长信科技	321,400	4,268,192.00	0.13
254	601658	邮储银行	781,400	3,985,140.00	0.12
255	300659	中孚信息	87,700	3,977,195.00	0.12
256	002126	银轮股份	316,300	3,972,728.00	0.12
257	688066	航天宏图	54,637	3,972,109.90	0.12
258	002139	拓邦股份	210,675	3,937,515.75	0.12
259	600965	福成股份	606,700	3,937,483.00	0.12
260	002459	晶澳科技	42,429	3,933,168.30	0.12
261	688188	柏楚电子	10,100	3,893,146.00	0.12
262	603916	苏博特	150,840	3,885,638.40	0.12
263	300982	苏文电能	52,600	3,870,834.00	0.12
264	601689	拓普集团	72,000	3,816,000.00	0.12

265	300033	同花顺	26,100	3,773,538.00	0.12
266	000860	顺鑫农业	97,500	3,722,550.00	0.11
267	300911	亿田智能	45,400	3,719,168.00	0.11
268	603816	顾家家居	48,200	3,719,112.00	0.11
269	688516	奥特维	15,093	3,708,651.96	0.11
270	688023	安恒信息	14,538	3,645,258.12	0.11
271	300124	汇川技术	53,000	3,635,800.00	0.11
272	300648	星云股份	59,300	3,569,267.00	0.11
273	300782	卓胜微	10,800	3,529,440.00	0.11
274	688080	映翰通	39,799	3,490,372.30	0.11
275	300496	中科创达	25,166	3,483,477.72	0.11
276	002837	英维克	84,100	3,438,849.00	0.11
277	002920	德赛西威	24,250	3,431,617.50	0.11
278	688169	石头科技	4,197	3,412,161.00	0.10
279	601966	玲珑轮胎	93,200	3,406,460.00	0.10
280	300763	锦浪科技	14,700	3,403,785.00	0.10
281	600039	四川路桥	282,000	3,395,280.00	0.10
282	600438	通威股份	75,100	3,376,496.00	0.10
283	688559	海目星	56,358	3,365,136.18	0.10
284	002430	杭氧股份	110,900	3,328,109.00	0.10
285	002212	天融信	173,100	3,318,327.00	0.10
286	300702	天宇股份	68,520	3,312,942.00	0.10
287	002979	雷赛智能	127,000	3,285,490.00	0.10
288	600732	爱旭股份	136,600	3,190,976.00	0.10
289	600180	瑞茂通	444,600	3,174,444.00	0.10
290	603558	健盛集团	264,200	3,112,276.00	0.10
291	301061	匠心家居	38,200	3,010,160.00	0.09
292	300790	宇瞳光学	66,600	3,008,988.00	0.09
293	002541	鸿路钢构	56,000	2,998,240.00	0.09
294	300126	锐奇股份	420,600	2,990,466.00	0.09
295	002135	东南网架	255,800	2,957,048.00	0.09

296	000897	津滨发展	1,085,000	2,951,200.00	0.09
297	002372	伟星新材	120,500	2,930,560.00	0.09
298	002932	明德生物	39,500	2,923,000.00	0.09
299	002271	东方雨虹	55,400	2,918,472.00	0.09
300	601128	常熟银行	439,800	2,907,078.00	0.09
301	600908	无锡银行	511,400	2,899,638.00	0.09
302	605186	健麾信息	78,000	2,828,280.00	0.09
303	600493	凤竹纺织	460,300	2,807,830.00	0.09
304	603906	龙蟠科技	74,900	2,774,296.00	0.08
305	002722	金轮股份	170,800	2,765,252.00	0.08
306	601838	成都银行	229,000	2,748,000.00	0.08
307	300512	中亚股份	168,900	2,695,644.00	0.08
308	002796	世嘉科技	317,200	2,613,728.00	0.08
309	603737	三棵树	18,700	2,602,105.00	0.08
310	601126	四方股份	123,900	2,589,510.00	0.08
311	600502	安徽建工	609,200	2,528,180.00	0.08
312	600268	国电南自	250,600	2,513,518.00	0.08
313	688006	杭可科技	23,305	2,507,151.90	0.08
314	002286	保龄宝	184,900	2,499,848.00	0.08
315	300575	中旗股份	111,000	2,491,950.00	0.08
316	300652	雷迪克	112,800	2,479,344.00	0.08
317	600309	万华化学	24,400	2,464,400.00	0.08
318	603486	科沃斯	16,300	2,460,485.00	0.08
319	600486	扬农化工	18,700	2,453,440.00	0.08
320	002081	金螳螂	400,800	2,436,864.00	0.07
321	002597	金禾实业	47,400	2,433,990.00	0.07
322	688499	利元亨	8,293	2,429,849.00	0.07
323	603681	永冠新材	61,700	2,424,810.00	0.07
324	601208	东材科技	138,200	2,397,770.00	0.07
325	600114	东睦股份	202,700	2,381,725.00	0.07
326	002791	坚朗五金	13,100	2,378,829.00	0.07

327	600710	苏美达	361,700	2,365,518.00	0.07
328	603217	元利科技	46,500	2,356,620.00	0.07
329	600426	华鲁恒升	75,000	2,347,500.00	0.07
330	002886	沃特股份	75,500	2,328,420.00	0.07
331	000510	新金路	392,400	2,319,084.00	0.07
332	002687	乔治白	328,000	2,318,960.00	0.07
333	603901	永创智能	143,500	2,310,350.00	0.07
334	300829	金丹科技	49,900	2,280,430.00	0.07
335	000731	四川美丰	216,700	2,249,346.00	0.07
336	002336	人人乐	447,200	2,240,472.00	0.07
337	688109	品茗股份	43,700	2,238,314.00	0.07
338	600491	龙元建设	321,500	2,215,135.00	0.07
339	688308	欧科亿	31,208	2,205,781.44	0.07
340	002154	报喜鸟	436,600	2,196,098.00	0.07
341	300103	达刚控股	228,600	2,183,130.00	0.07
342	600651	飞乐音响	693,600	2,150,160.00	0.07
343	000786	北新建材	59,200	2,121,136.00	0.06
344	600829	人民同泰	312,300	2,098,656.00	0.06
345	000683	远兴能源	284,100	2,073,930.00	0.06
346	002216	三全食品	102,200	2,065,462.00	0.06
347	300737	科顺股份	126,100	2,049,125.00	0.06
348	603002	宏昌电子	275,700	2,037,423.00	0.06
349	300596	利安隆	45,200	2,023,152.00	0.06
350	603041	美思德	162,300	2,010,897.00	0.06
351	002645	华宏科技	80,000	1,952,000.00	0.06
352	002818	富森美	155,900	1,950,309.00	0.06
353	603095	越剑智能	77,500	1,948,350.00	0.06
354	600692	亚通股份	324,600	1,902,156.00	0.06
355	603128	华贸物流	138,900	1,900,152.00	0.06
356	600811	东方集团	621,800	1,871,618.00	0.06
357	600801	华新水泥	93,869	1,811,671.70	0.06

358	600272	开开实业	216,400	1,776,644.00	0.05
359	603527	众源新材	146,900	1,770,145.00	0.05
360	300441	鲍斯股份	156,000	1,761,240.00	0.05
361	000902	新洋丰	103,600	1,749,804.00	0.05
362	300736	百邦科技	149,900	1,744,836.00	0.05
363	300384	三联虹普	71,500	1,719,575.00	0.05
364	002080	中材科技	50,300	1,711,206.00	0.05
365	688228	开普云	46,599	1,703,659.44	0.05
366	300417	南华仪器	140,300	1,700,436.00	0.05
367	601058	赛轮轮胎	114,000	1,686,060.00	0.05
368	688335	复洁环保	50,900	1,684,790.00	0.05
369	688613	奥精医疗	30,026	1,659,236.76	0.05
370	603739	蔚蓝生物	89,000	1,655,400.00	0.05
371	688633	星球石墨	25,800	1,628,496.00	0.05
372	000026	飞亚达	137,000	1,623,450.00	0.05
373	300371	汇中股份	108,600	1,621,398.00	0.05
374	605338	巴比食品	46,500	1,620,060.00	0.05
375	603897	长城科技	32,300	1,609,832.00	0.05
376	603326	我乐家居	166,100	1,606,187.00	0.05
377	000906	浙商中拓	143,500	1,594,285.00	0.05
378	600818	中路股份	182,800	1,586,704.00	0.05
379	002826	易明医药	144,900	1,586,655.00	0.05
380	300912	凯龙高科	65,700	1,576,143.00	0.05
381	003016	欣贺股份	147,600	1,537,992.00	0.05
382	688059	华锐精密	9,525	1,511,617.50	0.05
383	002150	通润装备	233,230	1,469,349.00	0.04
384	605080	浙江自然	19,400	1,451,120.00	0.04
385	002304	洋河股份	8,600	1,416,678.00	0.04
386	000818	航锦科技	36,400	1,350,804.00	0.04
387	002761	浙江建投	175,800	1,322,016.00	0.04
388	601636	旗滨集团	77,200	1,320,120.00	0.04

389	002718	友邦吊顶	100,700	1,274,862.00	0.04
390	600883	博闻科技	145,600	1,240,512.00	0.04
391	002103	广博股份	248,900	1,224,588.00	0.04
392	600650	锦江在线	126,600	1,214,094.00	0.04
393	603909	合诚股份	77,900	1,195,765.00	0.04
394	600836	上海易连	186,100	1,129,627.00	0.03
395	688779	长远锂科	43,086	984,945.96	0.03
396	002207	准油股份	171,700	976,973.00	0.03
397	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.03
398	000890	法尔胜	192,600	872,478.00	0.03
399	002633	申科股份	98,200	831,754.00	0.03
400	000715	中兴商业	158,900	777,021.00	0.02
401	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.02
402	688466	金科环境	31,281	675,043.98	0.02
403	688113	联测科技	11,000	671,000.00	0.02
404	002395	双象股份	64,400	667,828.00	0.02
405	000586	汇源通信	72,800	649,376.00	0.02
406	688069	德林海	13,000	643,500.00	0.02
407	688105	诺唯赞	6,180	576,532.20	0.02
408	688110	东芯股份	14,044	566,956.28	0.02
409	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.01
410	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
411	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.00
412	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.00
413	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
414	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
415	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
416	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
417	002781	奇信股份	7,800	54,210.00	0.00
418	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
419	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00

420	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
421	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
422	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
423	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
424	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
425	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
426	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
427	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
428	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
429	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
430	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
431	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
432	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
433	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
434	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
435	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
436	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
437	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
438	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
439	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
440	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
441	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
442	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
443	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
444	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
445	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
446	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
447	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
448	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
449	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
450	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00

451	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
452	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
453	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
454	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
455	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
456	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
457	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
458	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
459	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
460	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
461	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
462	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
463	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
464	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
465	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
466	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
467	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
468	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
469	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
470	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000683	远兴能源	99,923,283.40	9.29
2	600309	万华化学	99,702,716.46	9.27
3	003022	联泓新科	97,272,084.48	9.04
4	002013	中航机电	90,286,188.69	8.40
5	603737	三棵树	89,149,059.87	8.29

6	300073	当升科技	87,699,879.45	8.15
7	300196	长海股份	80,212,388.26	7.46
8	002812	恩捷股份	79,961,995.41	7.44
9	002709	天赐材料	79,639,931.52	7.41
10	603259	药明康德	77,538,412.21	7.21
11	002318	久立特材	74,365,559.40	6.91
12	300059	东方财富	71,189,076.01	6.62
13	002241	歌尔股份	69,970,097.00	6.51
14	300037	新宙邦	69,166,320.66	6.43
15	002555	三七互娱	69,016,690.03	6.42
16	600900	长江电力	68,400,579.11	6.36
17	300725	药石科技	65,506,716.63	6.09
18	000807	云铝股份	65,029,742.56	6.05
19	000977	浪潮信息	64,521,922.35	6.00
20	688186	广大特材	63,001,434.31	5.86
21	603799	华友钴业	62,271,462.92	5.79
22	002371	北方华创	62,210,119.72	5.78
23	002466	天齐锂业	61,997,065.21	5.76
24	300696	爱乐达	61,221,303.77	5.69
25	002648	卫星化学	60,058,034.99	5.58
26	002311	海大集团	59,767,952.36	5.56
27	300896	爱美客	59,721,858.57	5.55
28	600863	内蒙华电	59,127,474.73	5.50
29	300124	汇川技术	58,626,675.75	5.45
30	002128	电投能源	58,076,647.83	5.40
31	600522	中天科技	56,818,893.60	5.28
32	600188	兖矿能源	56,671,987.02	5.27
33	300413	芒果超媒	55,681,275.09	5.18
34	300454	深信服	54,716,450.54	5.09
35	600760	中航沈飞	54,634,614.65	5.08
36	600176	中国巨石	54,610,134.55	5.08

37	603707	健友股份	54,479,424.41	5.07
38	300122	智飞生物	54,281,295.92	5.05
39	600702	舍得酒业	53,853,219.00	5.01
40	002881	美格智能	53,519,085.31	4.98
41	600426	华鲁恒升	53,352,681.76	4.96
42	000902	新洋丰	53,164,348.22	4.94
43	601966	玲珑轮胎	52,459,201.65	4.88
44	002352	顺丰控股	51,793,794.89	4.82
45	000063	中兴通讯	51,010,073.20	4.74
46	000661	长春高新	50,581,270.04	4.70
47	000733	振华科技	49,367,372.74	4.59
48	601677	明泰铝业	49,328,410.50	4.59
49	300363	博腾股份	49,202,011.10	4.57
50	601699	潞安环能	49,184,018.06	4.57
51	002850	科达利	49,176,984.94	4.57
52	300568	星源材质	47,897,615.02	4.45
53	688019	安集科技	47,507,548.99	4.42
54	600584	长电科技	47,218,312.33	4.39
55	601633	长城汽车	46,945,572.05	4.37
56	600456	宝钛股份	46,496,412.04	4.32
57	002643	万润股份	46,039,095.68	4.28
58	000002	万科A	46,019,131.89	4.28
59	603613	国联股份	45,531,698.95	4.23
60	600048	保利发展	45,446,551.10	4.23
61	600487	亨通光电	44,679,097.84	4.15
62	002080	中材科技	44,206,239.82	4.11
63	601225	陕西煤业	43,813,230.05	4.07
64	002436	兴森科技	43,778,673.00	4.07
65	002739	万达电影	42,636,668.82	3.96
66	688188	柏楚电子	42,623,488.77	3.96
67	601012	隆基股份	42,386,974.20	3.94

68	002876	三利谱	41,904,220.62	3.90
69	002756	永兴材料	41,850,912.04	3.89
70	688005	容百科技	41,555,142.61	3.86
71	600011	华能国际	41,541,489.34	3.86
72	002025	航天电器	41,089,453.96	3.82
73	603659	璞泰来	40,374,836.46	3.75
74	600886	国投电力	40,367,074.60	3.75
75	603501	韦尔股份	40,207,457.74	3.74
76	300751	迈为股份	39,857,026.54	3.71
77	300347	泰格医药	39,626,217.66	3.68
78	600690	海尔智家	39,264,800.60	3.65
79	000786	北新建材	39,112,711.11	3.64
80	603392	万泰生物	39,100,679.20	3.64
81	300887	谱尼测试	39,078,469.08	3.63
82	300207	欣旺达	39,054,595.78	3.63
83	002410	广联达	38,836,881.78	3.61
84	300065	海兰信	38,742,960.28	3.60
85	688598	金博股份	38,042,730.41	3.54
86	600141	兴发集团	37,799,363.70	3.51
87	600763	通策医疗	37,614,102.92	3.50
88	002594	比亚迪	37,477,168.16	3.48
89	000657	中钨高新	37,385,923.04	3.48
90	000963	华东医药	36,750,631.76	3.42
91	000818	航锦科技	36,073,364.00	3.35
92	300408	三环集团	36,006,705.70	3.35
93	600516	方大炭素	35,863,563.36	3.33
94	300755	华致酒行	35,833,739.80	3.33
95	002271	东方雨虹	35,776,328.63	3.33
96	603986	兆易创新	35,545,036.84	3.31
97	688388	嘉元科技	35,517,424.29	3.30
98	600546	山煤国际	35,368,680.81	3.29

99	688233	神工股份	35,228,633.16	3.28
100	600183	生益科技	35,091,831.60	3.26
101	000968	蓝焰控股	35,032,011.00	3.26
102	601155	新城控股	35,013,157.70	3.26
103	688536	思瑞浦	34,998,627.70	3.25
104	002015	协鑫能科	34,678,682.52	3.22
105	688037	芯源微	34,642,642.35	3.22
106	000768	中航西飞	34,503,838.56	3.21
107	603816	顾家家居	34,173,502.78	3.18
108	688301	奕瑞科技	33,481,914.47	3.11
109	600116	三峡水利	33,207,922.72	3.09
110	688356	键凯科技	33,190,819.25	3.09
111	688357	建龙微纳	33,179,177.01	3.09
112	688596	正帆科技	33,174,076.31	3.08
113	600703	三安光电	33,043,842.80	3.07
114	002402	和而泰	32,971,146.49	3.07
115	300709	精研科技	32,622,627.54	3.03
116	000932	华菱钢铁	32,550,880.63	3.03
117	688023	安恒信息	32,396,700.55	3.01
118	000725	京东方A	32,383,626.00	3.01
119	688518	联赢激光	32,360,617.70	3.01
120	603456	九洲药业	32,238,291.56	3.00
121	300761	立华股份	32,226,936.07	3.00
122	600803	新奥股份	32,103,863.45	2.99
123	603260	合盛硅业	32,102,190.72	2.98
124	300035	中科电气	32,052,042.00	2.98
125	601872	招商轮船	31,931,737.07	2.97
126	603517	绝味食品	31,765,091.08	2.95
127	002833	弘亚数控	31,639,327.99	2.94
128	688516	奥特维	31,472,991.45	2.93
129	600383	金地集团	31,088,180.08	2.89

130	002714	牧原股份	31,042,625.98	2.89
131	600114	东睦股份	31,022,278.44	2.88
132	300593	新雷能	30,805,090.92	2.86
133	600063	皖维高新	30,782,004.03	2.86
134	600570	恒生电子	30,762,924.11	2.86
135	600036	招商银行	30,726,635.00	2.86
136	688561	奇安信	30,635,430.70	2.85
137	600276	恒瑞医药	30,632,641.55	2.85
138	300496	中科创达	30,483,500.23	2.83
139	600745	闻泰科技	30,234,010.00	2.81
140	600019	宝钢股份	29,914,172.44	2.78
141	600030	中信证券	29,805,005.58	2.77
142	002460	赣锋锂业	29,786,124.29	2.77
143	600765	中航重机	29,768,610.49	2.77
144	688135	利扬芯片	29,728,188.92	2.76
145	603486	科沃斯	29,679,349.00	2.76
146	002167	东方锆业	29,048,808.80	2.70
147	002920	德赛西威	28,701,966.57	2.67
148	600110	诺德股份	28,637,572.99	2.66
149	300702	天宇股份	28,478,122.00	2.65
150	688200	华峰测控	28,455,883.48	2.65
151	603129	春风动力	28,415,849.81	2.64
152	300450	先导智能	28,373,210.51	2.64
153	002138	顺络电子	28,185,470.07	2.62
154	601238	广汽集团	28,011,810.22	2.60
155	601689	拓普集团	27,872,907.26	2.59
156	603197	保隆科技	27,872,077.46	2.59
157	002791	坚朗五金	27,751,522.16	2.58
158	000723	美锦能源	27,667,558.15	2.57
159	002845	同兴达	27,660,218.71	2.57
160	300274	阳光电源	27,620,717.01	2.57

161	300772	运达股份	27,479,583.00	2.56
162	688099	晶晨股份	27,376,326.05	2.55
163	002472	双环传动	27,337,962.09	2.54
164	300750	宁德时代	27,149,922.00	2.52
165	002139	拓邦股份	27,132,555.25	2.52
166	300014	亿纬锂能	27,055,267.00	2.52
167	300832	新产业	26,867,191.26	2.50
168	601636	旗滨集团	26,848,546.42	2.50
169	600729	重庆百货	26,666,859.51	2.48
170	002258	利尔化学	26,431,920.43	2.46
171	002179	中航光电	26,231,623.31	2.44
172	300033	同花顺	26,226,508.42	2.44
173	300782	卓胜微	26,225,954.85	2.44
174	300409	道氏技术	26,099,887.89	2.43
175	600438	通威股份	26,050,241.00	2.42
176	002541	鸿路钢构	26,042,787.95	2.42
177	002150	通润装备	25,995,076.56	2.42
178	603826	坤彩科技	25,956,320.97	2.41
179	600323	瀚蓝环境	25,935,675.91	2.41
180	601899	紫金矿业	25,935,661.00	2.41
181	000988	华工科技	25,885,938.20	2.41
182	600039	四川路桥	25,686,047.72	2.39
183	000519	中兵红箭	25,445,321.00	2.37
184	300672	国科微	25,148,348.92	2.34
185	603035	常熟汽饰	25,077,109.70	2.33
186	300866	安克创新	24,952,926.00	2.32
187	603444	吉比特	24,867,005.00	2.31
188	688202	美迪西	24,736,754.75	2.30
189	002706	良信股份	24,425,744.53	2.27
190	002867	周大生	24,171,037.27	2.25
191	002078	太阳纸业	24,108,545.24	2.24

192	603688	石英股份	24,013,638.99	2.23
193	000898	鞍钢股份	23,927,808.70	2.22
194	688366	昊海生科	23,890,706.42	2.22
195	600057	厦门象屿	23,848,379.04	2.22
196	300260	新莱应材	23,624,305.30	2.20
197	603885	吉祥航空	23,515,041.22	2.19
198	688050	爱博医疗	23,475,926.49	2.18
199	600233	圆通速递	23,289,284.52	2.17
200	000629	攀钢钒钛	23,054,595.49	2.14
201	300638	广和通	22,996,317.07	2.14
202	300316	晶盛机电	22,762,735.80	2.12
203	000915	华特达因	22,586,245.03	2.10
204	600588	用友网络	22,546,612.86	2.10
205	002274	华昌化工	22,541,987.64	2.10
206	688066	航天宏图	22,510,911.24	2.09
207	002968	新大正	22,385,695.50	2.08
208	603818	曲美家居	22,315,783.07	2.07
209	600519	贵州茅台	22,314,797.00	2.07
210	688016	心脉医疗	22,165,637.96	2.06
211	002216	三全食品	22,000,382.43	2.05
212	603589	口子窖	21,990,950.00	2.04
213	600171	上海贝岭	21,969,887.67	2.04
214	600847	万里股份	21,941,761.43	2.04
215	300015	爱尔眼科	21,876,300.67	2.03
216	600529	山东药玻	21,851,856.00	2.03
217	603198	迎驾贡酒	21,772,863.09	2.02

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例 (%)
1	000683	远兴能源	110,970,136.94	10.32
2	600309	万华化学	108,766,958.85	10.11
3	003022	联泓新科	91,655,410.83	8.52
4	603737	三棵树	86,514,419.68	8.04
5	300196	长海股份	82,531,586.18	7.67
6	002812	恩捷股份	82,418,824.01	7.66
7	002241	歌尔股份	80,315,056.38	7.47
8	002013	中航机电	79,768,122.33	7.42
9	603259	药明康德	77,350,022.67	7.19
10	603799	华友钴业	75,729,965.04	7.04
11	002709	天赐材料	74,533,582.38	6.93
12	600900	长江电力	72,671,659.16	6.76
13	300363	博腾股份	71,891,069.16	6.68
14	300696	爱乐达	70,074,134.85	6.52
15	000807	云铝股份	66,331,941.27	6.17
16	002318	久立特材	66,134,597.38	6.15
17	002466	天齐锂业	65,542,057.48	6.09
18	601966	玲珑轮胎	65,432,053.25	6.08
19	002555	三七互娱	64,939,244.12	6.04
20	600863	内蒙华电	63,752,304.81	5.93
21	300073	当升科技	62,682,579.02	5.83
22	300124	汇川技术	62,097,475.52	5.77
23	300059	东方财富	59,633,672.48	5.54
24	300413	芒果超媒	59,274,524.58	5.51
25	002371	北方华创	59,196,584.55	5.50
26	300454	深信服	58,645,158.15	5.45
27	600188	兖矿能源	58,230,084.16	5.41
28	600426	华鲁恒升	58,096,517.70	5.40
29	600760	中航沈飞	55,873,025.87	5.20
30	600522	中天科技	54,963,117.99	5.11

31	600176	中国巨石	54,475,751.62	5.07
32	002739	万达电影	53,047,410.80	4.93
33	000902	新洋丰	52,712,094.35	4.90
34	300037	新宙邦	52,446,472.33	4.88
35	300896	爱美客	51,064,592.90	4.75
36	300568	星源材质	51,008,930.07	4.74
37	300122	智飞生物	50,561,744.75	4.70
38	600456	宝钛股份	50,516,115.10	4.70
39	000063	中兴通讯	49,882,811.42	4.64
40	300725	药石科技	49,869,891.40	4.64
41	688186	广大特材	49,647,189.61	4.62
42	601633	长城汽车	48,772,307.76	4.53
43	002080	中材科技	47,930,751.74	4.46
44	600011	华能国际	47,822,686.00	4.45
45	601225	陕西煤业	47,614,625.78	4.43
46	000002	万科A	47,588,332.08	4.42
47	002311	海大集团	47,458,407.17	4.41
48	688019	安集科技	46,364,353.74	4.31
49	002128	电投能源	45,982,739.07	4.28
50	000661	长春高新	44,998,220.83	4.18
51	000977	浪潮信息	44,258,299.54	4.12
52	002352	顺丰控股	43,399,736.02	4.04
53	600702	舍得酒业	43,183,016.08	4.02
54	601636	旗滨集团	43,009,760.60	4.00
55	002436	兴森科技	42,901,139.19	3.99
56	601012	隆基股份	42,654,619.54	3.97
57	603501	韦尔股份	42,467,994.41	3.95
58	002648	卫星化学	42,218,494.11	3.93
59	601699	潞安环能	42,054,912.00	3.91
60	600886	国投电力	41,580,421.55	3.87
61	601899	紫金矿业	41,530,004.32	3.86

62	002850	科达利	41,164,288.85	3.83
63	600141	兴发集团	41,030,570.56	3.82
64	603392	万泰生物	40,997,478.35	3.81
65	600546	山煤国际	40,956,149.00	3.81
66	002594	比亚迪	40,437,141.25	3.76
67	688188	柏楚电子	40,268,825.21	3.74
68	688037	芯源微	40,094,022.10	3.73
69	300207	欣旺达	39,685,917.70	3.69
70	600019	宝钢股份	38,971,570.85	3.62
71	600048	保利发展	38,586,678.50	3.59
72	300496	中科创达	38,490,690.06	3.58
73	002881	美格智能	37,670,036.50	3.50
74	300065	海兰信	37,299,458.66	3.47
75	000932	华菱钢铁	37,228,499.81	3.46
76	000818	航锦科技	36,939,817.00	3.43
77	603707	健友股份	36,427,770.11	3.39
78	002271	东方雨虹	35,951,716.23	3.34
79	002643	万润股份	35,781,723.67	3.33
80	688202	美迪西	35,614,042.00	3.31
81	603659	璞泰来	35,324,355.09	3.28
82	300750	宁德时代	34,899,251.55	3.25
83	600763	通策医疗	34,380,781.00	3.20
84	002179	中航光电	33,811,205.83	3.14
85	000723	美锦能源	33,755,206.00	3.14
86	000963	华东医药	33,743,377.32	3.14
87	300593	新雷能	33,602,862.29	3.12
88	600803	新奥股份	33,211,528.00	3.09
89	600063	皖维高新	33,101,679.93	3.08
90	600276	恒瑞医药	32,488,679.64	3.02
91	000629	攀钢钒钛	32,488,487.72	3.02
92	002833	弘亚数控	32,455,856.47	3.02

93	603613	国联股份	32,415,752.34	3.01
94	688005	容百科技	32,411,921.85	3.01
95	601677	明泰铝业	32,403,103.00	3.01
96	000568	泸州老窖	32,177,699.00	2.99
97	000786	北新建材	31,828,343.45	2.96
98	600745	闻泰科技	31,586,591.35	2.94
99	300347	泰格医药	31,506,261.84	2.93
100	002714	牧原股份	31,235,820.71	2.90
101	002460	赣锋锂业	30,840,719.35	2.87
102	300274	阳光电源	30,785,622.11	2.86
103	603816	顾家家居	30,779,582.68	2.86
104	688516	奥特维	30,584,411.89	2.84
105	300408	三环集团	30,503,605.17	2.84
106	688023	安恒信息	30,350,509.19	2.82
107	002025	航天电器	30,059,864.15	2.80
108	002139	拓邦股份	29,929,998.08	2.78
109	601238	广汽集团	29,860,186.99	2.78
110	600584	长电科技	29,844,496.54	2.78
111	002138	顺络电子	29,604,451.20	2.75
112	000725	京东方A	29,577,152.36	2.75
113	688536	思瑞浦	29,395,914.05	2.73
114	300458	全志科技	29,340,170.00	2.73
115	603688	石英股份	29,262,905.00	2.72
116	601168	西部矿业	28,881,844.00	2.69
117	002928	华夏航空	28,855,988.96	2.68
118	000519	中兵红箭	28,623,870.23	2.66
119	600114	东睦股份	28,283,655.44	2.63
120	002791	坚朗五金	28,062,604.40	2.61
121	002541	鸿路钢构	27,916,987.42	2.60
122	002027	分众传媒	27,778,271.03	2.58
123	600096	云天化	27,732,853.00	2.58

124	600570	恒生电子	27,711,516.54	2.58
125	601318	中国平安	27,538,035.00	2.56
126	601155	新城控股	27,473,372.80	2.55
127	300671	富满微	27,307,054.60	2.54
128	603197	保隆科技	27,281,205.20	2.54
129	603486	科沃斯	26,609,961.45	2.47
130	603517	绝味食品	26,373,328.00	2.45
131	002410	广联达	25,963,312.33	2.41
132	600036	招商银行	25,961,275.17	2.41
133	600660	福耀玻璃	25,816,171.93	2.40
134	300409	道氏技术	25,690,705.76	2.39
135	300014	亿纬锂能	25,683,502.00	2.39
136	600703	三安光电	25,657,810.53	2.39
137	002335	科华数据	25,555,990.91	2.38
138	688301	奕瑞科技	25,385,128.50	2.36
139	000968	蓝焰控股	25,380,498.07	2.36
140	603826	坤彩科技	25,312,791.00	2.35
141	002167	东方锆业	25,250,969.00	2.35
142	688388	嘉元科技	25,192,436.72	2.34
143	600690	海尔智家	25,166,668.41	2.34
144	600519	贵州茅台	25,153,107.00	2.34
145	600039	四川路桥	25,094,896.00	2.33
146	600233	圆通速递	25,025,317.00	2.33
147	688596	正帆科技	24,998,096.82	2.32
148	002015	协鑫能科	24,972,958.00	2.32
149	603818	曲美家居	24,742,904.00	2.30
150	603129	春风动力	24,712,078.76	2.30
151	002150	通润装备	24,652,926.82	2.29
152	600487	亨通光电	24,644,410.00	2.29
153	002867	周大生	24,573,137.89	2.28
154	002920	德赛西威	24,327,424.00	2.26

155	000898	鞍钢股份	24,175,150.40	2.25
156	600323	瀚蓝环境	24,121,525.63	2.24
157	600926	杭州银行	24,087,812.98	2.24
158	002756	永兴材料	23,740,041.50	2.21
159	002845	同兴达	23,645,675.46	2.20
160	300432	富临精工	23,628,593.30	2.20
161	300782	卓胜微	23,620,469.61	2.20
162	002078	太阳纸业	23,609,433.78	2.20
163	600516	方大炭素	23,535,927.00	2.19
164	600409	三友化工	23,463,719.06	2.18
165	601872	招商轮船	23,417,761.80	2.18
166	601689	拓普集团	23,352,305.00	2.17
167	603456	九洲药业	23,235,100.80	2.16
168	002876	三利谱	23,047,275.20	2.14
169	600438	通威股份	22,818,897.02	2.12
170	002048	宁波华翔	22,748,558.75	2.12
171	002727	一心堂	22,689,109.32	2.11
172	000915	华特达因	22,571,051.59	2.10
173	300450	先导智能	22,500,885.92	2.09
174	300761	立华股份	22,448,138.00	2.09
175	600729	重庆百货	22,381,053.00	2.08
176	600765	中航重机	22,355,804.00	2.08
177	300373	扬杰科技	22,353,138.01	2.08
178	600847	万里股份	22,289,339.00	2.07
179	300660	江苏雷利	22,288,130.24	2.07
180	300702	天宇股份	22,181,922.40	2.06
181	601117	中国化学	22,148,031.00	2.06
182	688233	神工股份	21,974,401.49	2.04
183	600383	金地集团	21,843,604.42	2.03
184	300033	同花顺	21,620,442.00	2.01
185	600529	山东药玻	21,617,955.00	2.01

186	002402	和而泰	21,536,409.80	2.00
-----	--------	-----	---------------	------

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,079,795,887.30
卖出股票收入（成交）总额	13,454,337,683.87

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2206	IC2206	33	47,175,480.00	2,059,600.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					2,059,600.00
股指期货投资本期收益（元）					19,678,26

	0.67
股指期货投资本期公允价值变动（元）	1,196,751.52

### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	7,438,198.75
2	应收证券清算款	8,335,805.65
3	应收股利	-
4	应收利息	47,604.01
5	应收申购款	7,196,309.19
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,017,917.60

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
中欧 数据 挖掘 混合A	56,298	19,999.50	1,004,822,380.50	89.24%	121,109,350.40	10.76%
中欧 数据 挖掘 混合C	177,265	2,850.07	374,403,694.45	74.11%	130,813,921.54	25.89%
合计	233,563	6,983.77	1,379,226,074.95	84.56%	251,923,271.94	15.44%

## 9.2 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	2,065,880.56	0.18%
	中欧数据挖掘混合C	40,686.27	0.01%
	合计	2,106,566.83	0.13%

## 9.3 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	>100
	中欧数据挖掘混合 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	中欧数据挖掘混合 A	0
	中欧数据挖掘混合 C	0
	合计	0

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万 份)
曲径	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	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01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	376,726,641.51	184,251,218.04
本报告期基金总申购份额	1,064,720,775.47	876,570,147.71
减：本报告期基金总赎回份额	315,515,686.08	555,603,749.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,125,931,730.90	505,217,615.99

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 11.2.2 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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2017年12月30日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为90,000.00元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信	1	-	-	-	-	-

证券						
海通 证券	1	701,635,100.19	2.46%	653,436.67	2.52%	-
华创 证券	1	788,010,975.87	2.76%	576,277.55	2.22%	-
平安 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	210,873,831.38	0.74%	154,213.21	0.59%	-
天风 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	163,153,819.02	0.57%	151,948.45	0.59%	-
西南 证券	1	115,716,152.47	0.41%	107,766.60	0.42%	-
兴业 证券	1	11,021,161,569.70	38.67%	10,264,001.11	39.53%	-
浙商 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中信 证券	1	-	-	-	-	-
中信 证券 (华 南)	1	-	-	-	-	-
德邦 证券	2	776,646,374.39	2.72%	567,964.22	2.19%	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	796,570,497.01	2.79%	708,868.86	2.73%	-

东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	12,779,449,176.46	44.83%	11,901,552.22	45.84%	-
民生证券	2	187,861,664.02	0.66%	137,384.05	0.53%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	962,236,512.64	3.38%	739,572.66	2.85%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-

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

2. 本报告期内，本基金新增租用中金公司上海交易单元、东方财富深圳交易单元、东北证券上海交易单元、华创证券深圳交易单元、民生证券深圳交易单元、民生证券上海交易单元、中信建投上海交易单元、华泰证券上海交易单元、东兴证券上海交易单元、华泰证券上海交易单元、东方证券深圳交易单元、德邦证券上海交易单元、德邦证券深圳交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	202,670. 80	17.4 2%	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	960,751. 52	82.5 8%	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

2. 本报告期内，本基金新增租用中金公司上海交易单元、东方财富深圳交易单元、东北证券上海交易单元、华创证券深圳交易单元、民生证券深圳交易单元、民生证券上海交

易单元、中信建投上海交易单元、华泰证券上海交易单元、东兴证券上海交易单元、华泰证券上海交易单元、东方证券深圳交易单元、德邦证券上海交易单元、德邦证券深圳交易单元。

### 11.8 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2020年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
2	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“科顺股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-09
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
5	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
6	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
8	中欧基金管理有限公司关于基金经理休假由他人代为履行职责的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-30
9	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-07-14

10	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
13	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金产品在中欧财富电子交易平台开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
14	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
15	中欧基金管理有限公司办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-17
16	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	2021-09-30
17	中欧基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
18	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
19	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年10月）	中国证监会指定媒介	2021-10-22
20	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
21	中欧数据挖掘多因子灵活配	中国证监会指定媒介	2021-10-27

	置混合型证券投资基金2021年第三季度报告		
22	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2021-11-12
23	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2021-12-11
24	中欧基金管理有限公司关于调整中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入和定期定额投资限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-12-22

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额不存在达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([www.zofund.com](http://www.zofund.com))查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的住所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇二二年三月三十一日